

Документ подписан простой электронной подписью.
Информация о владельце:

ФИО: Кандрашина Елена Александровна

Должность: И.о. ректора ФГАОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 22.07.2024 16:15:21

Уникальный программный ключ:

2db64eb9605ce27edd3b8e8fdd32c70e0674ddd2

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный экономический университет»

Институт Институт национальной и мировой экономики

Кафедра Экономической теории

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета

(протокол № 10 от 30 мая 2024 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Наименование дисциплины Б1.В.07 Анализ финансовых рынков

Основная профессиональная образовательная программа 38.04.01 Экономика программа Диджитал проектирование бизнес-моделей на финансовом рынке

Квалификация (степень) выпускника магистр

Самара 2024

Содержание (рабочая программа)

Стр.

- 1 Место дисциплины в структуре ОП
- 2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 3 Объем и виды учебной работы
- 4 Содержание дисциплины
- 5 Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины
- 6 Фонд оценочных средств по дисциплине

Целью изучения дисциплины является формирование результатов обучения, обеспечивающих достижение планируемых результатов освоения образовательной программы.

1. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Анализ финансовых рынков входит в часть, формируемая участниками образовательных отношений блока Б1. Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Диджитал технологии в финансовой сфере

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Изучение дисциплины Анализ финансовых рынков в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-3 - Способен обосновывать подходы в бизнес-анализе и руководить процессом реализации инвестиционного проекта

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-3	ПК-3.1: Знать:	ПК-3.2: Уметь:	ПК-3.3: Владеть (иметь навыки):
	методики обоснования подходов в бизнес анализе	руководить процессом реализации инвестиционного проекта	навыками обоснования подходов в бизнес анализе и руководства процессами реализации инвестиционных проектов

3. Объем и виды учебной работы

Учебным планом предусматриваются следующие виды учебной работы по дисциплине:

Очная форма обучения

Виды учебной работы	Всего час/ з.е.
	Сем 3
Контактная работа, в том числе:	22.3/0.62
Занятия семинарского типа	20/0.56
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.3/0.01
Групповая контактная работа (ГКР)	2/0.06
Самостоятельная работа:	123.7/3.44
Курсовой проект	+
Промежуточная аттестация	34/0.94
Вид промежуточной аттестации:	
Экзамен	Экз
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	180
Зачетные единицы	5

4. Содержание дисциплины

4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Анализ финансовых рынков представлен в таблице.

Разделы, темы дисциплины и виды занятий Очная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контактная работа			Самостоятельная работа	Планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по образовательной программе
		Занятия семинарского типа		ИКР		
		Практич. занятия				
1.	Аналитические подходы к прогнозированию динамики финансовых рынков	10			50	ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3
2.	Фундаментальный анализ финансового рынка	10			73.7	ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3
	Выполнение курсового проекта		3			
	Контроль	34				
	Итого	20	0.3	2	123.7	

4.2 Содержание разделов и тем

4.2.1 Контактная работа

Тематика занятий семинарского типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия семинарского типа**	Тематика занятия семинарского типа
1.	Аналитические подходы к прогнозированию динамики финансовых рынков	практическое занятие	Основные подходы к изучению динамики финансовых рынков
		практическое занятие	Межрыночный анализ: понятие, тенденции, практическое использование
		практическое занятие	Динамика финансовых рынков: тенденции, особенности, подходы к изучению
		практическое занятие	Практика применения межрыночного анализа
2.	Фундаментальный анализ финансового рынка	практическое занятие	Фундаментальный анализ: цели, назначение, специфика
		практическое занятие	Практика проведения фундаментального анализа финансовых активов
		практическое занятие	Методика определения справедливой стоимости финансовых активов
		практическое занятие	Особенности фундаментального анализа на различных финансовых рынках

** семинары, практические занятия, практикумы, лабораторные работы, коллоквиумы и иные аналогичные занятия

Иная контактная работа

При проведении учебных занятий СГЭУ обеспечивает развитие у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств (включая при необходимости проведение интерактивных лекций, групповых дискуссий, ролевых игр, тренингов, анализ ситуаций и имитационных моделей, преподавание дисциплин (модулей) в форме курсов, составленных на основе результатов научных исследований, проводимых организацией, в том числе с учетом региональных особенностей профессиональной деятельности выпускников и потребностей работодателей).

Формы и методы проведения иной контактной работы приведены в Методических указаниях по основной профессиональной образовательной программе.

4.2.2 Самостоятельная работа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид самостоятельной работы ***
1.	Аналитические подходы к прогнозированию	- подготовка доклада

	динамики финансовых рынков	- подготовка электронной презентации - тестирование
2.	Фундаментальный анализ финансового рынка	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование

*** самостоятельная работа в семестре, написание курсовых работ, докладов, выполнение контрольных работ

5. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

5.1 Литература:

Основная литература

1. Финансовые рынки и институты : учебник и практикум для вузов / Н. Б. Болдырева [и др.] ; под редакцией Н. Б. Болдыревой, Г. В. Черновой. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 379 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-15055-1. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/512162>

2. Жилкина, А. Н. Финансовый анализ : учебник и практикум для вузов / А. Н. Жилкина. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 285 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02401-2. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/510908>

3. Международный финансовый рынок : учебник и практикум для вузов / М. А. Эскиндаров [и др.] ; под общей редакцией М. А. Эскиндарова, Е. А. Звонковой. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 453 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-8904-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/512093>

Дополнительная литература

1. Международные валютно-кредитные и финансовые отношения : учебник для вузов / Л. Н. Красавина [и др.] ; ответственный редактор Л. Н. Красавина. — 5-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 534 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-08791-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/510756>

2. Финансовый анализ : учебник и практикум для вузов / И. Ю. Евстафьева [и др.] ; под общей редакцией И. Ю. Евстафьевой, В. А. Черненко. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 337 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00627-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/511414>

3. Гусева, И. А. Финансовые рынки и институты : учебник и практикум для вузов / И. А. Гусева. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 347 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00339-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/511698>

5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения

1. Astra Linux Special Edition «Смоленск», «Орел»; РедОС
2. МойОфис Стандартный 2, МойОфис Образование, Р7-Офис Профессиональный

5.3 Современные профессиональные базы данных, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Профессиональная база данных «Информационные системы Министерства экономического развития Российской Федерации в сети Интернет» (Портал «Официальная Россия» - <http://www.gov.ru/>)

2. Государственная система правовой информации «Официальный интернет-портал правовой информации» (<http://pravo.gov.ru/>)

3. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/>)

4. Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт

5.4. Информационно-справочные системы, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Справочно-правовая система «Консультант Плюс»
2. Справочно-правовая система «ГАРАНТ-Максимум»

5.5. Специальные помещения

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран
Учебные аудитории для проведения практических занятий (занятий семинарского типа)	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для самостоятельной работы	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для хранения и профилактического обслуживания оборудования	Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования

5.6. Лаборатории и лабораторное оборудование

6. Фонд оценочных средств по дисциплине Анализ финансовых рынков:

6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

Вид контроля	Форма контроля	Отметить нужное знаком «+»
Текущий контроль	Оценка докладов	+
	Устный/письменный опрос	+
	Тестирование	+
	Практические задачи	+
	Оценка контрольных работ (для заочной	+

	формы обучения)	
	Оценка курсовых проектов	+
Промежуточный контроль	Экзамен	+

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования; Положением о балльно-рейтинговой системе оценки успеваемости обучающихся по основным образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры в федеральном государственном автономном образовательном учреждении высшего образования «Самарский государственный экономический университет».

6.2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-3 - Способен обосновывать подходы в бизнес-анализе и руководить процессом реализации инвестиционного проекта

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
		ПК-4.1: Знать: методики обоснования подходов в бизнес анализе	ПК-4.2: Уметь: руководить процессом реализации инвестиционного проекта
Пороговый	понятие инвестиционного проекта	определить цели инвестиционного проекта исходя из потребностей хозяйствующего субъекта	навыком определения риск-профиля хозяйствующего субъекта в инвестиционном проекте
Стандартный (в дополнение к пороговому)	типы инвестиционных проектов в зависимости от целей хозяйствующих субъектов	отбирать финансовые параметры в рамках реализации инвестиционного проекта в соответствии с предпочтениями хозяйствующих субъектов	навыками мониторинга инвестиционного проекта исходя из смены предпочтений хозяйствующих субъектов и рыночной конъюнктуры
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	методы и подходы к управлению инвестиционным проектом в зависимости от целей хозяйствующих субъектов	управлять инвестиционным проектом исходя из параметров рыночной конъюнктуры	навыками расчета доходности и рискованности инвестиционного проекта и способами повышения его эффективности

6.3. Паспорт оценочных материалов

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контролируемые планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по программе	Вид контроля/используемые оценочные средства	
			Текущий	Промежуточный

1.	Аналитические подходы к прогнозированию динамики финансовых рынков	ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3	ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3	Доклад, аналитическое исследование, тестирование, оценка курсовых проектов
2.	Фундаментальный анализ финансового рынка	ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3	ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3	Доклад, аналитическое исследование, тестирование, оценка курсовых проектов

6.4.Оценочные материалы для текущего контроля

Задания и требования для подготовки доклада по дисциплине для оценки сформированности компетенций размещены в ЭИОС СГЭУ, <https://lms2.sseu.ru/course/index.php?categoryid=2032>

Задания и требования для подготовки аналитического исследования по дисциплине для оценки сформированности компетенций размещены в ЭИОС СГЭУ, <https://lms2.sseu.ru/course/index.php?categoryid=2032>

Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций (min 20, max 50 + ссылкой на ЭИОС с тестами)
<https://lms2.sseu.ru/course/index.php?categoryid=2032>

Примерная тематика курсовых проектов

1. Актуальные проблемы финансовых рынков
2. Анализ дивидендной политики, ее влияние на текущую цену и потенциал роста курсовой стоимости акций
3. Анализ доходности и риска финансовых активов в системе фундаментального анализа
4. Анализ российского рынка акций, проблемы и перспективы его развития
5. Анализ российского рынка облигаций частных эмитентов, проблемы и перспективы его развития
6. Аномальное рыночное поведение и способы его трактовки
7. Биржевой и внебиржевой рынок финансовых активов в России: сравнительная характеристика
8. Биржевой рынок срочных финансовых инструментов РФ и перспективы его развития
9. Взаимосвязь динамики биржевых индексов развитых и развивающихся рынков
10. Виды государственной политики по циклическому регулированию экономики и их влияние на финансовые рынки
11. Влияние рисков на финансовые операции
12. Глобализация финансового рынка
13. Зарубежная практика управления и снижения финансовых рисков
14. Клиринговые организации в России: количественная и качественная характеристика, сравнение с мировой практикой
15. Место института финансового посредничества в реализации механизма перераспределения финансового капитала российской экономики.
16. Место фундаментального анализа в системе методов анализа фондового рынка: общее и ключевые отличия.
17. Мировой финансовый кризис: влияние на финансовые рынки
18. Направления регулирования и саморегулирования финансовых рынков
19. Некоторые аспекты фундаментального и технического анализа на валютном и фондовом рынках
20. Оценка и анализ обобщающих показателей развития финансового рынка России (по сегментам)

21. Оценка и анализ обобщающих показателей состояния российского фондового рынка
22. Рыночные аномалии на фондовом рынке
23. Поведение рыночных агентов в кризисный период и особенности инвестирования
24. Проблемы функционирования денежного рынка
25. Роль финансового рынка в мобилизации и распределении финансовых ресурсов
26. Рынок капиталов: его роль в финансово-инвестиционном механизме территорий
27. Система индикаторов для прогнозирования кризисов на мировом финансовом рынке.
28. Становление современного рынка ценных бумаг в Российской Федерации
29. Тростовые операции банков: состояние и перспективы развития в России
30. Финансовый рынок: содержание, состав, структура, перспективы развития
31. Фундаментальный анализ на уровне эмитента финансового актива
32. Фундаментальный анализ ценных бумаг на отраслевом уровне
33. Фундаментальный и технический анализ инвестиционных качеств финансовых активов: недостатки и преимущества
34. Циклические колебания экономики как основной движущий фактор роста и падения рынков
35. Эффективность финансовых рынков и ее оценка

6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме экзамена

Раздел дисциплины	Вопросы
Аналитические подходы к прогнозированию динамики финансовых рынков	<ol style="list-style-type: none"> 1. Основные подходы к изучению динамики монетарных рынков: основные принципы, области применения. 2. Сравнительная характеристика технического и фундаментального анализа. 3. Теория эффективности рынка. Информационная и операционная эффективность рынка. Формы эффективности 4. Гипотеза "свободного блуждания", ее связь с теорией эффективности рынка, с техническим и фундаментальным анализом. 5. Теория рефлексивности Дж. Сороса. 6. Психологический анализ рынка. 7. Биржевые индексы. 8. Влияние информации на рыночную котировку акций. 9. Межрыночный анализ: понятие, практическое применение <p>Основные современные корреляционные взаимодействия сегментов финансовых и товарных рынков</p>
Фундаментальный анализ финансового рынка	<ol style="list-style-type: none"> 10. Понятие фундаментального анализа, методы, области применения. 11. Процесс фундаментального анализа: экономический, отраслевой анализ и анализ предприятия. 12. Рыночный анализ активов. Альфа- и бета-коэффициенты. 13. Показатели оценки инвестиционной привлекательности акций. 14. Показатели фундаментальной оценки стоимости компании. 15. Показатели темпов роста компании-эмитента. 16. Фундаментальный анализ облигаций. Факторы, влияющие на курсовую стоимость облигаций. 17. Определение курсовой стоимости и доходности облигаций. 18. Рейтинг облигаций. Рейтинговые агентства. <p>Этапы рейтинговых процедур.</p>

6.6. Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

Шкала и критерии оценивания

Оценка	Критерии оценивания для мероприятий контроля с применением
--------	--

	4-х балльной системы
«отлично»	Повышенный ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3
«хорошо»	Стандартный ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3
«удовлетворительно»	Пороговый ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3
«неудовлетворительно»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне