

Документ подписан простой электронной подписью.
Информация о владельце:

ФИО: Кандрашина Елена Александровна

Должность: Врио ректора ФГАОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 29.06.2023 11:43:53

Уникальный программный ключ:

b2fd765521f4c570b8c6e8e502a10b4f1de8ae0d

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 № 11 от 30 мая 2023 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Наименование дисциплины

Б1.В.11 Аналитические технологии на
финансовых рынках

**Основная профессиональная
образовательная программа**

38.04.01 Экономика программа Финансовые
аналитические и информационные технологии

Квалификация (степень) выпускника магистр

Самара 2023

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 Аналитические технологии на финансовых рынках входит в часть, формируемая участниками образовательных отношений блока Б1. Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Государственное регулирование финансовых рынков, Денежно-кредитная политика государства, Цифровые технологии на фондовых рынках, Эконометрическое моделирование финансовых рынков

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

Изучение дисциплины Аналитические технологии на финансовых рынках в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-6 - Способен применять аналитические и информационные технологии в процессе финансового консультирования и финансового планирования

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-6	ПК-6.1: Знать: ключевые положения и предпосылки использования фундаментального и технического анализа при принятии инвестиционных решений на фондовом рынке и на других классах инвестиционных активов	ПК-6.2: Уметь: работать с финансовой информацией по фондовым индексам и компаниям	ПК-6.3: Владеть (иметь навыки): навыками выявления инвестиционно-привлекательных акций публичных компаний на развивающихся рынках капитала с учетом их низкой ликвидности и сегментированности рынков, а также высоких политических рисков, навыками работы со специальными программными средствами технического анализа

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 4
Контактная работа, в том числе:	18.3/0.51
Занятия лекционного типа	8/0.22
Занятия семинарского типа	8/0.22
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.3/0.01
Групповая контактная работа (ГКР)	2/0.06
Самостоятельная работа:	127.7/3.55
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 Аналитические технологии на финансовых рынках 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	
		Лекции	Занятия семинарского типа		ИКР			ГКР
			Практич. занятия					
1.	Аналитические подходы к прогнозированию динамики финансовых рынков	4	4			60,7	ПК-6.1, ПК-6.2, ПК -6.3	
2.	Фундаментальный анализ финансового рынка	4	4			67	ПК-6.1, ПК-6.2, ПК -6.3	
	Контроль	34						
	Итого	8	8	0.3	2	127.7		

4.2 Содержание разделов и тем

4.2.1 Контактная работа

Тематика занятий лекционного типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия лекционного типа*	Тематика занятия лекционного типа
1.	Аналитические подходы к прогнозированию динамики финансовых рынков	лекция	Основные подходы к изучению динамики финансовых рынков
		лекция	Межрыночный анализ: понятие, тенденции, практическое использование
2.	Фундаментальный анализ финансового рынка	лекция	Методика проведения фундаментального анализа финансовых рынков
		лекция	Методика определение справедливой стоимости финансовых активов

*лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся

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	Динамика финансовых рынков: тенденции, особенности, подходы к изучению
		практическое занятие	Практика применения межрыночного анализа
2.	Фундаментальный анализ финансового рынка	практическое занятие	Практика проведения фундаментального анализа финансовых активов
		практическое занятие	Методика определение справедливой стоимости финансовых активов

** 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 динамики финансовых рынков	- подготовка доклада - 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. Михайленко, М. Н. Финансовые рынки и институты : учебник для вузов / М. Н. Михайленко. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 336 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-01273-6. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/510907>

Финансы : учебник и практикум для вузов / Н. И. Берзон [и др.] ; под общей редакцией Н. И. Берзона. — 4-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 541 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-15996-7. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/523606>

Дополнительная литература

1. 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. Microsoft Windows 10 Education / Microsoft Windows 7 / Windows Vista Business
2. Microsoft Office 2016 Professional Plus (Word, Excel, Access, PowerPoint, Outlook, OneNote, Publisher) / Microsoft Office 2007 (Word, Excel, Access, PowerPoint)

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

3. Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики - <http://www.gks.ru/>)

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

6. Фонд оценочных средств по дисциплине Аналитические технологии на финансовых рынках:

6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

Вид контроля	Форма контроля	Отметить нужное знаком « + »
Текущий контроль	Оценка докладов	+
	Аналитическое исследование	+
	Тестирование	+
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-6 - Способен применять аналитические и информационные технологии в процессе финансового консультирования и финансового планирования

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	<p>ПК-6.1: Знать:</p> <p>ключевые положения и предпосылки использования фундаментального и технического анализа при принятии инвестиционных решений на фондовом рынке и на других классах инвестиционных активов</p>	<p>ПК-6.2: Уметь:</p> <p>работать с финансовой информацией по фондовым индексам и компаниям</p>	<p>ПК-6.3: Владеть (иметь навыки):</p> <p>навыками выявления инвестиционно-привлекательных акций публичных компаний на развивающихся рынках капитала с учетом их низкой ликвидности и сегментированности рынков, а также высоких политических рисков, навыками работы со специальными программными средствами технического анализа</p>
Пороговый	<p>методики работы и применения аналитических и информационных технологий на финансовых рынках; категориальный аппарат, характеризующий функционирование финансовых институтов и рынков</p>	<p>применять аналитические и информационные приемы определения целесообразности принятия решений в области деятельности функционирования финансовых процессов и институтов</p>	<p>специфическими методами технического и фундаментального анализа и специальными программными средствами анализа</p>
Стандартный (в дополнение к пороговому)	<p>методики проведения анализа и составления на его основе выводов посредством аналитических и информационных технологий на финансовых рынках</p>	<p>анализировать статистическую информацию, характеризующую деятельность финансовых институтов, функционирование финансового рынка и его сегментов как в РФ, так и за рубежом, делать на этой основе самостоятельные выводы о проблемах и перспективах</p>	<p>навыками выявления наиболее перспективных направлений деятельности на финансовых рынках, оценивая возможные преимущества и риски при взаимодействии с отдельными финансовыми институтами и использовании финансовых инструментов</p>
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	<p>методики интерпретации выводов, полученных в ходе анализа и применения их в рамках финансового консультирования и планирования</p>	<p>выбирать подходящий аналитический инструментарий для решения задач анализа и оценки инвестиционных рисков; оказывать услуги по финансовому</p>	<p>навыками оценки влияния фундаментальных факторов на функционирование финансовых институтов и рынков; выявления инвестиционно-привлекательных публичных компаний на развивающихся рынках капитала</p>

		консультированию физических и юридических лиц в части операций на финансовых рынках	с учетом низкой ликвидности и сегментированности рынков, а также высоких политических рисков
--	--	---	--

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.	Фундаментальный анализ финансового рынка	ПК-6.1, ПК-6.2, ПК-6.3	Доклад, аналитическое исследование, тестирование	Экзамен
2.	Технический анализ финансового рынка	ПК-6.1, ПК-6.2, ПК-6.3	Доклад, аналитическое исследование, тестирование	Экзамен

6.4. Оценочные материалы для текущего контроля

Задания и требования для подготовки реферата по дисциплине для оценки сформированности компетенций размещены в ЭИОС СГЭУ,

<https://lms2.sseu.ru/enrol/index.php?id=26966>

Задания и требования для подготовки реферата по дисциплине для оценки сформированности компетенций размещены в ЭИОС СГЭУ,

<https://lms2.sseu.ru/enrol/index.php?id=26966>

Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций (min 20, max 50 + ссылку на ЭИОС с тестами)

<https://lms2.sseu.ru/enrol/index.php?id=26966>

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 10. Основные современные корреляционные взаимодействия сегментов

	финансовых и товарных рынков
Фундаментальный анализ финансового рынка	11. Понятие фундаментального анализа, методы, области применения. 12. Процесс фундаментального анализа: экономический, отраслевой анализ и анализ предприятия. 13. Рыночный анализ активов. Альфа- и бета-коэффициенты. 14. Показатели оценки инвестиционной привлекательности акций. 15. Показатели фундаментальной оценки стоимости компании. 16. Показатели темпов роста компании-эмитента. 17. Фундаментальный анализ облигаций. Факторы, влияющие на курсовую стоимость облигаций. Определение курсовой стоимости и доходности облигаций. 18. Рейтинг облигаций. Рейтинговые агентства. Этапы рейтинговых процедур.

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-6.1, ПК-6.2, ПК-6.3
«хорошо»	Стандартный ПК-6.1, ПК-6.2, ПК-6.3
«удовлетворительно»	Пороговый ПК-6.1, ПК-6.2, ПК-6.3
«неудовлетворительно»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне