

Компонент ОПОП

38.04.01 Экономика, направленность (профиль) «Финансовый
аналитик»

наименование ОПОП

Б1.В.06

шифр дисциплины

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Дисциплины (модуля)

Анализ финансовых рынков

Разработчик:

Царева С.В.

ФИО

Декан ФПКВК

должность

к.э.н., доцент

ученая степень, звание

Утверждено на заседании кафедры

цифровых технологий, математики и экономики

наименование кафедры

протокол №

8

от

21.04.2022

И.о. заведующего кафедрой

ЦТМиЭ



подпись

Мотина Т. Н.

ФИО

Мурманск
2022

Пояснительная записка

Объем дисциплины 4 з.е.

1. Результаты обучения по дисциплине (модулю), соотнесенные с индикаторами достижения компетенций, установленными образовательной программой

Компетенции	Индикаторы достижения компетенций	Результаты обучения по дисциплине (модулю)
<p>ПК-2. Способен анализировать и использовать различные источники информации для проведения финансовых расчетов</p>	<p>ИД-1_{ПК-2}: - понимает принципы формирования стоимости денег во времени; принципы дисконтирования денежного потока; принципы начисления сложных процентов; принципы расчетов приведенной и будущей стоимости; методики финансового анализа; понятие безрискового актива</p> <p>ИД-2_{ПК-2}: - получает, интерпретирует результаты исследований; использует расчетные таблицы и калькуляторы</p> <p>ИД-3_{ПК-2}: - применяет инструменты финансового анализа; анализа использования заемных средств</p>	<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> - понятие и типы финансовых рынков; - основные фундаментальные факторы, влияющие на финансовые рынки; - основные предпосылки применения методов технического анализа финансовых рынков; - основные подходы и методы технического и фундаментального анализа финансовых рынков; - методы анализа ценных бумаг, включающие поэтапный анализ экономики, отраслей и предприятий.
<p>ПК-4. Способен составлять инвестиционный портфель и управлять инвестиционным риском</p>	<p>ИД-1_{ПК-4}: - понимает методы дисконтирования денежных потоков, методы многовариантности расчетов, методы математического моделирования и количественной оптимизации; принципы расчета доходности активов; принципы портфельного управления инвестированием; принципы соотношения риска и доходности; способы управления финансовыми рисками</p>	<p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> - определять фундаментальные индикаторы и оценивать их влияние на финансовый рынок; - уметь проводить анализ ценных бумаг, основываясь на финансовых документах предприятий, статистических данных отраслей и макроэкономических показателях; - самостоятельно выбирать определенный метод технического анализа, с его помощью проводить конкретные расчеты, анализировать их и делать выводы из них; <p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> - навыками самостоятельной работы с литературой и накопления необходимой базовой информации, которая может быть использована в ходе последующей исследовательской работы; - навыками составления аналитического отчета по деятельности предприятия.

2. Содержание дисциплины (модуля)

Тема 1. Финансовые рынки: понятия, виды.

Понятие и виды финансовых рынков. Валютный рынок. Рынок ценных бумаг. История развития мировых финансовых рынков. Классификация методов исследования финансовых рынков. Понятие, особенности, инструменты и задачи фундаментального и технического анализа финансовых рынков.

Тема 2. Влияние фундаментальных факторов на финансовые рынки.

Понятие и виды фундаментальных факторов. Макроэкономические и микроэкономические индикаторы. Экономическая и финансовая политика. Экономические циклы. Циклические экономические индикаторы. Инструменты прогнозирования.

Тема 3. Фундаментальный анализ на финансовых рынках.

Факторы, влияющие на динамику валютного курса. История международного валютного рынка. Политика, кризисные и природные явления. Финансовые институты. Процентные ставки. Валютные интервенции. Индикаторы денежной статистики. Фондовый рынок. Международная торговля. Процесс фундаментального анализа. Отраслевой анализ. Анализ предприятия. Финансовый анализ деятельности предприятия. Рыночные характеристики акций. Анализ облигаций.

Тема 4. Технический анализ на финансовых рынках.

Определения технического анализа. Основные положения, понятия и допущения технического анализа. Классификация методов технического анализа. Область применения методов технического анализа. Основные положения теории Доу. Графическое отображение параметров рынка. Графики и гистограммы. Понятие тенденции. Виды тенденций. Графическое отображение тенденций. Линии тенденции и методы их построения. Понятие графической фигуры. Основные предпосылки построения фигур и их применение. Основные правила построения фигур. Фигуры продолжения тенденции. Фигуры разворота тенденции. Понятие и виды индикаторов и осцилляторов. Скользящие средние как основной вид индикаторов. Вспомогательные индикаторы. Предпосылки построения индикаторов и осцилляторов. Основные правила разработки индикаторов и осцилляторов. Интерпретация индикаторов и осцилляторов. Основные положения Волновой Теории Эллиота: основные понятия, принципы выявления, численные соотношения. «Крестики-нолики» и «Японские свечи» как альтернатива графическому анализу ценных бумаг.

3. Перечень учебно-методического обеспечения дисциплины (модуля)

- мультимедийные презентационные материалы по дисциплине (модулю) представлены в электронном курсе в ЭИОС МГТУ;
- методические указания к выполнению практических работ представлены в электронном курсе в ЭИОС МГТУ;
- методические материалы для обучающихся по освоению дисциплины (модуля) представлены на официальном сайте МГТУ в разделе «Информация по образовательным программам, в том числе адаптированным».

4. Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю)

Является отдельным компонентом образовательной программы, разработан в форме отдельного документа, включает в себя:

- перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения дисциплины (модуля);
- задания текущего контроля;
- задания промежуточной аттестации;
- задания внутренней оценки качества образования.

5. Перечень основной и дополнительной учебной литературы (печатные издания, электронные учебные издания и (или) ресурсы электронно-библиотечных систем)

Основная литература:

1. Анализ финансовых рынков и торговля финансовыми активами: тезисы, примеры, задания : пособие по курсу / под ред. А. В. Федорова ; Акад. биржевой торговли "Форекс Клуб". - 3-е изд. - Москва [и др.] : Питер, 2006. - 233 с. (5 экз.)

2. Рынок ценных бумаг : учебник для вузов / [Е. Ф. Жуков и др.] ; под ред. Е. Ф. Жукова. - 3-е изд., перераб. и доп. - Москва : Юнити-Дана, 2009. - 567 с. - Авт. указаны на с. 4. - Библиогр.: с. 562-563. (49 экз.)

Дополнительная литература:

1. Батяева, Т. А. Рынок ценных бумаг : учеб. пособие для вузов / Т. А. Батяева, И. И. Столяров; Моск. гос. ун-т им. М. В. Ломоносова, Фак. гос. упр. - Москва : Инфра-М, 2010, 2008. - 302, [1] с. - (Учебники экономического факультета МГУ им. М. В. Ломоносова). - Библиогр.: с. 294-297. (5 экз.)

2. Килячков, А. А. Рынок ценных бумаг и биржевое дело : учеб. пособие / А. А. Килячков, Л. А. Чалдаева. - 2-е изд., с изм. - Москва : Экономистъ, 2004. - 687 с. (5 экз.)

3. Миркин, Я. М. Ценные бумаги и фондовый рынок : Проф. курс в финансовой Академии при правительстве РФ / Я. М. Миркин. - Москва : Перспектива, 1995. - 532 с. (5 экз.)

6. Профессиональные базы данных и информационные справочные системы

1. Электронный каталог библиотеки МГТУ с возможностью ознакомиться с печатным вариантом издания в читальных залах библиотеки – <http://lib.mstu.edu.ru/MegaPro/Web>.

2. Государственная система правовой информации – официальный интернет-портал правовой информации – URL: <http://pravo.gov.ru>

3. Справочно-правовая система. Консультант Плюс – URL: <http://www.consultant.ru/>

7. Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства

1. Операционная система Microsoft Windows 7 Professional

2. Офисный пакет Microsoft Office 2010

3. Операционная система Microsoft Windows XP Professional

4. Офисный пакет Microsoft Office 2007

8. Обеспечение освоения дисциплины лиц с инвалидностью и ОВЗ

Обучающиеся из числа инвалидов и лиц с ОВЗ обеспечиваются печатными и (или) электронными образовательными ресурсами в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья.

9. Материально-техническое обеспечение дисциплины (модуля) представлено в приложении к ОПОП «Материально-технические условия реализации образовательной программы» и включает:

– учебные аудитории для проведения учебных занятий, предусмотренных программой магистратуры, оснащенные оборудованием и техническими средствами обучения;

– помещения для самостоятельной работы обучающихся, оснащенные компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде МГТУ.

Допускается замена оборудования его виртуальными аналогами.

10. Распределение трудоемкости по видам учебной деятельности

Таблица 1 – Распределение трудоемкости

Вид учебной деятельности	Распределение трудоемкости дисциплины (модуля) по формам обучения											
	Очная			Всего часов	Очно-заочная			Всего часов	Заочная			Всего часов
	Семестр		3		Семестр		3		Семестр/Курс		3	
	3				3							
Лекции	8			8	8			8				
Практические занятия	26			26	26			26				
Лабораторные работы	–			–	–			–				
Самостоятельная работа	110			110	110			110				
Подготовка к промежуточной аттестации	–			–	–			–				
Всего часов по дисциплине	144			144	144			144				
/ из них в форме практической подготовки												

Формы промежуточной аттестации и текущего контроля

Экзамен	–			–	–			–				
Зачет	+			+	+			+				
Курсовая работа	–			–	–			–				
Количество расчетно-графических работ	–			–	–			–				
Количество контрольных работ	–			–	–			–				
Количество рефератов	–			–	–			–				
Количество эссе	–			–	–			–				

Перечень практических занятий по формам обучения

№ п/п	Темы практических занятий
1	2
Очная форма	
1	История развития мировых финансовых рынков. <i>Практическая работа.</i>
2	Понятие и виды фундаментальных факторов. <i>Практическая работа.</i>
3	Фундаментальный анализ валютных рынков. <i>Практическая работа.</i>
4	Фундаментальный анализ рынков ценных бумаг.

	<i>Практическая работа.</i>
5	Понятие технического анализа. <i>Практическая работа.</i>
6	Основные понятия графического анализа. <i>Практическая работа.</i>
7	Индикаторы и осцилляторы как методы технического анализа. <i>Практическая работа.</i>
8	Специальные методы технического анализа финансовых рынков. <i>Практическая работа.</i>
Очно-заочная форма	
1	История развития мировых финансовых рынков. <i>Практическая работа.</i>
2	Понятие и виды фундаментальных факторов. <i>Практическая работа.</i>
3	Фундаментальный анализ валютных рынков. <i>Практическая работа.</i>
4	Фундаментальный анализ рынков ценных бумаг. <i>Практическая работа.</i>
5	Понятие технического анализа. <i>Практическая работа.</i>
6	Основные понятия графического анализа. <i>Практическая работа.</i>
7	Индикаторы и осцилляторы как методы технического анализа. <i>Практическая работа.</i>
8	Специальные методы технического анализа финансовых рынков. <i>Практическая работа.</i>