

Министерство образования и науки Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Кубанский государственный университет»
Факультет компьютерных технологий и прикладной математики



РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.ДВ.02.01 «МАТЕМАТИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ИНВЕСТИЦИОННОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ»

Направление подготовки 01.04.02 Прикладная математика и информатика
Направленность (профиль) Математическое и информационное обеспечение экономической деятельности

Программа подготовки Академическая

Форма обучения Очная

Квалификация выпускника Магистр

Краснодар 2017

Рабочая программа дисциплины «Математическое и информационное обеспечение инвестиционной деятельности» составлена в соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования (ФГОС ВО) по направлению подготовки 01.04.02 Прикладная математика и информатика, направленность (профиль): Математическое и информационное обеспечение экономической деятельности.

Программу составила:

Н.М. Сеидова, канд. физ.-мат. наук, доц. КПИМ



ПОДПИСЬ

Рабочая программа дисциплины рассмотрена и утверждена на заседании кафедры прикладной математики (выпускающей и кафедр разработчика) от 29.06.2017, протокол № 22.

Заведующий кафедрой
прикладной математики
д.ф.-м.н., профессор



М.Х. Ургенов

Рабочая программа утверждена на заседании учебно-методической комиссии факультета компьютерных технологий и прикладной математики от 29.06.2017 г., протокол № 4.

Председатель УМК факультета
компьютерных технологий
и прикладной математики
к.ф.-м.н., доцент



К.В. Малыхин,

Рецензенты:

Шапошникова Татьяна Леонидовна.

Доктор педагогических наук, кандидат физико-математических наук, профессор. Почетный работник высшего профессионального образования РФ. Директор института фундаментальных наук (ИФН) ФГБОУ ВО «КубГТУ».

Марков Виталий Николаевич.

Доктор технических наук. Профессор кафедры информационных систем и программирования института компьютерных систем и информационной безопасности (ИКСиИБ) ФГБОУ ВО «КубГТУ».

Цели и задачи учебной дисциплины

1.1 Цели изучения дисциплины определены государственным образовательным стандартом высшего образования и соотнесены с общими целями ООП ВО по направлению подготовки «Прикладная математика и информатика», в рамках которой преподается дисциплина.

Целью освоения учебной дисциплины «Математическое и информационное обеспечение инвестиционной деятельности» является формирование у будущих специалистов твердых теоретических знаний и практических навыков работы на рынке ценных бумаг, основных фондовых биржах и прогнозирования необходимых финансово-экономических показателей.

1.2 Задачи дисциплины:

1. актуализация и развитие знаний в области современных экономико-математических методов и моделей рынка ценных бумаг;
2. знакомство с различными приложениями этих методов при работе на основных фондовых биржах;
3. применение научных знаний о современных экономико-математических методах и моделях рынка ценных бумаг для работы на рынке ценных бумаг, основных фондовых биржах и прогнозирования необходимых финансово-экономических показателей.
4. развитие навыков работы на рынке ценных бумаг, основных фондовых биржах и прогнозирования необходимых финансово-экономических показателей;
5. овладение инновационными технологиями, инновационными навыками работы на рынке ценных бумаг, основных фондовых биржах и прогнозирования необходимых финансово-экономических показателей.

1.3 Место учебной дисциплины в структуре ООП ВО

Дисциплина «Математическое и информационное обеспечение инвестиционной деятельности» относится к дисциплинам по выбору вариативной части (Б1.В.ДВ.2).

Данная дисциплина (Математическое и информационное обеспечение инвестиционной деятельности) тесно связана с дисциплинами «Математические модели рынка ценных бумаг», «Теория оптимального портфеля ценных бумаг» и «Дополнительные главы актуарных расчетов».

1.4 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения курса «Математическое и информационное обеспечение инвестиционной деятельности»:

Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
		Знать	уметь	владеть
ПК-5	способностью управлять проектами, планировать научно-исследовательскую	основы управления инвестиционными проектами, планирования научно-исследовательской	способностью управлять проектами, планировать научно-исследователь-	способностью управлять проектами, планировать научно-исследователь-

Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
		Знать	уметь	владеть
	деятельность, анализировать риски, управлять командой проекта	деятельность, анализа инвестиционных рисков, управления командой инвестиционного проекта	скую деятельность, анализировать риски, управлять командой проекта	скую деятельность, анализировать риски, управлять командой проекта
ОПК-5	способностью использовать углубленные знания правовых и этических норм при оценке последствий своей профессиональной деятельности, при разработке и осуществлении социально значимых проектов	основы правовых и этических норм при оценке последствий своей профессиональной деятельности, при разработке и осуществлении социально значимых инвестиционных проектов	использовать углубленные знания правовых и этических норм при оценке последствий своей профессиональной деятельности, при разработке и осуществлении социально значимых инвестиционных проектов	способностью использовать углубленные знания правовых и этических норм при оценке последствий своей профессиональной деятельности, при разработке и осуществлении социально значимых инвестиционных проектов

1. Структура и содержание дисциплины

2.1 Распределение трудоемкости дисциплины по видам работ

Общая трудоёмкость дисциплины составляет 2 зач.ед. (72 часа), их распределение по видам работ представлено в таблице

Вид работы	Трудоемкость, часов
	В семестр
Контактная работа, в том числе:	14,2
Аудиторная работа:	14
<i>Лекции (Л)</i>	0
<i>Практические занятия (ПЗ)</i>	0
<i>Лабораторные работы (ЛР)</i>	14
Иная контактная работа:	
Контроль самостоятельной работы (КСР)	0
Промежуточная аттестация (ИКР)	0,2
Самостоятельная работа (СР):	57,8
Курсовой проект (КП), курсовая работа (КР)	-

Самоподготовка (проработка и повторение лекционного материала и материала учебников и учебных пособий, подготовка к лабораторным и практическим занятиям, коллоквиумам и т.д.)		20
Выполнение индивидуальных заданий (подготовка сообщений, презентаций)		20
Реферат		7,8
Подготовка к текущему контролю		10
Контроль:		
Подготовка и сдача экзамена ¹		0
Общая трудоемкость	час.	72
	в том числе контактная	14,2
	зач. ед	2
Вид итогового контроля		Зачет

2.2 Структура учебной дисциплины

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины.

Разделы дисциплины, изучаемые в 11 семестре

№ п/п	Наименование раздела, темы	Всего трудо- ем- кость	Аудиторные за- нятия			Самос- тоя- тель- ная работа
			Все- го	Лек- ции	Ла- бо- ра- тор- ные	
1.	Ценные бумаги. Методы оценки эффективности и риска.	10	2		2	8
2.	Портфели ценных бумаг и их характеристики.	10	2		2	8
3.	Графические методы анализа и прогноза изменения тенденций. Индикаторы разворота. Частотные характеристики этих индикаторов.	10	2		2	8
4.	Использование осцилляторов для анализа и прогноза изменения тенденций	10	2		2	8
5.	Программное обеспечение работы на рынке ценных бумаг	10	2		2	8
6.	Технология работы на ведущих фондовых биржах.	10	2		2	8
7.	Самостоятельная работа на одной из виртуальных биржи. Принятие зачета	11,8	2		2	9,8
8.	Промежуточная аттестация (ИКР)	0,2	0,2			
	Итого:	72	14,2	0	14	57,8

2.3 Содержание разделов дисциплины:

№	Наименование	Форма текущего
---	--------------	----------------

¹ При наличии экзамена по дисциплине

раздела	раздела/модуля	контроля
1	2	4
1	Ценные бумаги. Методы оценки эффективности и риска.	Подготовка рефератов, презентаций, выступлений. Проверка лабораторной работы
2	Портфели ценных бумаг и их характеристики.	Опрос по результатам индивидуального задания Проверка лабораторной работы
1	2	4
3	Графические методы анализа и прогноза изменения тенденций. Индикаторы разворота. Частотные характеристики этих индикаторов.	Подготовка рефератов, презентаций, выступлений. Проверка лабораторной работы Опрос по результатам индивидуального задания
4	Использование осцилляторов для анализа и прогноза изменения тенденций	Опрос по результатам индивидуального задания
5	Программное обеспечение работы на рынке ценных бумаг	Подготовка рефератов, презентаций, выступлений.
6	Технология работы на ведущих фондовых биржах.	Подготовка рефератов, презентаций, выступлений. Защита проектного задания.
7	Самостоятельная работа на одной из виртуальных бирж	Проверка лабораторной работы

2.3.1 Занятия лекционного типа – не предусмотрены

2.3.2 Семинарские занятия – не предусмотрены

2.3.3 Лабораторные занятия

№ п/п	Наименование раздела	Наименование лабораторных работ	Форма текущего контроля
1.	Ценные бумаги. Методы оценки эффективности и риска.	Ценные бумаги. Методы оценки эффективности и риска.	Проверка выполнения лабораторной работы
2.	Портфели ценных бумаг и их характеристики.	Портфели ценных бумаг и их характеристики.	Проверка выполнения лабораторной работы
3.	Графические методы анализа и прогноза изменения тенденций. Индикаторы разворота. Частотные характеристики этих индикаторов.	Графические методы анализа и прогноза изменения тенденций. Индикаторы разворота. Частотные характеристики этих индикаторов.	Проверка выполнения лабораторной работы

4.	Самостоятельна работа на одной из виртуальных бирж	Самостоятельна работа на одной из виртуальных бирж	Проверка выполнения лабораторной работы
----	--	--	---

2.3.4 Курсовые работы – не предусмотрены

2.4 Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающегося по дисциплине

Целью самостоятельной работы студента является углубление знаний, полученных в результате аудиторных занятий. Вырабатываются навыки самостоятельной работы. Закрепляются опыт и знания, полученные во время лабораторных занятий.

№	Наименование раздела	Перечень учебно-методического обеспечения дисциплины по выполнению самостоятельной работы
1	2	3
1.	Ценные бумаги. Методы оценки эффективности и риска.	1. Инвестиции и инновации : учебное пособие / В.Н. Щербаков, К.В. Балдин, А.В. Дубровский и др. ; под ред. В.Н. Щербакова. - М. : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2016. - 658 с. : табл., схем. - Библиогр. в кн. - ISBN 978-5-394-02730-7 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: //biblioclub.ru/index.php?page=book&id=452565 . 2. Балакина, А.П. Финансы. [Электронный ресурс] / А.П. Балакина, И.И. Бабленкова. — Электрон. дан. — М. : Дашков и К, 2013. — 384 с. — Режим доступа: http://e.lanbook.com/book/4217 — Загл. с экрана
2.	Портфели ценных бумаг и их характеристики.	1. Аскинадзи В. М. Инвестиционное дело : [учебное пособие] / В. М. Аскинадзи, В. Ф. Максимова ; В. М. Аскинадзи, В. Ф. Максимова. - М. : Университетская книга : IDO PRESS, 2012. - 763 с. - ISBN 978542430028. - ISBN 9785913042453. 2. Узденов У.А. Математические методы и модели оптимального портфеля ценных бумаг / Узденов, Умар Ахматович, Коваленко, Анна Владимировна, Уртенев, Махамет Али Хусеевич ; У. А. Узденов, А. В. Коваленко, М. Х. Уртенев ; М-во образования и науки Рос. Федерации, Карачаево-Черкесский гос. ун-т им. У. Д. Алиева. - Карачаевск : [Карачаево-Черкесский государственный университет им. У. Д. Алиева], 2012. - 145 с. : ил. - Библиогр.: с. 138-143. - ISBN 5820900723.
3.	Графические методы анализа и прогноза изменения тенденций. Индикаторы разворота. Частотные характеристики этих индикаторов.	Узденов У.А. Математические методы и модели оптимального портфеля ценных бумаг / Узденов, Умар Ахматович, Коваленко, Анна Владимировна, Уртенев, Махамет Али Хусеевич ; У. А. Узденов, А. В. Коваленко, М. Х. Уртенев ; М-во образования и науки Рос. Федерации, Карачаево-Черкесский гос. ун-т им. У. Д. Алиева. - Карачаевск : [Карачаево-Черкесский государственный университет им. У. Д. Алиева], 2012. - 145 с. : ил. - Библиогр.: с. 138-143. - ISBN 5820900723.

1	2	3
4.	Использование осцилляторов для анализа и прогноза изменения тенденций	<p>1. Узденов У.А. Математические методы и модели оптимального портфеля ценных бумаг / Узденов, Умар Ахматович, Коваленко, Анна Владимировна, Уртенев, Махамет Али Хусеевич ; У. А. Узденов, А. В. Коваленко, М. Х. Уртенев ; М-во образования и науки Рос. Федерации, Карачаево-Черкесский гос. ун-т им. У. Д. Алиева. - Карачаевск : [Карачаево-Черкесский государственный университет им. У. Д. Алиева], 2012. - 145 с. : ил. - Библиогр.: с. 138-143. - ISBN 5820900723. 6 шт</p> <p>2. Лахметкина, Наталия Ивановна. Инвестиционная стратегия предприятия [Текст] : учебное пособие для студентов / Н. И. Лахметкина ; [Финансовый ун-т при Правительстве Рос. Федерации]. - 6-е изд., стер. - М. : КНОРУС, 2012. - 230 с. - Библиогр.: с. 228-230. - ISBN 9785406015209 : 150.10. 17 шт</p> <p>3. Касимов, Ю. Ф. Финансовая математика [Электронный ресурс] : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / Ю. Ф. Касимов. - 5-е изд., перераб. и доп. - М. : Юрайт, 2017. - 459 с. - https://biblio-online.ru/book/D3891CE0-3C37-445C-A6AE-3E9A70177AE7.</p>
5.	Программное обеспечение работы на рынке ценных бумаг	<p>1. Узденов У.А. Математические методы и модели оптимального портфеля ценных бумаг / Узденов, Умар Ахматович, Коваленко, Анна Владимировна, Уртенев, Махамет Али Хусеевич ; У. А. Узденов, А. В. Коваленко, М. Х. Уртенев ; М-во образования и науки Рос. Федерации, Карачаево-Черкесский гос. ун-т им. У. Д. Алиева. - Карачаевск : [Карачаево-Черкесский государственный университет им. У. Д. Алиева], 2012. - 145 с. : ил. - Библиогр.: с. 138-143. - ISBN 5820900723. 6 шт</p> <p>2. Лахметкина, Наталия Ивановна. Инвестиционная стратегия предприятия [Текст] : учебное пособие для студентов / Н. И. Лахметкина ; [Финансовый ун-т при Правительстве Рос. Федерации]. - 6-е изд., стер. - М. : КНОРУС, 2012. - 230 с. - Библиогр.: с. 228-230. - ISBN 9785406015209 : 150.10. 17 шт</p>
6.	Технология работы на ведущих фондовых биржах.	<p>1. Лахметкина, Наталия Ивановна. Инвестиционная стратегия предприятия [Текст] : учебное пособие для студентов / Н. И. Лахметкина ; [Финансовый ун-т при Правительстве Рос. Федерации]. - 6-е изд., стер. - М. : КНОРУС, 2012. - 230 с. - Библиогр.: с. 228-230. - ISBN 9785406015209 : 150.10. 17 шт</p> <p>2. Игонина, Людмила Лазаревна. Инвестиции: учебник / Игонина, Людмила Лазаревна ; Л. Л. Игонина. - 2-е изд., перераб. и доп. - М. : Магистр : ИНФРА-М, 2013. - 749 с. - Библиогр.: с. 735-739. - ISBN 9785977600712. - ISBN 9785160063232. 50 шт</p>
7.	Самостоятельная работа на одной из виртуальных бирж	<p>3. Лахметкина, Наталия Ивановна. Инвестиционная стратегия предприятия [Текст] : учебное пособие для студентов / Н. И. Лахметкина ; [Финансовый ун-т при Правительстве Рос. Федерации]. - 6-е изд., стер. - М. : КНОРУС, 2012. - 230 с. - Библиогр.: с. 228-230. - ISBN 9785406015209 : 150.10. 17 шт</p> <p>4. Игонина, Людмила Лазаревна. Инвестиции: учебник / Игонина, Людмила Лазаревна ; Л. Л. Игонина. - 2-е изд., перераб. и доп. - М. : Магистр : ИНФРА-М, 2013. - 749 с. - Библиогр.: с. 735-739. - ISBN 9785977600712. - ISBN 9785160063232. 50 шт</p>

Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся из числа инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья (ОВЗ) предоставляются в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

Для лиц с нарушениями зрения:

- в печатной форме увеличенным шрифтом,
- в форме электронного документа.

Для лиц с нарушениями слуха:

- в печатной форме,
- в форме электронного документа.

Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

- в печатной форме,
- в форме электронного документа.

3. Образовательные технологии

Лабораторное занятие позволяет научить студента применять теоретические знания при решении и исследовании конкретных задач. Лабораторные занятия проводятся в компьютерных классах, при этом практикуется работа в группах. Подход разбора конкретных ситуаций широко используется как преподавателем, так и студентами при проведении анализа результатов самостоятельной работы. Это обусловлено тем, что в процессе исследования часто встречаются задачи, для которых единых подходов не существует. Каждая конкретная задача при своем исследовании имеет множество подходов, а это требует разбора и оценки целой совокупности конкретных ситуаций. Этот подход особенно широко используется при определении адекватности математической модели финансовой операции.

Для лиц с нарушениями зрения:

- в печатной форме увеличенным шрифтом,
- в форме электронного документа.

Для лиц с нарушениями слуха:

- в печатной форме,
- в форме электронного документа.

Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

- в печатной форме,
- в форме электронного документа.

Для лиц с ограниченными возможностями здоровья предусмотрена организация консультаций с использованием электронной почты.

Данный перечень может быть конкретизирован в зависимости от контингента обучающихся.

4. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины

4.1 Фонд оценочных средств для проведения текущей аттестации

Учебная деятельность проходит в соответствии с графиком учебного процесса. Процесс самостоятельной работы контролируется во время аудиторных занятий и инди-

видуальных консультаций. Самостоятельная работа студентов проводится в форме изучения отдельных теоретических вопросов по предлагаемой литературе.

Фонд оценочных средств дисциплины состоит из средств текущего контроля (см. список лабораторных работ, задач и вопросов) и итоговой аттестации (зачета).

В качестве оценочных средств, используемых для текущего контроля успеваемости, предлагается перечень вопросов, которые прорабатываются в процессе освоения курса. Данный перечень охватывает все основные разделы курса, включая знания, получаемые во время самостоятельной работы. Кроме того, важным элементом технологии является самостоятельное решение студентами и сдача заданий. Это полностью индивидуальная форма обучения. Студент рассказывает свое решение преподавателю, отвечает на дополнительные вопросы.

Примерные задания на лабораторные работы

1 Ценные бумаги. Методы оценки эффективности и риска.

Задание 1. Исследуйте основные понятия рынка ценных бумаг. Получите информацию с использованием финансовой сети CNNfn.

Задание 2. Используйте методы расчета оценки эффективности и риска ценных бумаг в одной транзакции.

Задание 3. Рассчитайте основные характеристики портфеля ценных бумаг ОПЦБ.

Задание 4. Рассчитайте основные характеристики оптимального портфеля Марковица при разрешении операции Short Sale.

Задание 5. Рассчитайте основные характеристики оптимального согласованного портфеля Рубинштейна при разрешении операции Short Sale.

Задание 6. Рассчитайте основные характеристики оптимального комбинированного портфеля Тобина с безрисковой компонентой при разрешении операции Short Sale.

Задание 7. Проанализируйте исключительный случай составления оптимального портфеля Марковица.

2 Портфели ценных бумаг и их характеристики.

Задание 1. Проведите численное исследование оптимального портфеля Марковица при запрещении операции Short Sale.

Задание 2. Проведите численное исследование оптимального портфеля Рубинштейна при запрещении операции Short Sale.

Задание 3. Проведите численное исследование оптимального портфеля Тобина при запрещении операции Short Sale.

Задание 4. Проведите расчет бета любой ценной бумаги по выбору.

Задание 5. Проведите расчет бета любой ценной бумаги для портфеля Тобина по выбору.

Задание 6. Продемонстрируйте применение прямого статистического анализа рынка ценных бумаг.

Задание 7. Вычислите матрицы ковариации с помощью метода ведущего фактора.

Задание 8. Проведите проверку адекватности модели случайных блужданий (модель RWM).

Задание 9. Проведите проверку адекватности VaR –подхода.

Задание 10. Используйте теорию равновесия на конкурентном рынке ценных бумаг (теория CARM) .

Задание 11. Проведите проверку адекватности волновой теории Эллиота.

Задание 12. Проведите проверку адекватности теории рефлексивности Сороса

3 Графические методы анализа и прогноза изменения тенденций. Индикаторы разворота. Частотные характеристики этих индикаторов.

Задание 1. Используя различные виды графических методов технического анализа рынка ценных бумаг проанализируйте любую ценную бумагу на выбор.

Задание 2. Постройте линейные графики анализа и прогноза изменения тенденций. Рассчитайте индикаторы разворота и частотные характеристики этих индикаторов.

Задание 3. Используйте метод японских свеч анализа и прогноза изменения тенденций. Рассчитайте индикаторы разворота и частотные характеристики этих индикаторов.

Задание 4. Используйте программные средства графического анализа рынка ценных бумаг.

Задание 5. Используя скользящие средние и сглаживание сезонных колебаний с использованием метода скользящих средних спрогнозируйте курсовую стоимость ценной бумаги с использованием метода.

Задание 6. Используйте общее правило анализа осцилляторов. Поработайте с осцилляторами: Momentum, CCI, ROC, Stochastic, RKS, PKF, ALF, KPI, OSC, UOS, PCR, FI, NFI. Постройте средних по RSI.

Задание 7. Поработайте с неграфическими индикаторами Демарка (DMI), TEST (Бурыкин) и др.

Задание 8. Поработайте с пакетом программ PointCast Business Network.

Задание 9. Поработайте с пакетом программ технического анализа Meta Stock.

Задание 10. Поработайте с пакетом программ технического анализа Omega TradeStation2000.

Задание 11. Поработайте с пакетом программ волнового анализа Advanced Get.

Задание 12. Поработайте с информационно – торговым терминалом Meta Trader.

Задание 13. Используйте сетевого брокера для торговли ценными бумагами: открытие брокерского счета, юридические аспекты, передача распоряжений по Интернету, получение котировок, типы ордеров, обработка ордеров брокером

Задание 14. Мониторинг текущего состояния счета.

7. Самостоятельная работа на одной из виртуальных бирж

Варианты проектных заданий.

Проект №1. Проанализируйте особенности работы на фондовой бирже ММВБ.

Проект №2. Проанализируйте особенности работы на фондовой бирже РТС.

Проект №3. Проанализируйте особенности работы на фондовой бирже МФБ.

Проект №4. Проанализируйте особенности работы на фондовой бирже FOREX.

Проект №5. Проанализируйте особенности работы на фондовой бирже NYSE.

Проект №6. Проанализируйте особенности работы на фондовой бирже NASDAQ.

Проект №7. Проанализируйте особенности работы на фондовой бирже AMEX.

Проект №8. Составьте рыночный портфель с использованием методов технического анализа.

Проект №9. Поработайте на фондовой бирже ММВБ.

Проект №10. Поработайте на фондовой бирже РТС.

Проект №11. Поработайте на фондовой бирже МФБ.

Проект №12. Поработайте на фондовой бирже FOREX.

Проект №13. Поработайте на фондовой бирже NYSE.

Проект №14. Поработайте на фондовой бирже NASDAQ.

Проект №15. Поработайте на фондовой бирже AMEX.

4.2 Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации

Примерный перечень вопросов к зачету

1. Основные понятия рынка ценных бумаг.
2. Методы оценки эффективности и риска ценных бумаг и одной транзакции.
3. Портфели ценных бумаг и их характеристики ОПЦБ
4. Оптимальный портфель Марковица
5. Оптимальный согласованный портфель Рубинштейна
6. Оптимальный комбинированный портфель Тобина с безрисковой компонентой
7. Рыночный портфель
8. Решение задачи составления оптимального портфеля Марковица.
9. Свойства оптимального портфеля Марковица.
10. Исключительный случай составления оптимального портфеля Марковица.
11. Численное исследование оптимального портфеля Марковица при запрещении операции Short Sale.
12. Решение задачи составления оптимального портфеля Рубинштейна.
13. Свойства оптимального портфеля Рубинштейна.
14. Численное исследование оптимального портфеля Рубинштейна при запрещении операции Short Sale
15. Решение задачи составления оптимального портфеля Тобина с безрисковой компонентой.
16. Свойства оптимального портфеля Тобина.
17. Численное исследование оптимального портфеля Тобина при запрещении операции Short Sale
18. Бета ценной бумаги
19. Бета ценной бумаги для портфеля Тобина
20. Прямой статистический анализ рынка ценных бумаг
21. Метод ведущих факторов
22. Вычисление матрицы ковариации с помощью метода ведущего фактора.
23. Модель случайных блужданий (модель RWM)
24. VaR –подход (оценка возможных потерь)
25. Теория равновесия на конкурентном рынке ценных бумаг (теория CARM) .
26. Волновая теория Эллиота
27. Теория рефлексивности Сороса
28. Различные виды графических методов технического анализа рынка ценных бумаг.
29. Линейные графики анализа и прогноза изменения тенденций. Индикаторы разворота. Частотные характеристики этих индикаторов.
30. Метод японских свеч анализа и прогноза изменения тенденций. Индикаторы разворота. Частотные характеристики этих индикаторов.
31. Программные средства графического анализа рынка ценных бумаг
32. Скользящие средние.
33. Сглаживание сезонных колебаний с использованием метода скользящей средней.

34. Прогнозирование курсовой стоимости ценной бумаги с использованием метода скользящей средней
35. Общее правило анализа осцилляторов. Основные осцилляторы: Momentum, CCI, ROC, Stochastic, RKS, PKF, ALF, KPI, OSC, UOS, PCR, FI, NFI. Построение средних по RSI.
36. Неграфические индикаторы: Индикаторы Демарка (DMI), TEST (Бурыкин) и др.
37. Финансовая сеть CNNfn
38. Пакет программ PointCast Business Network
39. Пакет технического анализа Meta Stock
40. Пакет технического анализа Omega TradeStation2000
41. Пакет волнового анализа Advanced Get
42. Информационно – торговый терминал Meta Trader
43. Использование сетевого брокера для торговли ценными бумагами: Открытие брокерского счета, юридические аспекты, передача распоряжений по Интернету, получение котировок, типы ордеров, обработка ордеров брокером
44. Мониторинг текущего состояния счета
45. Особенности работы на фондовых биржах ММВБ, РТС, МФБ, FOREX, NYSE, NASDAQ, AMEX

5. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

5.1 Основная литература:

1. Игонина, Людмила Лазаревна. Инвестиции: учебник / Игонина, Людмила Лазаревна ; Л. Л. Игонина. - 2-е изд., перераб. и доп. - М. : Магистр : ИНФРА-М, 2013. - 749 с. - Библиогр.: с. 735-739. - ISBN 9785977600712. - ISBN 9785160063232. 50 шт
2. Узденов У.А. Математические методы и модели оптимального портфеля ценных бумаг / Узденов, Умар Ахматович, Коваленко, Анна Владимировна, Уртенев, Махамед Али Хусеевич ; У. А. Узденов, А. В. Коваленко, М. Х. Уртенев ; М-во образования и науки Рос. Федерации, Карачаево-Черкесский гос. ун-т им. У. Д. Алиева. - Карачаевск : [Карачаево-Черкесский государственный университет им. У. Д. Алиева], 2012. - 145 с. : ил. - Библиогр.: с. 138-143. - ISBN 5820900723. 6 шт
3. Лахметкина, Наталия Ивановна. Инвестиционная стратегия предприятия [Текст] : учебное пособие для студентов / Н. И. Лахметкина ; [Финансовый ун-т при Правительстве Рос. Федерации]. - 6-е изд., стер. - М. : КНОРУС, 2012. - 230 с. - Библиогр.: с. 228-230. - ISBN 9785406015209 : 150.10. 17 шт
4. Касимов, Ю. Ф. Финансовая математика [Электронный ресурс] : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / Ю. Ф. Касимов. - 5-е изд., перераб. и доп. - М. : Юрайт, 2017. - 459 с. - <https://biblio-online.ru/book/D3891CE0-3C37-445C-A6AE-3E9A70177AE7>.

5.2 Дополнительная литература:

1. Финансы [Электронный ресурс] : учебник и практикум для академического бакалавриата / Н. И. Берзон [и др.] ; под общ. ред. Н. И. Берзона. - 2-е изд., перераб. и доп. - М. : Юрайт, 2018. - 498 с. - <https://biblio-online.ru/book/996D779C-5B57-4576-87FF-FD8B9F4FFE35/finansy>.
2. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс] : учебник для прикладного бакалавриата / Ю. А. Соколов [и др.] ; отв. ред. Ю. А. Соколов. - М. : Юрайт, 2018. - 384 с. - <https://biblio-online.ru/book/D9DB85ED-523B-4B2C-AE59-E6006470790A/rynok-cennyh-bumag>.

6. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины

1. Фондовый рынок - Ежедневные обзоры. [Электронный ресурс]. – www.instabroker.ru/
2. Википедия, свободная энциклопедия. Wikipedia <http://ru.wikipedia.org>
3. Характеристика российского рынка ценных бумаг. [Электронный ресурс]. – <http://psyera.ru>
4. Векселя, ценные бумаги банк ТРАСТ. [Электронный ресурс]. – www.trust.ru
5. Секрет торговли на фондовом рынке. [Электронный ресурс]. – www.mediakursy.ru
6. Все секреты трейдинга. [Электронный ресурс]. – www.iforex.com
7. Ценные бумаги. [Электронный ресурс]. – www.alfacapital.ru/
8. Торговля акциями - Начните торговать на бирже. [Электронный ресурс]. – www.instaforex.com
9. Технический анализ. Аналитика ФОРЕКС. [Электронный ресурс]. – www.alpari.ru
10. Market Technicians Association (MTA) [Электронный ресурс]. – <http://www.mta.org/eweb/StartPage.aspx>
11. Федеральная служба по финансовым рынкам. [Электронный ресурс]. – <http://www.fcsm.ru>

7. Методические рекомендации по организации изучения дисциплины

Контрольная работа представляет собой самостоятельную реферативную работу студентов. Каждый студент выполняет работу по одной теме.

Для написания реферата необходимо подобрать литературу. Общее количество литературных источников, включая тексты из Интернета, (публикации в журналах), должно составлять не менее 10 наименований. Учебники, как правило, в литературные источники не входят.

Рефераты выполняют на листах формата А4. Страницы текста, рисунки, формулы нумеруют, рисунки снабжают порисуночными надписями. Текст следует печатать шрифтом №14 с интервалом между строками в 1,5 интервала, без недопустимых сокращений. В конце реферата должны быть сделаны выводы.

В конце работы приводят список использованных источников.

Реферат должен быть подписан магистром с указанием даты ее оформления. Работы, выполненные без соблюдения перечисленных требований, возвращаются на доработку.

Творческие задания (проекты), способствующие формированию компетенций базовой части ООП

Математическое и информационное обеспечение инвестиционной деятельности сегодня рассматривается как одно из главных направлений модернизации всей государственной системы, как необходимое условие и важнейший этап информатизации страны в целом.

Основные направления анализа экономической деятельности предприятий и регионов:

- организация банка программных продуктов, для создания оптимального портфеля ценных бумаг, используемых финансистами и инвесторами;

- разработка программных продуктов для формирования портфеля ценных бумаг;
- управление портфелем финансовых инструментов;
- формирование портфеля ценных бумаг с условно ожидаемой доходностью.

Использование в работе финансистами и инвесторами программных продуктов не отрицает традиционных технологий формирования портфеля ценных бумаг, а выступает в качестве продукта поддержки принятия решений, что значительно влияет на качество принимаемых решений.

Проведите анализ по одной из выбранных вами тематик (не менее 10 слайдов и 20 листов текста). Возможно использование звукового сопровождения, анимации (аудио-, и видеоматериала).

На первой странице слайда обязательно укажите Ф.И.О. автора, курс. Оценивается работа по следующим критериям:

- полнота представленного материала;
- оформление;
- представление и защита.

Темы презентаций

- Презентация «Математические методы формирования портфеля ценных бумаг».
- Презентация «Управление портфелем финансовых инструментов».
- Презентация «Формирование портфеля ценных бумаг с условно ожидаемой доходностью».
- Презентация «Модели прогнозирования доходности портфеля».

8. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса

8.1 Перечень информационных технологий.

- Использование электронных презентаций при проведении лекционных и практических занятий.

8.2 Перечень необходимого программного обеспечения.

1. Операционная система MS Windows (Microsoft Windows 8, 10 "№73–АЭФ/223-ФЗ/2018 Соглашение Microsoft ESS 72569510").
2. Интегрированное офисное приложение MS Office (Microsoft Office Professional Plus "№73–АЭФ/223-ФЗ/2018 Соглашение Microsoft ESS 72569510").
3. Программное обеспечение для организации управляемого коллективного и безопасного доступа в Интернет.

9. Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине

№	Вид работ	Материально-техническое обеспечение дисциплины (модуля) и оснащенность
	Лекционные занятия	Лекционная аудитория, оснащенная презентационной техникой (проектор, экран, компьютер/ноутбук) и соответствующим программным обеспечением (ПО), доска Ауд. 129, 131, 301б, 305, 307
	Лабораторные занятия	Аудитория, укомплектованная специализированной мебелью и техническими средствами обучения, компьютерами, программным обеспечением MS Windows,

		Microsoft Visual Studio, Microsoft Power Point, Microsoft Word, Microsoft Excel, а также укомплектованная маркерной доской. Ауд. 101, 106, 106а
	Групповые (индивидуальные) консультации	Аудитория, укомплектованная специализированной мебелью и техническими средствами обучения, компьютерами, программным обеспечением MS Windows, Microsoft Visual Studio, Microsoft Power Point, Microsoft Word, Microsoft Excel, а также укомплектованная маркерной доской Ауд. 129
	Текущий контроль, промежуточная аттестация	Аудитория, укомплектованная специализированной мебелью и техническими средствами обучения, компьютерами, программным обеспечением MS Windows, Microsoft Visual Studio, Microsoft Power Point, Microsoft Word, Microsoft Excel, а также укомплектованная маркерной доской Ауд. 129
	Самостоятельная работа	Кабинет для самостоятельной работы, оснащенный компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет», программой экранного увеличения и обеспеченный доступом в электронную информационно-образовательную среду университета. Ауд. 102-А и читальный зал