Министерство образования и науки Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Кубанский государственный университет»
Экономический факультет

УТВЕРЖДАЮ:
Проректор по учебной работе,
качеству образования – первый
проректор
_____ Иванов А.Г.
подпись
«01» июля 2016 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Б1.В.ДВ.09.01 Анализ финансовых рынков
(код и наименование дисциплины в соответствии с учебным планом)

Направление подготовки/специальность 27.03.03 Системный анализ и управление
(код и наименование направления подготовки/специальности)

Направленность (профиль) / специализация Системный анализ и управление экономическими процессами
(наименование направленности (профиля) специализации)

Программа подготовки академическая
(академическая /прикладная)

Форма обучения очная
(очная, очно-заочная, заочная)

Квалификация (степень) выпускника бакалавр
(бакалавр, магистр, специалист)

Краснодар 2016

1 Цели и задачи изучения дисциплины

1.1 Цель дисциплины

Формирование у обучающихся профессиональных компетенций, позволяющих на основе современных аналитических инструментов исследовать различные сегменты рынка финансовых услуг для решения прикладных инвестиционных задач.

1.2 Задачи дисциплины

1. Усвоение понятийно-категориального аппарата, характеризующего процессы и явления финансового рынка;
2. Раскрыть инструментально-институциональную составляющую функционирования финансового рынка;
3. Обозначить взаимосвязи и взаимозависимости между финансовым и реальным сектором экономики;
4. Развить способности обучающихся в применении современных количественных методов познания процессов, происходящих на рынке финансовых услуг;
5. Познакомить с особенностями управления портфелем финансовых активов на примере реального рынка;
6. Обозначить роль и место государства в регулировании финансового рынка.

1.3 Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Дисциплина «Анализ финансовых рынков» является дисциплиной по выбору Блока 1 «Дисциплины (модули)» учебного плана. Дисциплина предназначена для студентов четвертого года обучения направления «Системный анализ и управление», читается в 7 семестре 4 курса. Дисциплина читается после ряда гуманитарных, математических, общеэкономических и специальных дисциплин, позволяющих наиболее эффективно усваивать учебный материал в рамках данного курса. Предполагается также, что студенты обладают базовыми знаниями и навыками в области «Финансов и кредита», «Экономического анализа», «Финансовой математики».

Знания, полученные в ходе изучения дисциплины, дополняют набор компетенций, приобретаемых на дисциплинах «Финансовый менеджмент», «Бизнес-анализ».

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

Изучение данной учебной дисциплины направлено на формирование у обучающихся профессиональных компетенций

№ п.п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	**уметь**	**владеть**
1	ПК-1	Способность принимать научно-обоснованные решения на основе математики, физики, химии, информатики, экологии, методов системного анализа и теории управления, теории знаний,	Особенности применения методов информатики, теории управления, системного анализа, математики при моделировании хозяйственных ситуаций и принятии решений на	Определять цели, подбирать инструменты и анализировать эффективность принятых инвестиционно-финансовых решений	Навыками построения экономико-математических моделей с использованием актуальной биржевой информации

№ п.п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	**уметь**	**владеть**
		осуществлять постановку и выполнять эксперименты по проверке их корректности и эффективности	финансовых рынках		
2	ПК-4	Способность применять методы системного анализа, технологии синтеза и управления для решения прикладных проектно-конструкторских задач	Современные методы системного анализа, используемые для решения прикладных задач в области финансового инвестирования	Применять аналитические методы для расчета параметров риска, доходности и ликвидности финансовых инструментов	Навыками эффективного воздействия, посредством инвестиционных инструментов, на пропорции основного финансового противоречия

2. Структура и содержание дисциплины

2.1 Распределение трудоёмкости дисциплины по видам работ

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

Вид учебной работы		Всего часов	Семестры
			7
Контактные часы, в том числе		**38,2**	**38,2**
Аудиторные занятия (всего)		**34**	**34**
Занятия лекционного типа		18	18
Занятия семинарского типа (семинары, практические занятия)			
Лабораторные занятия		16	16
Иная контактная работа:			
Контролируемая самостоятельная работа (КСР)		4	4
Промежуточная аттестация (ИКР)		0,2	0,2
Самостоятельная работа, в том числе		**33,8**	**33,8**
Кейс-задание		10	10
Проработка учебного теоретического материала (Самостоятельное изучение разделов)		13,8	13,8
Подготовка к текущему контролю		10	10
Контроль:			
Общая трудоемкость	**час**	**72**	**72**
	в том числе контактная работа.	**38,2**	**38,2**
	зач. ед	**2**	**2**

2.2 Структура дисциплины:

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины.

Разделы (темы) дисциплины, изучаемые в _7_ семестре

№ раздела	Наименование тем	Количество часов				
		Всего	Аудиторная работа			Внеаудиторная работа
			Л	ПЗ	ЛР	СРС
1	2	3	4	5	6	7
1.	Финансовый рынок в воспроизводственных процессах	4	2		2	
2.	Институциональное обеспечение финансовых рынков	4	2		2	
3.	Государственное регулирование финансового рынка	8	2		2	4
4.	Классические и современные инструменты финансового рынка	6	2		2	4
5.	Анализ межсегментного взаимодействия институтов финансового рынка	8	2		2	4
6.	Аналитические инструменты портфельного инвестирования	5,8	2		2	1,8
7.	Анализ взаимодействия институтов финансового рынка и реального сектора экономики	14	2		2	10
8.	Экономико-математические методы анализа финансового рынка	18	4		2	10
	Итого по дисциплине:		18		16	33,8

Примечание: Л – лекции, ПЗ – практические занятия / семинары, ЛР – лабораторные занятия, СРС – самостоятельная работа студента

2.3 Содержание разделов(тем) дисциплины:

2.3.1 Занятия лекционного типа

№	Наименование раздела(темы)	Содержание раздела (темы)	Форма текущего контроля
1	2	3	4
1.	Финансовый рынок в воспроизводственных процессах	1. Понятие финансового рынка 2. Сегменты финансового рынка и их взаимодействие 3. Историческая типизация финансового капитала 4. Взаимосвязь современного типа производства и финансов 5. Глобализация финансовых рынков	Контрольные вопросы
2.	Институциональное обеспечение финансовых рынков	1. Основные инфраструктурные институты финансового рынка 2. Информационные потоки на финансовом рынке 3. Роль саморегулируемых организаций в рыночном ценообразовании	Контрольные вопросы

		4. Глобальные финансовые институты и их взаимодействие с российским рынком	
3.	Государственное регулирование финансового рынка	1. Эволюция форм и методов государственного регулирования финансового рынка 2. Становление института мегарегулирования 3. Законодательные и монетарные методы воздействия государства на финансовый рынок 4. Постмонетарные концепции развития взаимодействия государства и институтов рынка финансовых услуг	Контрольные вопросы
4.	Классические и современные инструменты финансового рынка	1. Долевые инструменты (акции, паи) 2. Долговые инструменты (облигации, векселя) 3. Ссудо-сберегательные инструменты (депозиты, сертификаты) 4. Страхование на финансовом рынке	Контрольные вопросы
5.	Анализ межсегментного взаимодействия институтов финансового рынка	1. Принципы сегментации финансового рынка 2. Рынок капиталов 3. Валютный рынок 4. Рынок золота 5. Денежный рынок	Контрольные вопросы
6.	Аналитические инструменты портфельного инвестирования	1. Расчет риска и ликвидности портфеля 2. Бета и Альфа коэффициенты 3. Инструменты фундаментального анализа 4. Хеджирование портфеля	Контрольные вопросы
7.	Анализ взаимодействия институтов финансового рынка и реального сектора экономики	1. Взаимосвязь процентных ставок и денежного предложения 2. Отраслевая и региональная дифференциация взаимодействия институтов рынка финансовых услуг и субъектов реальной экономики в России	Контрольные вопросы
8.	Экономико-математические методы анализа финансового рынка	1. Модель У. Шарпа 2. CAPM – модель 3. Регрессионный анализ ценообразования на финансовом рынке	Контрольные вопросы

2.3.2 Занятия семинарского типа

Не предусмотрены

2.3.3 Лабораторные занятия

№	Наименование раздела	Тематика лабораторных занятий	Форма текущего контроля
1	2	3	4
1.	Финансовый рынок в воспроизводственных процессах	1. Понятие финансового рынка 2. Сегменты финансового рынка и их взаимодействие 3. Историческая типизация финансового капитала 4. Взаимосвязь современного типа производства и финансов 5. Глобализация финансовых рынков	О
2.	Институциональное обеспечение финансовых рынков	1. Основные инфраструктурные институты финансового рынка 2. Информационные потоки на финансовом рынке 3. Роль саморегулируемых организаций в рыночном ценообразовании 4. Глобальные финансовые институты и их взаимодействие с российским рынком	О
3.	Государственное регулирование финансового рынка	1. Эволюция форм и методов государственного регулирования финансового рынка 2. Становление института мегарегулирования 3. Законодательные и монетарные методы воздействия государства на финансовый рынок 4. Постмонетарные концепции развития взаимодействия государства и институтов рынка финансовых услуг	О
4.	Классические и современные инструменты финансового рынка	1. Долевые инструменты (акции, паи) 2. Долговые инструменты (облигации, векселя) 3. Ссудо-сберегательные инструменты (депозиты, сертификаты) 4. Страхование на финансовом рынке 5. Производные финансовые инструменты (форварды, фьючерсы, опционы, депозитарные расписки) 6. Операции РЕПО, валютные и процентные свопы 7. Сделки с драгоценными металлами 8. Валютные операции на финансовом рынке	О
5.	Анализ	1. Принципы сегментации	К

	межсегментного взаимодействия институтов финансового рынка	финансового рынка 2. Рынок капиталов 3. Валютный рынок 4. Рынок золота 5. Денежный рынок 6. Страховой рынок 7. Переливы капиталов внутри сегментов финансового рынка	
6.	Аналитические инструменты портфельного инвестирования	1. Классификация инвестиционных портфелей 2. Определение доходности портфеля 3. Расчет риска и ликвидности портфеля 4. Бета и Альфа коэффициенты 5. Инструменты фундаментального анализа 6. Хеджирование портфеля	К
7.	Анализ взаимодействия институтов финансового рынка и реального сектора экономики	1. Взаимосвязь процентных ставок и денежного предложения 2. Отраслевая и региональная дифференциация взаимодействия институтов рынка финансовых услуг и субъектов реальной экономики в России	К
8.	Экономико-математические методы анализа финансового рынка	1. Модель У. Шарпа 2. САРМ – модель 3. Регрессионный анализ ценообразования на финансовом рынке	К

О-устный опрос, К- кейс

2.3.4 Методические указания к лабораторным работам

Лабораторная работа 1

Тема: Финансовый рынок в воспроизводственных процессах

На занятиях студенты, используя ресурсы, представленные в профессиональных базах данных, а также учебной литературы формируют знания в области функционирования современных финансовых рынков.

Лабораторная работа 2

Тема: Институциональное обеспечение финансовых рынков

На занятиях студенты, используя ресурсы, представленные в профессиональных базах данных, а также учебной литературы формируют знания в области институционального обеспечения финансовых рынков.

Лабораторная работа 3

Тема: Государственное регулирование финансового рынка

На занятиях студенты, используя ресурсы, представленные в профессиональных базах данных, а также учебной литературы формируют знания в области государственного регулирования финансовых рынков.

Лабораторная работа 4

Тема: Классические и современные инструменты финансового рынка

На занятиях студенты, используя ресурсы, представленные в профессиональных базах данных, а также учебной литературы формируют знания в области классических и современных инструментов финансового рынка.

Лабораторная работа 5

Тема: Анализ межсегментного взаимодействия институтов финансового рынка

На занятиях студенты, используя ресурсы, представленные в профессиональных базах данных, а также учебной литературы формируют знания, умения и навыки, выполняя кейс задание.

Лабораторная работа 6

Тема: Аналитические инструменты портфельного инвестирования

На занятиях студенты, используя ресурсы, представленные в профессиональных базах данных, а также учебной литературы формируют знания, умения и навыки, выполняя кейс задание.

Лабораторная работа 7

Тема: Анализ взаимодействия институтов финансового рынка и реального сектора экономики

На занятиях студенты, используя ресурсы, представленные в профессиональных базах данных, а также учебной литературы формируют знания, умения и навыки, выполняя кейс задание.

Лабораторная работа 8

Тема: Экономико-математические методы анализа финансового рынка

На занятиях студенты, используя ресурсы, представленные в профессиональных базах данных, а также учебной литературы формируют знания, умения и навыки, выполняя кейс задание.

2.3.5 Примерная тематика курсовых работ (проектов)

Курсовая работа (проект) – не предусмотрены.

2.4 Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

№	Вид СР	Перечень учебно-методического обеспечения дисциплины по выполнению самостоятельной работы
1	2	3
1.	Подготовка к лекции, семинарские занятия	Методические указания для подготовки к занятиям лекционного и семинарского типа составлены в соответствии с требованиями Федеральных государственных образовательных стандартов высшего образования по 27 и 38 УГСН. Утверждены на заседании Совета экономического факультета ФГБОУ ВО «КубГУ». Протокол № 8 от 29 июня 2017 г. https://www.kubsu.ru/ru/econ/metodicheskie-ukazaniya
2.	Самостоятельная работа	Методические указания по выполнению самостоятельной работы составлены в соответствии с требованиями Федеральных государственных образовательных стандартов высшего

		образования по 27 и 38 УГСН. Утверждены на заседании Совета экономического факультета ФГБОУ ВО «КубГУ». Протокол № 8 от 29 июня 2017 г. https://www.kubsu.ru/ru/econ/metodicheskie-ukazaniya
3.	Кейс	Методические указания по выполнению самостоятельной работы составлены в соответствии с требованиями Федеральных государственных образовательных стандартов высшего образования по 27 и 38 УГСН. Утверждены на заседании Совета экономического факультета ФГБОУ ВО «КубГУ». Протокол № 8 от 29 июня 2017 г. https://www.kubsu.ru/ru/econ/metodicheskie-ukazaniya

Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся из числа инвалидов и лиц с инвалидностью (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.

Данный перечень может быть конкретизирован в зависимости от контингента обучающихся.

3. Образовательные технологии

В процессе изучения дисциплины лекции, семинары, лабораторные занятия, консультации являются ведущими формами обучения в рамках лекционно-семинарской образовательной технологии.

Лекции излагаются в виде презентации с использованием мультимедийной аппаратуры. Данные материалы в электронной форме передаются студентам.

Основной целью лабораторных занятий является моделирование практических ситуаций. Дополнительной целью лабораторных занятий является контроль усвоения пройденного материала. На лабораторных занятиях также осуществляется проверка выполнения заданий.

В соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки используются при освоении дисциплины в учебном процессе активные и интерактивные (взаимодействующие) формы проведения занятий. При реализации различных видов учебной работы (лекций и лабораторных занятий) используются следующие образовательные технологии:

- лекция-визуализация;
- опрос;
- кейс.

В сочетании с внеаудиторной работой они создают дополнительные условия формирования и развития требуемых компетенций обучающихся, поскольку позволяют обеспечить активное взаимодействие всех участников. Эти методы способствуют личностно-ориентированному подходу.

Для лиц с инвалидностью предусмотрена организация консультаций с использованием электронной почты.

4. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации

4.1 Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля

Пример вопросов к устному опросу

Тема: Финансовый рынок в воспроизводственных процессах

1. Понятие финансового рынка
2. Сегменты финансового рынка и их взаимодействие
3. Историческая типизация финансового капитала
4. Взаимосвязь современного типа производства и финансов

Глобализация финансовых рынков

Пример кейсов

На основе данных Московской биржи необходимо скорректировать инвестиционный портфель, используя модель ценообразования активов (CAPM)

Инструменты	Eri		Ro	Rm-Ro	коэф.B	B*(Rm-Ro)	Ru
1.ФосАгро ОАО ао	Последняя дох-ть	26%	2,00		1,76		
	Срд.ожид.дох-ть	6%					
2."Магнит" ОАО ао	Последняя дох-ть	20%	2,00		1,78		
	Срд.ожид.дох-ть	7%					
3.РДР Юнайтед Компани РУСАЛ Плс	Последняя дох-ть	58%	2,00		5,26		
	Срд.ожид.дох-ть	-1%					
4.Polymetal International plc	Последняя дох-ть	49%	2,00		3,92		
	Срд.ожид.дох-ть	7%					
5.МегаФон ОАО ао	Последняя дох-ть	-2%	2,00		0,12		
	Срд.ожид.дох-ть	-1%					
6.АЛРОСА ОАО ао	Последняя дох-ть	31%	2,00		2,07		
	Срд.ожид.дох-ть	7%					
7.НК ЛУКОЙЛ (ОАО) - ао	Последняя дох-ть	6%	2,00		1,33		
	Срд.ожид.дох-ть	-6%					
8.Сбербанк России ОАО ап	Последняя дох-ть	-11%	2,00		-0,45		
	Срд.ожид.дох-ть	-4%					
9.Фьючерсный контракт RTS-6.15	Последняя дох-ть	-18%	2,00		-1,08		
	Срд.ожид.дох-ть	-8%					
10. "Газпром" (ОАО) ао	Последняя дох-ть	5%	2,00		0,65		
	Срд.ожид.дох-ть	1%					

4.2 Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации

Примерные вопросы для подготовки к зачету

(ПК-1, ПК-4)

1. Понятие финансового рынка
2. Сегменты финансового рынка и их взаимодействие
3. Историческая типизация финансового капитала
4. Взаимосвязь современного типа производства и финансов
5. Глобализация финансовых рынков
6. Основные инфраструктурные институты финансового рынка
7. Информационные потоки на финансовом рынке
8. Роль саморегулируемых организаций в рыночном ценообразовании

9. Глобальные финансовые институты и их взаимодействие с российским рынком
10. Эволюция форм и методов государственного регулирования финансового рынка
11. Становление института мегарегулирования
12. Законодательные и монетарные методы воздействия государства на финансовый рынок
13. Постмонетарные концепции развития взаимодействия государства и институтов рынка финансовых услуг
14. Долевые инструменты (акции, паи)
15. Долговые инструменты (облигации, векселя)
16. Ссудо-сберегательные инструменты (депозиты, сертификаты)
17. Страхование на финансовом рынке
18. Производные финансовые инструменты (форварды, фьючерсы, опционы, депозитарные расписки)
19. Операции РЕПО, валютные и процентные свопы
20. Сделки с драгоценными металлами
21. Валютные операции на финансовом рынке
22. Принципы сегментации финансового рынка
23. Рынок капиталов
24. Валютный рынок
25. Рынок золота
26. Денежный рынок
27. Страховой рынок
28. Переливы капиталов внутри сегментов финансового рынка
29. Классификация инвестиционных портфелей
30. Определение доходности портфеля
31. Расчет риска и ликвидности портфеля
32. Бета и Альфа коэффициенты
33. Инструменты фундаментального анализа
34. Хеджирование портфеля
35. Экономический рост и финансовый рынок
36. Взаимосвязь процентных ставок и денежного предложения
37. Отраслевая и региональная дифференциация взаимодействия институтов рынка финансовых услуг и субъектов реальной экономики в России
38. Модель У. Шарпа
39. CAPM – модель
40. Регрессионный анализ ценообразования на финансовом рынке

Оценочные средства для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья выбираются с учетом их индивидуальных психофизических особенностей.

– при необходимости инвалидам и лицам с ограниченными возможностями здоровья предоставляется дополнительное время для подготовки ответа на зачете;

– при проведении процедуры оценивания результатов обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья предусматривается использование технических средств, необходимых им в связи с их индивидуальными особенностями;

– при необходимости для обучающихся с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов процедура оценивания результатов обучения по дисциплине может проводиться в несколько этапов.

Процедура оценивания результатов обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья по дисциплине (модулю) предусматривает предоставление

информации 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.

Данный перечень может быть конкретизирован в зависимости от контингента обучающихся.

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

5.1 Основная литература:

1. Алиев, А.Т. Управление инвестиционным портфелем [Электронный ресурс] : учеб. пособие / А.Т. Алиев, К.В. Сомик. — Электрон. дан. — Москва : Дашков и К, 2017. — 160 с. — Режим доступа: https://e.lanbook.com/book/93423.

2. Герасимов, В.М. Противоречия финансового взаимодействия банковского и реального секторов экономики современной России [Электронный ресурс] : монография / В.М. Герасимов, Ф.Р. Григорян. — Электрон. дан. — Москва : Дашков и К, 2014. — 191 с. — Режим доступа: https://e.lanbook.com/book/70562.

3. Николаева, И.П. Рынок ценных бумаг: Учебник для бакалавров [Электронный ресурс] : учеб. — Электрон. дан. — Москва : Дашков и К, 2015. — 256 с. — Режим доступа: https://e.lanbook.com/book/70569.

4. Шапкин, А.С. Экономические и финансовые риски: Оценка, управление, портфель инвестиций [Электронный ресурс] : учеб. пособие / А.С. Шапкин, В.А. Шапкин. — Электрон. дан. — Москва : Дашков и К, 2016. — 544 с. — Режим доступа: https://e.lanbook.com/book/93337.

5.2 Дополнительная литература:

1. Саввина, О.В. Регулирование финансовых рынков: Учебное пособие [Электронный ресурс] : учеб. пособие — Электрон. дан. — Москва : Дашков и К, 2012. — 204 с. — Режим доступа: https://e.lanbook.com/book/5668.

2. Незамайкин, В. Н. Финансовый менеджмент : учебник для бакалавров / В. Н. Незамайкин, И. Л. Юрзинова. — М. : Издательство Юрайт, 2017. — 467 с. — (Серия : Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-9916-3638-4. — Режим доступа : www.biblio-online.ru/book/4EEA768F-331A-4E5F-9999-72AC59AECE08.

3. Караев, А.К. Финансовая неустойчивость и макроэкономическая нестабильность: агентно ориентированное моделирование [Электронный ресурс] : монография / А.К. Караев, М.В. Мельничук. — Электрон. дан. — Москва : Дашков и К, 2014. — 158 с. — Режим доступа: https://e.lanbook.com/book/70597.

4. Незамайкин, В. Н. Финансовый менеджмент : учебник для бакалавров / В. Н. Незамайкин, И. Л. Юрзинова. — М. : Издательство Юрайт, 2017. — 467 с. — (Серия : Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-9916-3638-4. — Режим доступа : www.biblio-online.ru/book/4EEA768F-331A-4E5F-9999-72AC59AECE08.

Для освоения дисциплины инвалидами и лицами с ограниченными возможностями здоровья имеются издания в электронном виде в электронно-библиотечных системах.

Для лиц с ограниченными возможностями электронные базы предлагают технологии масштабирования и аудиопрослушивание.

4.3 Периодические издания:

1. Национальные интересы: приоритеты и безопасность
2. Финансы и кредит
3. Вопрос экономики
4. Финансовая аналитика: проблемы и решения
5. Экономист

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

1. Официальный сайт Банка России - http://www.cbr.ru/
2. Официальный сайт Московской биржи - http://www.moex.com/
3. Официальный сайт издания The New Times - https://newtimes.ru/
4. Интернет-проект Информационного Агентства Финмаркет – RusBonds - http://www.rusbonds.ru/about.asp
5. Официальный сайт издания «Уолл Стрит Джорнал» - https://www.wsj.com/

7. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

Курс состоит из 8 тем. Основной теоретический материал дается студентам в виде лекций, с включением тематических презентаций.

Для закрепления теоретического материала и формирования практических навыков риск менеджмента на фондовом рынке со студентами проводятся лабораторные занятия, включающие устные ответы, тематические дискуссии и кейс-заданий.

Целью проведения лабораторных занятий является закрепление полученных студентами на лекциях и в процессе самостоятельного изучения теоретических знаний, моделирование практических ситуаций, а также проверка эффективности самостоятельной работы студента.

Курс рассчитан на проведение лабораторных работ, на которых бакалавры занимаются управлением инвестиционным портфелем (работа в форме кейсов). Осуществляется сбор, обработка и анализ биржевой информации. Строятся экономико-математические модели и принимаются соответствующие управленческие решения.

Подготовку к занятию целесообразно начинать с повторения материала лекций, изучения литературы из основного и дополнительного списков. При этом следует учитывать, что лекционный курс ограничен по времени и не позволяет лектору детально рассмотреть все аспекты изучаемого вопроса. Следовательно, требуется самостоятельно расширять познания как теоретического, так и практического характера. Тем не менее, лекции дают хороший ориентир студенту для поиска дополнительных материалов.

В ходе самостоятельной подготовки студенту необходимо изучить, прежде всего, ту учебную литературу и прочие источники информации, которые рекомендованы преподавателем.

Научные и аналитические статьи, публикуемые в специализированных периодических изданиях, позволяют расширить кругозор и получить представление об актуальных проблемах, возможных путях их решения и или тенденциях в исследуемой области.

Посещение лекционных и лабораторных занятий является необходимым, но недостаточным условием для усвоения необходимых знаний по курсу. Каждый студент должен индивидуально готовиться по темам дисциплины, читая конспекты лекций и рекомендуемую литературу, заучивая базовые определения, классификации, схемы и типологии. Самостоятельная работа позволяет студенту в спокойной обстановке обдумать, разобраться с информацией по теме, при необходимости обратиться к справочной литературе. Внимательное чтение и повторение прочитанного помогает в полном объеме усвоить содержание темы, структурировать знания.

Самостоятельная работа студента в процессе освоения дисциплины включает в себя:

– изучение основной и дополнительной литературы по курсу;
– работу с электронными учебными ресурсами;
– изучение материалов периодической печати, Интернет - ресурсов;
– подготовку к зачету;
– индивидуальные и групповые консультации.

При необходимости в процессе работы над заданием студент может получить индивидуальную консультацию у преподавателя.

В освоении дисциплины инвалидами и лицами с ограниченными возможностями здоровья большое значение имеет индивидуальная учебная работа (консультации) – дополнительное разъяснение учебного материала.

Индивидуальные консультации по предмету являются важным фактором, способствующим индивидуализации обучения и установлению воспитательного контакта между преподавателем и обучающимся инвалидом или лицом с ограниченными возможностями здоровья.

8. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю) (при необходимости)

8.1 Перечень информационных технологий

На лекциях используется мультимедийная презентация в формате Power Point по всем темам курса. Проводится проверка домашних заданий и консультирование посредством электронной почты. Осуществляется использование электронных презентаций при проведении лабораторных занятий.

8.2 Перечень необходимого программного обеспечения

Для успешного освоения дисциплины, студент использует такие программные средства как Microsoft Windows 8, 10, Microsoft Office Professional Plus.

8.3 Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы

1. Базы данных компании «Ист Вью» http://dlib.eastview.com/;
2. Университетская информационная система РОССИЯ (УИС Россия) http://uisrussia.msu.ru/;
3. Портал открытых данных Российской Федерации https://data.gov.ru
4. База открытых данных Министерства труда и социальной защиты РФ https://rosmintrud.ru/opendata
5. База данных Научной электронный библиотеки eLIBRARY.RU https://elibrary.ru/
6. База данных профессиональных стандартов Министерства труда и социальной защиты РФ http://profstandart.rosmintrud.ru
7. Базы данных Министерства экономического развития РФ http://economy.gov.ru

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

№	Вид работ	Материально-техническое обеспечение дисциплины (модуля) и оснащенность
1.	Лекционные занятия	Аудитории, укомплектованные презентационной техникой (проектор, экран, ноутбук) и прикладным программным обеспечением (MicrosoftOffice). Ауд. 205А
2.	Лабораторная работа	Кабинет для лабораторной работы, оснащенный компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и прикладным программным обеспечением

		(MicrosoftOffice). Ауд. 202Н
3.	Групповые и индивидуальные консультации	Кафедра ЭАСиФ ауд. 223, ауд. А208Н
4.	Текущий контроль, промежуточная аттестация	Аудитории, укомплектованные презентационной техникой (проектор, экран, ноутбук) и прикладным программным обеспечением (MicrosoftOffice). Ауд. 520А, 207Н, 208Н, 209Н,212Н, 214Н, 201А,205А,А208Н, 202А, 210Н, 216Н, 513А, 514А, 515А, 516А,2026Л, 2027Л, 4033Л, 4034Л, 4035Л, 4036Л, 4038Л, 4039Л, 5040Л, 5041Л, 5042Л, 5043Л, 5045Л, 5046Л, 201Н, 202Н, 203Н, А203Н
5.	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.213А, 218А, 201Н, 202Н, 203Н, А203Н