

## АННОТАЦИЯ

Дисциплины Б1. В.ДВ.09.02

### АНАЛИЗ ФИНАНСОВЫХ АКТИВОВ

**Объем трудоемкости:** 2 зачетных единицы (72 часа, из них – 38,2 – контактная работа: лекции – 18 ч., лабораторные занятия – 16ч., иная контактная работа – 0,2ч., контролируемая самостоятельная работа – 4ч., самостоятельная работа – 33,8 ч.)

#### Цель дисциплины

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

#### 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.

#### Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Дисциплина «Анализ финансовых активов» 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».

#### Требования к уровню освоения дисциплины

Изучение дисциплины направлено на формирование следующих компетенций: ПК-1, ПК-4

№ п.п.	Индекс компет енции	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	Особенности применения методов информатики, теории управления, системного анализа, математики при моделировании хозяйственных	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
		анализа и теории управления, теории знаний, осуществлять постановку и выполнять эксперименты по проверке их корректности и эффективности	ситуаций и принятии решений на 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

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	
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
	<i>Итого по дисциплине:</i>		18		16	33,8

**Курсовые работы:** *не предусмотрены*

**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>.

Автор РПД

к.э.н., доц. В.А. Тюфанов