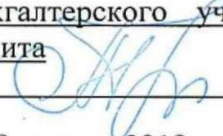


Министерство образования и науки РФ
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«СИБИРСКИЙ ФЕДЕРАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

СОГЛАСОВАНО

Заведующий кафедрой
Бухгалтерского учета, анализа и
аудита

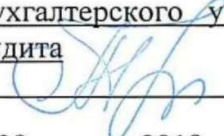
 - А.Т. Петрова

« 28 » июня 2018г.

Торгово-экономический институт

УТВЕРЖДАЮ

Заведующий кафедрой
Бухгалтерского учета, анализа и
аудита

 - А.Т. Петрова

« 28 » июня 2018г.

Торгово-экономический институт

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

АНАЛИЗ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

Дисциплина Б1.В.ДВ.2.2 Анализ финансовых рынков

Направление подготовки / 38.04.08 Финансы и кредит
специальность

Направленность (профиль) 38.04.08.03 «Стратегические финансы»

Форма обучения очная

Год набора 2018

Красноярск 2018

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

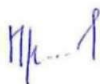
составлена в соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по укрупненной группе

380000 «ЭКОНОМИКА И УПРАВЛЕНИЕ»

Направления подготовки /специальность (профиль/специализация)

Направление 38.04.08 Финансы и кредит по магистерской программе
38.04.08.03 «Стратегические финансы» очная форма обучения год набора
2018

Программу
составили



к.э.н., доцент, Прохоров Виктор Владимирович

1 Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы, описание показателей и критериев оценивая компетенций

Курс	Семестр	Код и содержание компетенции	Результаты обучения (компоненты компетенции)	Оценочные средства
2	4	ОК-1 способность к абстрактному мышлению, анализу, синтезу.	Знать: -основные методы сбора и анализа информации;	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация)
			Уметь: - структурировать исходную информацию для анализа финансовых рынков	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация)
			Владеть: - способами рациональной постановки общественных и экономических задач	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация)
2	4	ОК-3 готовность к саморазвитию, самореализации, использованию творческого потенциала	Знать: -алгоритм научного поиска, характеристику основных элементов научной работы при анализе финансовых рынков;	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация)
			Уметь: представлять и докладывать результаты научного поиска, формулировать решаемую задачу	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация)
			Владеть: - методами исследовательской деятельности	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация)
2	4	ОПК-1 готовность к коммуникации в устной и письменной формах на русском и иностранном языках для решения задач профессиональной деятельности	Знать: -состав и виды профессиональной документации/отчетности, в том числе на иностранном языке, коммуникативной деятельности в устной и письменной формах	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация)
			Уметь: - формулировать и выражать собственные умозаключения в ходе общения с коллегами	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация)
			Владеть - способностью анализировать	Перечень вопросов к зачету

			проблемные ситуации, находить пути их решения	зачету (Промежуточная аттестация)
2	4	ДПК- 1 способность владеть методами аналитической работы, связанными с финансовыми аспектами деятельности коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно-правовых форм, в том числе финансово-кредитных, органов государственной власти и местного самоуправления	Знать - Законодательные и нормативно-правовые документы, регулирующие направления деятельности коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно-правовых форм, в том числе финансово-кредитных	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация)
			Уметь - Использовать полученные знания и информацию для выбора приемлемых функциональных элементов финансового анализа деятельности коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно-правовых форм, в том числе в сфере государственных учреждений	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация) Темы для рефератов (Текущий контроль)
			Владеть - Навыками осуществления рационального выбора экономических показателей	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация) Темы для рефератов (Текущий контроль) Задачи (Текущий контроль)
2	4	ДПК- 2 способность анализировать и использовать различные источники информации для проведения финансово-экономических расчетов	Знать: - источники экономической информации для проведения финансово-экономических расчетов	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация) Темы для рефератов (Текущий контроль)
			Уметь: - анализировать экономическую ситуацию и формулировать результаты финансово-экономических расчетов	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация) Темы для

				рефератов (Текущий контроль) Задачи (Текущий контроль)
			Владеть: - навыками практического применения методов финансового анализа	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация) Темы для рефератов (Текущий контроль) Задачи (Текущий контроль)
2	4	ДПК-3 способностью на основе комплексного экономического и финансового анализа дать оценку результатов и эффективности финансово-хозяйственной деятельности организаций различных организационно-правовых форм, включая финансово-кредитные, органов государственной власти и местного самоуправления	Знать: - современные методы анализа финансовых и денежных рынков	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация)
			Уметь: - рассчитывать и обобщать экономические показатели, характеризующие состояние участников финансового рынка различных организационно-правовых форм, включая финансово-кредитные, органов государственной власти и местного самоуправления	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация) Темы для рефератов (Текущий контроль) Задачи (Текущий контроль)
			Владеть: - дать оценку результатов и эффективности финансово-хозяйственной деятельности организаций различных организационно-правовых форм, включая органы государственной власти и местного самоуправления	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация) Темы для рефератов (Текущий контроль) Задачи (Текущий контроль)
2	4	ПК-9 способностью оценивать финансовую эффективность разработанных	Знать: - принципы оценки финансовой эффективности проектов в условиях финансово-экономических рисков и неопределенности	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация)

		проектов с учетом оценки финансово-экономических рисков и фактора неопределенности		Темы для рефератов (Текущий контроль)
			Уметь: - корректно проводить расчеты показателей оценки эффективности проектов с учетом фактора неопределенности и имеющихся финансово-экономических рисков	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация) , Задачи (Текущий контроль)
			Владеть: - критериями оценки показателей финансовой эффективности проектов	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация) Задачи (Текущий контроль)
2	4	ПК- 10 способность осуществить разработку бюджетов и финансовых планов организаций, включая финансово-кредитные, а также расчетов к бюджетам бюджетной системы Российской Федерации	Знать: - Виды бюджетов и финансовых планов организаций, включая финансово-кредитные, а также расчетов к бюджетам бюджетной системы Российской Федерации	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация)
			Уметь: - находить и принимать эффективные управленческие решения в сфере финансов организаций, государственных и муниципальных финансов	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация) , Темы рефератов (Текущий контроль)
			Владеть: - Навыками использования для решения аналитических и исследовательских задач современных технических средств и информационных технологий	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация) Задачи (Текущий контроль)
2	4	ПК- 11 способность обосновать на основе анализа финансово-экономических рисков стратегию поведения экономических агентов на различных	Знать: - методы и приемы анализа внешней и внутренней среды деятельности экономических агентов	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация) Задачи (Текущий контроль)

		финансовых рынках	<p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> - анализировать и содержательно интерпретировать информацию об альтернативах поведения экономических агентов на рынке; 	<p>Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация) Темы рефератов (Текущий контроль)</p>
			<p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> - навыками аналитической обработки информации и финансово-экономических рисков, выбора адекватного варианта поведения экономического агента на рынке 	<p>Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация) Задачи (Текущий контроль)</p>
2	4	ПК-18 способность осуществлять разработку инструментов проведения исследований в области финансов и кредита, анализ их результатов, подготовку данных для составления финансовых обзоров, отчетов и научных публикаций	<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> - методы проведения исследований в области финансов и кредита, анализа их результатов 	<p>Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация)</p>
			<p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> - проводить исследования в области финансов и кредита, анализ их результатов, подготовку данных для составления финансовых обзоров, отчетов и научных публикаций 	<p>Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация) Темы для рефератов (Текущий контроль) Задачи (Текущий контроль)</p>
			<p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> - методами проведения исследований в области финансов и кредита, анализа их результатов, 	<p>Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация) Задачи (Текущий контроль)</p>
2	4	ПК-19 способность осуществлять сбор, обработку, анализ и систематизацию информации по теме исследования, выбор методов и средств решения задач исследования	<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> - методы сбора, обработки, анализа и систематизации информации, методы и средства решения задач исследования 	<p>Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация)</p>
			<p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> - применять знания и навыки работы с информацией по теме исследования 	<p>Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация),</p>

				Темы рефератов (Текущий контроль)
			Владеть: - навыками применения методов и приемов анализа внешней и внутренней среды	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация) Задачи (Текущий контроль)
2	4	ПК-23 способность выявлять и проводить исследование финансово-экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов для разработки системы управления рисками	Знать: - понятие и принципы управления рисками	Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация)
	Уметь: - формулировать проблемы управления рисками		Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация) Темы рефератов (Текущий контроль)	
	Владеть: - методологией и методами исследования финансового поведения на макро, микро и мезо уровнях и для формирования системы управления рисками		Перечень вопросов к зачету (Промежуточная аттестация) Задачи (Текущий контроль)	

Контроль качества освоения дисциплины включает в себя текущий контроль успеваемости и промежуточную аттестацию.

Промежуточная аттестация по дисциплине проводится в форме зачета.

Текущий контроль осуществляется в форме подготовки рефератов и решения задач.

2 Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки владений, знаний, умений

2.1. Зачет

Промежуточная аттестация в форме зачёта проводится или путем устного собеседования по билетам, каждый из которых включает в себя два теоретических вопроса и задача. Теоретические вопросы выбираются из перечня вопросов к зачету.

Распределение теоретических вопросов и практических заданий по экзаменационным билетам находится в закрытом для обучающихся доступе. На зачёте обучающийся берет билет, для подготовки ответа ему отводится время в пределах 45 минут. В процессе ответа преподаватель может задавать обучающемуся дополнительные вопросы.

К зачету допускаются магистры:

- регулярно посещавшие занятия;
- подготовившие реферат;
- получившие положительную оценку по результатам практических занятий;

Полученная каждым магистром оценка заносится в ведомость. При получении неудовлетворительной оценки магистру предоставляется право пересдачи в соответствии с правилами высшего учебного заведения.

Перечень вопросов для промежуточной аттестации (зачет)

Номер темы	Содержание вопросов
1	1.1. Фондовые рынки. 1.2. Финансовые инструменты фондового рынка. 1.3. Участники фондового рынка. 1.4. Инфраструктура фондового рынка. 1.5. Мировой валютный рынок и его структура. 1.6. Структура валютного рынка. 1.7. Валютный курс и виды валютных курсов. 1.8. Основные типы валютных операций. 1.9. Участники валютного рынка. 1.10. Купля-продажа валюты на рынке FOREX.
2	2.1. Основы фундаментального анализа акций 2.2. Основы фундаментального анализа облигаций. 2.3. Основы технического анализа и его виды 2.4. Графический технический анализ 2.5. Индикаторный технический анализ.
3	3.1. Фундаментальный анализ. 3.2. Макроэкономический анализ. 3.3. Отраслевой анализ. 3.4. Региональный анализ. 3.5. Микроэкономический анализ. 3.6. Факторы и уровни фундаментального анализа валютного рынка. 3.7. Анализ общего состояния мировой экономики. 3.8. Анализ состояния национальной экономики. 3.9. Определение стоимости национальной валюты. 3.10. Паритет покупательной способности.

	3.11. Торговый баланс. 3.12. Индексы фондов. 3.13. Индикаторы денежной статистики. 3.14. Процентные ставки. 3.15. Уровень инфляции. 3.16. Валовой внутренний продукт. 3.17. Объем промышленного производства. 3.18. Использование производственных мощностей. 3.19. Заказы на товары длительного пользования. 3.20. Показатели объема запасов. 3.21. Статистика занятости, рынок труда. 3.22. Индикаторы потребительского спроса. 3.23. Индикаторы делового цикла. 3.24. Взаимосвязь валютного и фондового рынка.
4	4.1. Основные положения технического анализа. 4.2. Применение технического анализа. 4.3. Достоинство технического анализа. 4.4. Цель технического анализа. 4.5. Классификация методов технического анализа. 4.6. Основные виды графических формаций. 4.7. Основное правило при использовании графических формаций. 4.8. Основные модели формации перелома. 4.9. Модели формации продолжения тренда. 4.10. Теории используемые при техническом анализе. 4.11. Виды индикаторов. 4.12. Простая скользящая средняя. 4.13. Осцилляторы.
5	4.1. Теория Циклов 4.2. Волны Эллиота 4.3. Закономерности Фабиначи

Критерии оценивания:

- оценка «зачтено» выставляется, если магистр глубоко и точно раскрыл рассматриваемую тему; исчерпывающе, последовательно, грамотно и логически стройно излагает материал;

- оценка «незачтено» выставляется, если магистр не знает значительной части рассматриваемого материала, допускает существенные ошибки, с большими затруднениями выполняет или не выполняет анализа практических примеров.

Полученная каждым магистром оценка заносится в ведомость. При получении неудовлетворительной оценки магистру предоставляется право передачи в соответствии с правилами высшего учебного заведения.

Образец типового варианта экзаменационного билета

Утверждаю
Зав.кафедрой «Бухгалтерского учета, анализа и аудита»
_____/Петрова А.Т./
«__» ____ 201_ г.

Министерство
образования и науки РФ
ФГАОУ ВО
«Сибирский федеральный
университет»

Экзаменационный билет № 01

По дисциплине Анализ финансовых
рынков
Направления 38.04.03 Финансы и кредит
Факультет Экономики и управления
Институт Торгово-экономический
институт

1. Основы фундаментального анализа акций
2. Виды индикаторов.
3. Задача

2.2. Реферат

Методические указания по выполнению:

Темы рефератов выбираются по желанию магистров в соответствии с названием и содержанием рекомендованных в списке литературы источников. Реферат должен обобщать, как правило, содержание нескольких источников. Магистр может предложить свою тему, соответствующую его интересам, в рамках программы курса. При подготовке рефератов необходимо использовать не только рекомендованную литературу, но и дополнительные источники. Высокой оценки заслуживают рефераты аналитического характера, в которых проявляется умение автора применять свои знания по общеэкономическим и специальным дисциплинам, сопоставлять различные точки зрения, комментировать статистические и фактические данные, делать обоснованные и грамотные выводы.

Темы рефератов

1. Содержание финансовых рынков принципы их организации.
2. Роль финансовых рынков в деятельности корпорации.
3. Взаимосвязь денежных потоков корпорации с финансовым рынком.
4. Финансовый механизм корпорации и его структура.
5. Управление финансами корпорации: цели, задачи и функции.
6. Организация финансовой работы в корпорации.
7. Финансовые отношения корпораций с коммерческими банками и страховыми компаниями. Критерий выбора банка и страховой компании.
8. Кассовое обслуживание корпорации коммерческими банками.
9. Финансовые ресурсы корпорации. Формирование рациональной структуры источников средств корпораций.
10. Нетрадиционные источники формирования финансовых ресурсов: опционы, фьючерсы, варранты.

11. Рынок ценных бумаг

Критерии оценки реферата:

Выполненный реферат оценивается оценками «зачтено» или «незачтено».

- оценка «зачтено» выставляется, если магистр глубоко и точно раскрыл рассматриваемую тему; исчерпывающе, последовательно, грамотно и логически стройно излагает материал;

- оценка «незачтено» выставляется, если магистр не знает значительной части рассматриваемого материала, допускает существенные ошибки, с большими затруднениями выполняет или не выполняет анализа практических примеров.

2.3. Задачи

1. По окончании третьего года на счете инвестора находится сумма 21 074 руб. Начисление происходило по схеме сложного процента по ставке 12% в конце каждого года. Рассчитайте первоначальную сумму вклада:

2. По окончании второго года на счете инвестора находится сумма 28 732 руб. Начисление происходило по схеме сложного процента по ставке 13% в конце каждого года. Рассчитайте первоначальную сумму вклада:

3. По окончании четвертого года на счете инвестора находится сумма 36 600 руб. Начисление происходило по схеме сложного процента по ставке 10% в конце каждого года. Рассчитайте первоначальную сумму вклада:

4. По окончании второго года на счете инвестора находится сумма 32 542 руб. Начисление происходило по схеме сложного процента по ставке 11% в конце каждого года. Рассчитайте первоначальную сумму вклада:

5. По окончании 2-го года на счете клиента банка находится сумма 13 685.7 руб. Начисление процентов в банке происходило по схеме сложного процента в конце каждого квартала по ставке 16% годовых. Рассчитайте первоначальную сумму вклада.

6. Вкладчик положил в банк 20 000 руб. Банк выплачивает 9% годовых. Проценты сложные. Какая сумма будет на счете у вкладчика через два года.

7. Вкладчик положил в банк 20 000 руб. Банк выплачивает 12% годовых. Проценты сложные. Какая сумма будет на счете у вкладчика через три года.

8. Вкладчик положил в банк 10 000 руб. Банк выплачивает сложные проценты. Какая сумма будет на счете у вкладчика через три года, если процентная ставка за первый год - 20%, за второй - 30%, за третий - 25%?

9. Вкладчик положил в банк 10 000 руб. Банк выплачивает сложные проценты. Какая сумма будет на счете у вкладчика через два года, если процентная ставка за первый год - 20%, за второй - 30%?

10. Банк выплачивает 12% годовых. Проценты сложные. Какую минимальную сумму требуется разместить вкладчику в банке, чтобы через 2 года у него было не менее 10 000 руб.

11. Банк выплатил за первый год проценты по ставке Сбербанка, а за второй год на 10% ниже, чем в Сбербанке. Проценты сложные. Какую минимальную сумму требуется разместить вкладчику в банке, чтобы через 2

года его вклад был не менее 10 000 руб., если ставка Сбербанка все два года была равна 12% годовых.

12. Банк выплатил за первый год проценты по ставке Сбербанка, а за второй год на 10% ниже, чем в Сбербанке. Проценты сложные. Какую минимальную сумму требуется разместить вкладчику в банке, чтобы через 2 года его вклад был не менее 15 000 руб., если ставка Сбербанка все два года была равна 15% годовых.

Разработчик



В.В. Прохоров