Министерство науки и высшего образования Российской Федерации

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования
«Сибирский государственный индустриальный университет»

Кафедра экономики, учета и финансов. АО Кузнецкбизнесбанк

УТВЕРЖДАЮ
Директор института экономики и менеджмента
_____ В.В. Шипунова
подпись
«____» _____ 20___ г.

# РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Аналитика фондового рынка

38.03.01 «Экономика»
(направленность (профиль): «Экономика и устойчивое развитие»)

Квалификация выпускника
Бакалавр

Форма обучения
Очная форма

Срок обучения: 4 года

Год начала подготовки 2024

Новокузнецк
2024

СибГИУ
Подлинник электронного документа хранится в системе электронного согласования документов СибГИУ
ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН ЭП
Сертификат: 26ce1a4c63eb34e22ef8995de1a749fe88b45c40
Владелец: Директор ИЭиМ Шипунова Вера Васильевна
Действителен: с 19 апреля 2023 г по 12 июля 2024 г.
Дата и время: 25-03-2024 11:08:57 ПРОВЕРИТЬ ПОДПИСЬ

## 1 Цели и задачи освоения учебной дисциплины

Целями учебной дисциплины являются:

– Целью дисциплины является формирование у обучающихся целостного представления о ценных бумагах, современных подходов к анализу фондового рынка.

Задачами учебной дисциплины являются:

– изучение основных финансовых инструментов фондового рынка;
– выработка системного понимания фондового рынка;
– овладение навыками работы с финансовой информацией, основными индикаторами экономической статистики, публикуемыми информационными агентствами, центральными банками и правительствами, а также данными финансовой корпоративной отчетности.;
– изучение основных подходов к анализу фондового рынка.

## 2 Место учебной дисциплины в структуре ООП по направлению подготовки (специальности)

Учебная дисциплина относится к учебным дисциплинам части, формируемой участниками образовательных отношений **Блока 1 «Дисциплины (модули)»** ООП по направлению подготовки (специальности) 38.03.01 «Экономика».

Учебная дисциплина базируется на предварительном усвоении обучающимися учебных дисциплин:

– Финансы, денежное обращение и кредит;
– Инвестиционная деятельность организации;
– Разработка и оценка эффективности инвестиционного проекта организации;
– Антикризисное управление финансами;
– Финансовый менеджмент;
– Личные финансы.

Учебная дисциплина дополняет знания и умения, получаемые по одновременно изучаемым и последующим учебным дисциплинам:

– Оптимизация, оценка эффективности и устойчивости бизнес-процессов;
– Анализ и диагностика финансово-хозяйственной деятельности организации;
– Комплексный экономический анализ;
– Подготовка к сдаче и сдача государственного экзамена;
– Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы.

## 3 Планируемые результаты обучения по учебной дисциплине

Процесс изучения учебной дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

**– Профессиональные компетенции**

| Наименование категории (группы) ПК | Код и наименование ПК | Код и наименование индикатора достижения ПК | Планируемые результаты обучения |
|---|---|---|---|
| | ПК-1: Способен провести сбор, мониторинг и обработку данных для проведения расчетов экономических показателей организации | ПК-1.1 Собирает данные для составления проектов финансово-хозяйственной, производственной и коммерческой деятельности организации | – знать: способы сбора данных для составления проектов финансово-хозяйственной, производственной и коммерческой деятельности организации.<br>– уметь: формировать и собирать данные для составления проектов финансово-хозяйственной, производственной и коммерческой деятельности предприятия. |
| | | ПК-1.2 Проводит мониторинг изменения данных для проведения расчетов экономических показателей организации | – знать: методы и способы проведения мониторинга изменения данных для проведения расчетов экономических показателей организации.<br>– уметь: проводить мониторинг изменения данных для проведения расчетов экономических показателей организации. |

## 4 Объем и содержание учебной дисциплины

Учебные занятия по учебной дисциплине проводятся в форме контактной работы и в форме самостоятельной работы обучающихся.

Контактная работа включает в себя занятия лекционного типа (лекции), занятия семинарского типа (семинары, практические занятия, практикумы), промежуточную аттестацию обучающихся и иные формы взаимодействия обучающихся с педагогическими работниками и (или)

лицами, привлекаемыми к реализации ООП на иных условиях, в том числе при проведении промежуточной аттестации обучающихся. Контактная работа может проводиться с применением электронного обучения, дистанционных образовательных технологий.

## Объем учебной дисциплины

| Семестр / курс | | ***ИТОГО*** | ***8 семестр*** |
|---|---|---|---|
| Форма промежуточной аттестации | | | *экзамен* |
| Трудоёмкость | *академ. час.* | ***72*** | *72* |
| | *зачетных единиц* | ***2*** | *2* |
| Лекции, *академ. час.* | | ***18*** | *18* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* |
| Лабораторные работы, *академ. час.* | | ***0*** | *0* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* |
| Практические занятия, *академ. час.* | | ***18*** | *18* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* |
| Курсовая работа / проект, *академ. час.* | | ***0*** | *0* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* |
| Консультации, *академ. час.* | | ***0*** | *0* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* |
| Самостоятельная работа, *академ. час.* | | ***18*** | *18* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* |
| Контроль, *академ. час.* | | ***18*** | *18* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* |

## Содержание учебной дисциплины

Раздел 1 Экономические основы фондового рынка (Реальный и фиктивный капитал. Происхождение, сущность и формы фиктивного капитала.
Понятие и функции фондового рынка в макро - и микроэкономике. Структура фондового рынка. Классификация фондового рынка. Первичный и вторичный фондовый рынок. Фондовая биржа: основные принципы деятельности.);

Раздел 2 Ценные бумаги и производные финансовые инструменты (Экономическая сущность ценной бумаги. Виды ценных бумаг и доходы от них.
Экономическое содержание производных финансовых инструментов. Виды производных финансовых инструментов);

Раздел 3 Фундаментальный анализ фондового рынка (Основные положения фундаментального анализа, его терминология. Фундаментальные факторы. Индикаторы. Модель случайных (колеблющихся) гипотез. Макроэкономический анализ. Анализ отраслей. Корпоративный анализ.);

Раздел 4 Технический анализ фондового рынка (Основные положения (принципы) технического анализа. Инструменты технического анализа. Графические методы технического анализа. Графики цен.

Модели (фигуры) цен. Количественные методы технического анализа. Индикаторы. Осцилляторы.).

## 5 Перечень тем лекций

| № раздела / темы дисциплины | Темы лекций | Трудоемкость, *академ.час* | |
|---|---|---|---|
| | | **всего** | **в форме практической подготовки** |
| Раздел 1. | Экономические основы фондового рынка | 2 | |
| Раздел 2. | Ценные бумаги и производные финансовые инструменты | 4 | |
| Раздел 3. | Фундаментальный анализ фондового рынка | 6 | |
| Раздел 4. | Технический анализ фондового рынка | 6 | |
| **Итого:** | | **18** | **0** |

## 6 Перечень тем практических занятий (семинаров)

| № раздела / темы дисциплины | Темы практических занятий (семинаров) | Трудоемкость, *академ.час* | |
|---|---|---|---|
| | | **всего** | **в форме практической подготовки** |
| Раздел 1. | Экономические основы фондового рынка | 2 | |
| Раздел 2. | Ценные бумаги и производные финансовые инструменты | 4 | |
| Раздел 3. | Фундаментальный анализ фондового рынка | 6 | |
| Раздел 4. | Технический анализ фондового рынка | 6 | |
| **Итого:** | | **18** | **0** |

## 7 Перечень тем лабораторных работ

| № раздела / темы дисциплины | Темы лабораторных работ | Трудоемкость, *академ.час* | |
|---|---|---|---|
| | | **всего** | **в форме практической подготовки** |
| | *Отсутствуют* | | |
| **Итого:** | | **0** | **0** |

## 8 Перечень тем курсовых работ (проектов)

| № раздела / темы дисциплины | Темы курсовых работ (проектов) | Трудоемкость, *академ.час* | |
|---|---|---|---|
| | | **всего** | **в форме практической** |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | | **подготовки** |
| | *Отсутствуют* | | |
| **Итого:** | | **0** | **0** |

## 9 Виды самостоятельной работы

| **№ раздела / темы дисциплины** | **Виды самостоятельной работы** | **Трудоемкость, *академ.час*** | |
|---|---|---|---|
| | | **всего** | **в форме практической подготовки** |
| Раздел 1. | 1. Изучение лекционного материала;<br>2. Подготовка к практическому занятию;<br>3. Прохождение тестирования. | 4 | |
| Раздел 2. | 1. Изучение лекционного материала;<br>2. Подготовка к практическому занятию;<br>3. Прохождение тестирования. | 4 | |
| Раздел 3. | 1. Изучение лекционного материала;<br>2. Подготовка к практическому занятию;<br>3. Прохождение тестирования. | 5 | |
| Раздел 4. | 1. Изучение лекционного материала;<br>2. Подготовка к практическому занятию;<br>3. Прохождение тестирования. | 5 | |
| *Контроль* | *Подготовка к экзамену* | 18 | |
| **Итого:** | | **36** | **0** |

## 10 Учебно-методическое и информационное обеспечение учебной дисциплины

### а) литература:

1 Гусева, И. А. Финансовые рынки и институты : учебник и практикум для вузов. – 2-е изд., пер. и доп. – Москва : Юрайт, 2024. – 344 с. – ISBN 978-5-534-16872-3. – URL: https://urait.ru/bcode/536731 (дата обращения: 21.03.2024);

2 Михайленко, М. Н. Рынок ценных бумаг : учебник и практикум для вузов. – 3-е изд., пер. и доп. – Москва : Юрайт, 2024. – 340 с. – ISBN 978-5-534-16066-6. – URL: https://urait.ru/bcode/536458 (дата обращения: 21.03.2024);

3 Алехин, Б. И. Рынок ценных бумаг : учебник и практикум для вузов. – 2-е изд., испр. и доп. – Москва : Юрайт, 2024. – 497 с. – ISBN 978-5-534-05683-9. – URL: https://urait.ru/bcode/538065 (дата обращения: 21.03.2024);

4 Гусева, И. А. Рынок ценных бумаг и производных финансовых инструментов : учебник и практикум для вузов. – 2-е изд. – Москва : Юрайт, 2024. – 224 с. – ISBN 978-5-534-17249-2. – URL: https://urait.ru/bcode/545005 (дата обращения: 21.03.2024).

**б) ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:**

1 Консультант студента : электронно-библиотечная система / ООО «КОНСУЛЬТАНТ СТУДЕНТА». – Москва, [200 – ]. – URL: http://www.studentlibrary.ru. – Режим доступа: для авторизир. пользователей;

2 ЛАНЬ : электронно-библиотечная система : [коллекция «Инженерно-технические науки»] / ООО «Издательство ЛАНЬ». – Санкт-Петербург, [200 – ]. – URL: http://e.lanbook.com. – Режим доступа: для авторизир. пользователей;

3 НАУЧНАЯ ЭЛЕКТРОННАЯ БИБЛИОТЕКА eLIBRARY.RU : база данных / ООО «НЭБ». – Москва, [200 – ]. – URL: http://elibrary.ru. – Режим доступа: по подписке;

4 Образовательная платформа ЮРАЙТ / ООО «Электронное издательство ЮРАЙТ». – Москва, [200 – ]. – URL: https://urait.ru. – Режим доступа: для авторизир. пользователей;

5 Университетская библиотека онлайн : электронно-библиотечная система / ООО «Директ-Медиа». – Москва, [200 – ]. – URL: https://biblioclub.ru. – Режим доступа: для авторизир. пользователей. – URL: http://www.biblioclub.ru;

6 Электронная библиотека // Научно-техническая библиотека СибГИУ : сайт. – Новокузнецк, [200 – ]. – URL: http://library.sibsiu.ru/LibrELibraryFullText.asp. – Режим доступа: для авторизир. пользователей. – URL: https://library.sibsiu.ru/LibrELibraryFullText.asp;

7 Электронный каталог : сайт / Научно-техническая библиотека СибГИУ. – Новокузнецк, [199 – ]. – URL: http://libr.sibsiu.ru. – URL: https://libr.sibsiu.ru.

**в) лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение:**

– ABBYY FineReader;
– Adobe Acrobat Reader;
– Astra Linux Special Edition;
– Microsoft Office;
– Microsoft Windows;
– Электронный периодический справочник Система ГАРАНТ.

**г) базы данных и информационно-справочные системы:**

1 ГАРАНТ : справочно-правовая система / ООО «Правовой центр «Гарант». – Кемерово, [200 – ]. – Режим доступа: компьютерная сеть Сиб. гос. индустр. ун-та.;

2 КонсультантПлюс : справочно-правовая система / ООО «Информационный центр АНВИК». – Новокузнецк, [199 – ]. – Режим доступа: компьютерная сеть библиотеки Сиб. гос. индустр. ун-та.;

3 Техэксперт : информационно-справочная система / ООО «Группа компаний «Кодекс». – Кемерово, [200 – ]. – Режим доступа: компьютерная сеть Сиб. гос. индустр. ун-та.

## 11 Материально-техническое обеспечение учебной дисциплины

Материально-техническое обеспечение учебной дисциплины включает учебные аудитории, оснащенные оборудованием, компьютерной техникой, и техническими средствами обучения, в том числе:

- учебную аудиторию для проведения занятий лекционного типа, оборудованную учебной доской, экраном и мультимедийным проектором;
- учебную аудиторию для проведения занятий семинарского типа (практических занятий), оснащенную учебной доской, компьютерами, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, помещения для самостоятельной работы, оснащенные компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду, научно-техническую библиотеку СибГИУ.

Рабочая программа дисциплины составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки (специальности) 38.03.01 «Экономика».

Составитель(и):

доцент Шипунова Вера Васильевна (кафедра экономики, учета и финансов. АО Кузнецкбизнесбанк).

Рабочая программа дисциплины рассмотрена и утверждена на заседании кафедры.

**Приложение**

**Аннотация**
**рабочей программы дисциплины «Аналитика фондового рынка»**

**по направлению подготовки (специальности)**
**38.03.01 «Экономика»**
**(направленность (профиль): «Экономика и устойчивое развитие»)**
**форма обучения – Очная форма**

**1 Цели и задачи освоения учебной дисциплины**

Целями учебной дисциплины являются:

– Целью дисциплины является формирование у обучающихся целостного представления о ценных бумагах, современных подходов к анализу фондового рынка.

Задачами учебной дисциплины являются:

– изучение основных финансовых инструментов фондового рынка;
– выработка системного понимания фондового рынка;
– овладение навыками работы с финансовой информацией, основными индикаторами экономической статистики, публикуемыми информационными агентствами, центральными банками и правительствами, а также данными финансовой корпоративной отчетности.;
– изучение основных подходов к анализу фондового рынка.

**2 Место учебной дисциплины в структуре ООП по направлению подготовки (специальности)**

Учебная дисциплина относится к учебным дисциплинам части, формируемой участниками образовательных отношений **Блока 1 «Дисциплины (модули)»** ООП по направлению подготовки (специальности) 38.03.01 «Экономика».

Учебная дисциплина базируется на предварительном усвоении обучающимися учебных дисциплин:

– Финансы, денежное обращение и кредит;
– Инвестиционная деятельность организации;
– Разработка и оценка эффективности инвестиционного проекта организации;
– Антикризисное управление финансами;
– Финансовый менеджмент;
– Личные финансы.

Учебная дисциплина дополняет знания и умения, получаемые по одновременно изучаемым и последующим учебным дисциплинам:

– Оптимизация, оценка эффективности и устойчивости бизнес-процессов;

– Анализ и диагностика финансово-хозяйственной деятельности организации;
– Комплексный экономический анализ;
– Подготовка к сдаче и сдача государственного экзамена;
– Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы.

## 3 Планируемые результаты обучения по учебной дисциплине

Процесс изучения учебной дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

### – Профессиональные компетенции

| Наименование категории (группы) ПК | Код и наименование ПК | Код и наименование индикатора достижения ПК | Планируемые результаты обучения |
|---|---|---|---|
| | ПК-1: Способен провести сбор, мониторинг и обработку данных для проведения расчетов экономических показателей организации | ПК-1.1 Собирает данные для составления проектов финансово-хозяйственной, производственной и коммерческой деятельности организации | – знать: способы сбора данных для составления проектов финансово-хозяйственной, производственной и коммерческой деятельности организации.<br>– уметь: формировать и собирать данные для составления проектов финансово-хозяйственной, производственной и коммерческой деятельности предприятия. |
| | | ПК-1.2 Проводит мониторинг изменения данных для проведения расчетов экономических показателей организации | – знать: методы и способы проведения мониторинга изменения данных для проведения расчетов экономических показателей организации.<br>– уметь: проводить мониторинг изменения данных для проведения расчетов экономических показателей организации. |

## 4 Объем учебной дисциплины

| Семестр / курс | | ***ИТОГО*** | ***8 семестр*** |
|---|---|---|---|
| Форма промежуточной аттестации | | | *экзамен* |
| Трудоёмкость | *академ. час.* | ***72*** | *72* |
| | *зачетных единиц* | ***2*** | *2* |
| Лекции, *академ. час.* | | ***18*** | *18* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* |
| Лабораторные работы, *академ. час.* | | ***0*** | *0* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* |
| Практические занятия, *академ. час.* | | ***18*** | *18* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* |
| Курсовая работа / проект, *академ. час.* | | ***0*** | *0* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* |
| Консультации, *академ. час.* | | ***0*** | *0* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* |
| Самостоятельная работа, *академ. час.* | | ***18*** | *18* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* |
| Контроль, *академ. час.* | | ***18*** | *18* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* |

**5 Краткое содержание учебной дисциплины**

В структуре учебной дисциплины выделяются следующие основные разделы (темы):

Раздел 1 Экономические основы фондового рынка (Реальный и фиктивный капитал. Происхождение, сущность и формы фиктивного капитала.
Понятие и функции фондового рынка в макро - и микроэкономике.
Структура фондового рынка. Классификация фондового рынка.
Первичный и вторичный фондовый рынок. Фондовая биржа: основные принципы деятельности.);

Раздел 2 Ценные бумаги и производные финансовые инструменты (Экономическая сущность ценной бумаги. Виды ценных бумаг и доходы от них.
Экономическое содержание производных финансовых инструментов.
Виды производных финансовых инструментов);

Раздел 3 Фундаментальный анализ фондового рынка (Основные положения фундаментального анализа, его терминология. Фундаментальные факторы. Индикаторы. Модель случайных (колеблющихся) гипотез. Макроэкономический анализ. Анализ отраслей. Корпоративный анализ.);

Раздел 4 Технический анализ фондового рынка (Основные положения (принципы) технического анализа. Инструменты технического анализа. Графические методы технического анализа. Графики цен. Модели (фигуры) цен. Количественные методы технического анализа. Индикаторы. Осцилляторы.).

**6 Составитель(и):**

доцент Шипунова Вера Васильевна (кафедра экономики, учета и финансов. АО Кузнецкбизнесбанк).