Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Крылова Людмила Вячеславовна
Должность: Проректор по учебно-методической работе
Дата подписания: 13.11.2026 22:08:39
Уникальный программный ключ:
b066544bae1e449cd8bfce392f7224a676a271b2

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Донецкий национальный университет экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского»

КАФЕДРА БАНКОВСКОГО ДЕЛА

УТВЕРЖДАЮ

Проректор по учебно-методической работе

_____ Л. В. Крылова

(подпись) (фамилия, инициалы)

«03» 02 2026 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
Б1.В.ДВ.11.02 АНАЛИЗ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

(шифр, название дисциплины)

Укрупненная группа направлений подготовки	38.00.00 Экономика и управление (код, наименование)
Образовательная программа высшего образования	программа бакалавриата
Направление подготовки	38.03.01 Экономика (код, наименование)
Институт	учета и финансов
Профиль	Банковское дело (код, наименование)
Форма обучения, курс	очная форма обучения, 4 курс очно-заочная форма обучения, 5 курс

Рабочая программа адаптирована для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Донецк
2026

Рабочая программа дисциплины «Анализ финансовых рынков» для обучающихся по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, профилю: Банковское дело, разработанная в соответствии с ОПОП ВО, для набора обучающихся 2026 г.

Разработчик: Пятаченко Анна Максимовна, доцент кафедры банковского дела

Рабочая программа утверждена на заседании кафедры банковского дела

Протокол от 10 февраля №11

Заведующий кафедрой банковского дела

_____ И. В. Попова
(подпись) (фамилия, инициалы)

СОГЛАСОВАНО

Директор института учета и финансов

_____ Л. И. Тымчина
(подпись) (фамилия, инициалы)

«24 » февраля 2026 года

ОДОБРЕНО

Учебно-методическим советом ФГБОУ ВО «ДОННУЭТ»

Протокол от «25» марта 2026 года № 8

Председатель_____ Л.В. Крылова
(подпись) (фамилия, инициалы)

© Пятаченко А.М., 2026 год
© Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Донецкий национальный университет экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского», 2026 год

1. ОПИСАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

<table>
<tr><td rowspan="2">Наименование показателя</td><td rowspan="2">Наименование укрупненной группы направлений подготовки, направление подготовки, профиль, программа высшего образования</td><td colspan="2">Характеристика дисциплины</td></tr>
<tr><td>очная форма обучения</td><td>очно-заочная форма обучения</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Количество зачетных единиц – 2</td><td>Укрупненная группа направлений подготовки

38.00.00 Экономика и управление
(код, название)</td><td colspan="2" rowspan="2">Часть, формируемая участниками образовательных отношений</td></tr>
<tr><td>Направление подготовки

38.03.01 Экономика
(код, название)</td></tr>
<tr><td>Модулей – 1</td><td rowspan="4">Профиль:

Банковское дело
(название)</td><td colspan="2">Год подготовки</td></tr>
<tr><td>Смысловых модулей – 3</td><td>4-й</td><td>5-й</td></tr>
<tr><td rowspan="3">Общее количество часов – 72</td><td colspan="2">Семестр</td></tr>
<tr><td>5-й</td><td>6-й</td></tr>
<tr><td colspan="2">Лекции</td></tr>
<tr><td rowspan="8">Количество часов в неделю для очной формы обучения:
аудиторных – 2;
самостоятельной работы обучающегося – 3</td><td rowspan="8">Программа высшего образования – программа бакалавриата</td><td>10 часов</td><td>10 часов</td></tr>
<tr><td colspan="2">Практические, семинарские занятия</td></tr>
<tr><td>18 часов</td><td>18 часов</td></tr>
<tr><td colspan="2">Лабораторные занятия</td></tr>
<tr><td>–</td><td>–</td></tr>
<tr><td colspan="2">Самостоятельная работа</td></tr>
<tr><td>43,25 часа</td><td>42,75 часа</td></tr>
<tr><td colspan="2">Форма промежуточной аттестации:</td></tr>
<tr><td>Зачет</td><td>Зачет</td></tr>
</table>

Соотношение количества часов аудиторных занятий и самостоятельной работы составляет:
для очной формы обучения – 28 / 43,25;
для очно-заочной формы обучения – 28 / 42,75.

2. ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель дисциплины:

сформировать у обучающихся целостное понимание механизмов функционирования финансовых рынков и дать практические навыки управления инвестициями.

Задачи дисциплины:

изучить ключевые понятия и сегменты финансовых рынков (фондовый, срочный, валютный и др.); разобраться в принципах функционирования рынков и роли их участников; ознакомиться с законодательными и регуляторными основами финансовых рынков; освоить основные и производные финансовые инструменты (акции, облигации, фьючерсы, опционы и др.); овладеть методиками фундаментального и технического анализа; научиться применять математические и статистические методы для количественной оценки рыночных процессов; рассчитывать показатели эффективности и риска финансовых операций (доходность, волатильность, VaR и др.); формировать и оптимизировать инвестиционные портфели; анализировать рыночные данные с использованием специализированного ПО (например, пакетов статистического анализа); разрабатывать стратегии управления рисками и хеджирования; оценивать текущую ситуацию на рынках и прогнозировать её развитие; принимать обоснованные инвестиционные решения на микро- и макроуровне; использовать аналитические материалы для разработки экономических прогнозов и стратегий; изучить модели ценообразования финансовых активов; понять особенности глобализации и секьюритизации рынков; ознакомиться с методами анализа внешней и внутренней среды для экономических расчётов.

3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП ВО

Дисциплина Б1.В.ДВ.11.02 Анализ финансовых рынков относится к части ОПОП ВО, формируемой участниками образовательных отношений.

Учебная дисциплина Б1.В.ДВ.11.02 Анализ финансовых рынков относится к профессиональному циклу вариативной части ОПОП.

Требования к «входным» знаниям, умениям и готовностям обучающегося, необходимые при освоении данной дисциплины и приобретенным в результате освоения предшествующих дисциплин – удовлетворительное усвоение программ по указанным выше дисциплинам.

Дисциплины, для которых освоение данной дисциплины необходимо как предшествующее: «Конфликтология, корпоративная культура и профессиональная этика в банковском деле», «Банковское дело», «Центральный банк и денежно-кредитная политика», «Инновационные технологии банковского обслуживания», «Банковские продукты и услуги», «Современные платежные системы», «Денежно-кредитные системы зарубежных стран», «Международный рынок банковских услуг и тенденции его развития» и др.

4. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ, СООТНЕСЕННЫХ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

В результате освоения дисциплины у обучающегося должны быть сформированы компетенции и индикаторы их достижения:

Код и наименование компетенции	*Код и наименование индикатора достижения компетенции*
УК-10. Способен принимать обоснованные экономические решения в различных областях жизнедеятельности	ИДК-1УК-10 Понимает базовые принципы функционирования экономики, цели и механизмы основных видов социально-экономической политики и ее влияние на индивида.
ПК-9. Способен осуществлять мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты с целью консультирования клиентов по использованию	ИДК-1$_{ПК-9}$ Осуществляет сбор, обработку и анализ информации о состоянии финансового рынка, изучает спрос и предложения на рынке финансовых услуг.

финансовых продуктов и услуг	ИДК-3$_{ПК-9}$ Составляет аналитические заключения, рейтинги, прогнозы с целью предотвращения сделок с недобросовестными партнерами

В результате изучения дисциплины обучающийся должен:

знать: основные сегменты финансовых рынков (фондовый, валютный, долговой, срочный, товарный) и их взаимосвязи; ключевые участники рынков и их функции (эмитенты, инвесторы, брокеры, дилеры, регуляторы); базовые финансовые инструменты: акции и облигации; производные инструменты (фьючерсы, опционы, свопы); валютные пары и депозитарные расписки; принципы ценообразования финансовых активов и модели оценки (CAPM, APT, Блэка-Шоулза и др.); методы фундаментального анализа: макроэкономические индикаторы; анализ отраслевых и корпоративных отчётов; оценка финансовой устойчивости и рентабельности компаний; методы технического анализа: графические паттерны; индикаторы (скользящие средние, RSI, MACD и др.); волновые теории; основы риск-менеджмента: виды рисков, методы их идентификации и количественной оценки (VaR, стресс-тестирование); нормативно-правовую базу регулирования финансовых рынков (в т. ч. требования к раскрытию информации, правила биржевой торговли); современные тенденции и технологии на финансовых рынках (алгоритмическая торговля, Big Data, ИИ в анализе); международные стандарты финансовой отчётности (МСФО/GAAP) в контексте анализа рынков.

уметь: собирать и систематизировать рыночные данные (котировки, объёмы, новостной фон); проводить фундаментальный анализ компании: рассчитывать и интерпретировать финансовые коэффициенты (P/E, P/B, ROE, Debt/EBITDA и др.); строить прогнозы доходов и денежных потоков; выполнять технический анализ: выявлять тренды и уровни поддержки/сопротивления; применять индикаторы для генерации торговых сигналов; оценивать стоимость финансовых инструментов: дисконтировать денежные потоки (DCF); использовать сравнительные мультипликаторы; моделировать опционы; рассчитывать показатели риска и доходности портфеля: ожидаемая доходность, стандартное отклонение, бета-коэффициент; коэффициенты Шарпа, Трейнора, Сортино; формировать инвестиционные стратегии с учётом: горизонта инвестирования; толерантности к риску; рыночных условий.

владеть: навыками работы с источниками рыночной информации: биржевые терминалы (QUIK, MetaTrader); базы данных (Bloomberg, Reuters, CBonds); официальные отчёты компаний и регуляторов; методами количественного анализа: корреляционный и регрессионный анализ; моделирование временных рядов (ARIMA, GARCH); сценарное моделирование и симуляции (Monte Carlo); инструментами портфельного управления: оптимизация по Марковицу; диверсификация по классам активов; ребалансировка портфеля; техниками риск-менеджмента: расчёт VaR и Expected Shortfall; хеджирование позиций с помощью деривативов; установка стоп-лоссов и тейк-профитов; программными средствами: Excel (формулы, сводные таблицы, надстройки для финансов); Python/R (библиотеки для анализа данных: pandas, numpy, quantmod); специализированные пакеты (EViews, STATA); навыками визуализации данных: построение графиков цен и индикаторов; создание дашбордов для мониторинга портфеля; методами коммуникации результатов анализа.

5. ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

МОДУЛЬ 1. АНАЛИЗ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

Смысловой модуль 1 Основы финансового анализа

Тема 1. Виды и особенности составляющих финансового рынка

Тема 2. Макроэкономические основы финансовых рынков

Тема 3. Фундаментальный анализ

Смысловой модуль 2 Показатели финансового анализа

Тема 4. Фундаментальный анализ экономических отраслей и показателей развития компаний

Тема 5. Технический анализ и гипотеза эффективности рынков

Тема 6. Графики в техническом анализе
Тема 7. Основные принципы анализа осцилляторов

6. СТРУКТУРА ДИСЦИПЛИНЫ

Название смысловых модулей и тем	Количество часов											
	очная форма обучения						очно-заочная форма обучения					
	всего	в том числе					всего	в том числе				
		л	п	лаб	инд	СРС		л	п	лаб	инд	СРС
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
МОДУЛЬ 1. АНАЛИЗ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ												
Смысловой модуль 1 Основы финансового анализа												
Тема 1. Виды и особенности составляющих финансового рынка	9	1	2			6	9	1	2			6
Тема 2. Макроэкономические основы финансовых рынков	9	1	2			6	9	1	2			6
Тема 3. Фундаментальный анализ	9	1	2			6	9	1	2			6
Итого по смысловому модулю 1	***27***	***3***	***6***			***18***	***27***	***3***	***6***			***18***
Смысловой модуль 2 Показатели финансового анализа												
Тема 4. Фундаментальный анализ экономических отраслей и показателей развития компаний	10	1	3			6	10	1	3			6
Тема 5. Технический анализ и гипотеза эффективности рынков	11	2	3			6	11	2	3			6
Тема 6. Графики в техническом анализе	11	2	3			6	11	2	3			6
Тема 7. Основные принципы анализа осцилляторов	12,25	2	3			7,25	11,75	2	3			6,75
Итого по смысловому модулю 2	***44,25***	***7***	***12***			***25,25***	***43,75***	***7***	***12***			***24,75***
Катт	**0,5**						**1**					
Каттэк	**0,25**						**0,25**					
Всего часов	**72**	**10**	**18**			**43,25**	**72**	**10**	**18**			**42,75**

Примечания: 1. л – лекции;
2. п – практические (семинарские) занятия;
3. лаб – лабораторные занятия;
4. СР – самостоятельная работа;
5. Пр – прочие виды работы (ИК, Катт, КЭ, Каттэк);
6. ИК – индивидуальные консультации;
7. Катт – контактная работа на аттестацию в период теоретического обучения;
8. КЭ – консультации перед экзаменом;
9. Каттэк – контактная работа на аттестацию в период экзаменационных сессий.

7. ТЕМЫ СЕМИНАРСКИХ И ПРАКТИЧЕСКИХ ЗАНЯТИЙ

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	очно-заочная форма
1	Виды и особенности составляющих финансового рынка	2	2
2	Макроэкономические основы финансовых рынков	2	2
3	Фундаментальный анализ	2	2
4	Фундаментальный анализ экономических отраслей и показателей развития компаний	3	3
5	Технический анализ и гипотеза эффективности рынков	3	3
6	Графики в техническом анализе	3	3
7	Основные принципы анализа осцилляторов	3	3
Всего:		18	18

8. ТЕМЫ ЛАБОРАТОРНЫХ ЗАНЯТИЙ

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	очно-заочная форма
1	не предусмотрены учебным планом		

9. САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	очно-заочная форма
1	Виды и особенности составляющих финансового рынка	6	6
2	Макроэкономические основы финансовых рынков	6	6
3	Фундаментальный анализ	6	6
4	Фундаментальный анализ экономических отраслей и показателей развития компаний	6	6
5	Технический анализ и гипотеза эффективности рынков	6	6
6	Графики в техническом анализе	6	6
7	Основные принципы анализа осцилляторов	7,25	6,75
Всего:		43,25	42,75

10. ОБЕСПЕЧЕНИЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ДЛЯ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ И ИНВАЛИДОВ

В ходе реализации учебной дисциплины используются такие дополнительные методы обучения, текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся в зависимости от их индивидуальных особенностей:

1) для слепых и слабовидящих:

– лекции оформляются в виде электронного документа, доступного с помощью компьютера со специализированным программным обеспечением;

– письменные задания оформляются увеличенным шрифтом или могут быть заменены устным ответом;

– при необходимости предоставляется увеличивающее устройство; возможно также использование собственных увеличивающих устройств;

2) для глухих и слабослышащих:

– лекции оформляются в виде электронного документа, либо предоставляется звукоусиливающая аппаратура индивидуального пользования;

– письменные задания выполняются на компьютере в письменной форме;

– зачет проводится в письменной форме на компьютере; возможно проведение в форме тестирования с использованием дистанционной системы Moodle.

3) для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

– лекции оформляются в виде электронного документа, доступного с помощью компьютера со специализированным программным обеспечением;

– письменные задания выполняются на компьютере со специализированным программным обеспечением

– зачет проводится в устной форме или выполняется в письменной форме на компьютере.

При необходимости предусматривается увеличение времени для подготовки ответа.

Процедура проведения зачета для обучающихся устанавливается с учётом их индивидуальных психофизических особенностей.

Зачет может проводиться в несколько этапов.

При проведении процедуры оценивания результатов обучения предусматривается использование технических средств, необходимых в связи с индивидуальными особенностями обучающихся. Технические средства могут быть предоставлены ФГБОУ ВО «ДОННУЭТ», а также могут использоваться собственные технические средства.

Проведение процедуры оценивания результатов обучения допускается с использованием дистанционных образовательных технологий.

Обеспечивается доступ к информационным и библиографическим ресурсам в информационно-телекоммуникационной сети Интернет для каждого обучающегося в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

1) для слепых и слабовидящих:

– в печатной форме увеличенным шрифтом;

– в форме электронного документа;

– в форме аудиофайла;

2) для глухих и слабослышащих:

– в печатной форме;

– в форме электронного документа;

3) для обучающихся с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

– в печатной форме;

– в форме электронного документа;

– в форме аудиофайла.

11. СИСТЕМА ОЦЕНИВАНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Система оценивания по учебной дисциплине в очной форме обучения[1]

Форма контроля	**Макс. количество баллов**	
	За одну работу	**Всего**
Текущий контроль:		
- дискуссия, собеседование (темы 1–7)	5	35
- реферат, доклад (темы 1–7)	5	35
- тестирование (темы 1, 2, 3)	5	30
Промежуточная аттестация	*зачет*	*100/60*
Итого за семестр	*100*	

Примечание. В соответствии с утвержденными оценочными материалами по дисциплине

Система оценивания по учебной дисциплине в очно-заочной форме обучения

Форма контроля	**Макс. количество баллов**	
	За одну работу	**Всего**
Текущий контроль:		
- дискуссия, собеседование (темы 1–7)	5	35
- реферат, доклад (темы 1–7)	5	35
- тестирование (темы 1, 2, 3)	5	30
Промежуточная аттестация	*зачет*	*100/60*
Итого за семестр	*100*	

Вопросы для подготовки к зачету:

1. Виды и особенности составляющих финансового рынка.
2. Введение в теорию финансовых рынков.
3. Фундаментальные понятия рынка ценных бумаг.
4. Характерные черты международного финансового рынка.
5. Виды финансовых рынков.
6. Макроэкономические основы финансовых рынков.
7. Макроэкономические показатели национальных счетов.
8. Макроэкономические показатели уровня цен.
9. Источники макроэкономической нестабильности: инфляция и безработица.
10. Регулирование макроэкономического равновесия на рынке товаров и услуг.
11. Фискальная политика. Кредитно-финансовая система современной экономики. Денежно-кредитная политика.
12. Фундаментальный анализ
13. Необходимость фундаментального анализа.
14. Понятие «экономических циклов» и политика государства. Факторы влияющие на рынок. Классификация макроэкономических показателей фундаментального анализа.
15. Общий подход к классификации показателей.
16. Макроэкономические показатели первой группы, макроэкономические показатели второй группы, макроэкономические показатели третьей группы. Политические факторы.
17. Влияние ожиданий на формирование тенденций на валютном рынке.
18. Фундаментальный анализ экономических отраслей и показателей развития компаний.
19. Анализ экономических отраслей.
20. Корпоративный анализ.
21. Достоинства и недостатки фундаментального анализа.
22. Технический анализ и гипотеза эффективности рынков.
23. Сущность технического анализа.
24. Теория Доу.
25. Индексы, тренды. Основные направления технического анализа.
26. Графики в техническом анализе.
27. Линейные графики, графики в виде «баров», графики эквивалентных объёмов, японские свечи, графики объёмных свечей, гистограммы.
28. Тренды. Определение тренда по Доу. Линии ДеМарка. Использование линий тренда и линий каналов для анализа рынков.
29. Скользящие средние. Графические модели.
30. Основные принципы анализа осцилляторов.
31. Осциллятор двойной скользящей средней.
32. Индекс относительной силы.
33. Стохастический осциллятор. Осциллятор Уильямса.
34. Индикаторы направления движения. Циклы в техническом анализе.
35. Временные рыночные циклы. Параметры циклов.
36. Основные этапы циклического анализа данных.
37. Использование результатов анализа временных циклов.
38. Волновая теория Эллиота. Основные принципы теории. Структура и соотношение волн.

12. РАСПРЕДЕЛЕНИЕ БАЛЛОВ, КОТОРЫЕ ПОЛУЧАЮТ ОБУЧАЮЩИЕСЯ

Текущее тестирование и самостоятельная работа							Сумма в баллах
Смысловой модуль № 1	Смысловой модуль № 2		Смысловой модуль № 3				
Т1	Т2	Т3	Т4	Т5	Т6	Т7	100
10	10	10	10	20	20	20	

Примечание. Т1, Т2, ... Т7 – номера тем соответствующих смысловых модулей

Государственная шкала оценивания академической успеваемости

Сумма баллов за все виды учебной деятельности	По государственной шкале
60-100	«зачтено»
менее 60	«не зачтено»

13. РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА

Основная литература:

Мэрфи, Д. Межрыночный анализ: Принципы взаимодействия финансовых рынков / Д. Мэрфи. — Москва : Альпина Паблишер, 2016. — 299 с. — ISBN 978-5-9614-1707-4.

Нисон, С. Японские свечи : Графический анализ финансовых рынков / С. Нисон. — Москва : Альпина Паблишер, 2016. — 292 с. — ISBN 978-5-9614-5231-0.

Дополнительная литература:

Шитов, В. Н. Банковское дело : учебное пособие / В. Н. Шитов. — Ульяновск : Ульяновский государственный технический университет, 2022. — 127 с. — ISBN 978-5-9795-2202-9. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/121264.html (дата обращения: 23.08.2024). — Режим доступа: для авторизир. Пользователей

Плохих, Ю. В. Банковское дело : учебное пособие / Ю. В. Плохих. — Омск : Омский государственный технический университет, 2023. — 97 с. — ISBN 978-5-8149-3612-7. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/140827.html (дата обращения: 23.08.2024). — Режим доступа: для авторизир. пользователей

Методическое обеспечение учебной дисциплины:

Василенко, В.Н. История развития банковского дела [Электронный ресурс] : методические рекомендации для проведения практических и семинарских занятий для обучающихся института учета и финансов, укрупненная группа 38.00.00 «Экономика и управление», 38.03.01 Экономика (профиль: Банковское дело), очной и заочной форм обучения / В. Н. Василенко ; Министерство образования и науки Донецкой Народной Республики, ГО ВПО "Донецкий национальный университет экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского", Кафедра банковского дела. - Донецк : ДОННУЭТ, 2021. - Локальная компьютерная сеть НБ ДОННУЭТ. - Системные требования: ПК с процессором; MS Windows 2000. - Загл. с тит. экрана.

Василенко, В.Н. История развития банковского дела [Электронный ресурс] : конспект лекций по курсу для обучающихся направления подготовки 38.03.01 Экономика, профиль: Банковское дело, очной и заочной форм обучения / В. Н. Василенко ; Министерство образования и науки Донецкой Народной Республики, ГО ВПО "Донецкий национальный университет экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского", Кафедра банковского дела. - Донецк : ДОННУЭТ, 2021. - Локальная компьютерная сеть НБ ДОННУЭТ. - Системные требования: ПК с процессором; MS Windows 2000. - Загл. с тит. экрана.

14. ИНФОРМАЦИОННЫЕ РЕСУРСЫ

1. Автоматизированная библиотечная информационная система Unilib UC : версия 2.110 // Научная библиотека Донецкого национального университета экономики и торговли им. Михаила Туган-Барановского. – [Донецк, 2021–]. – Текст : электронный.
2. Информио : электрон. справочник / ООО «РИНФИЦ». – Москва : Издат. дом «Информио», [2018?–]. – URL: https://www.informio.ru (дата обращения: 01.01.2023). – Текст : электронный.
3. IPR SMART : весь контент ЭБС Ipr books : цифровой образоват. ресурс / ООО «Ай Пи Эр Медиа». – [Саратов : Ай Пи Эр Медиа, 2022]. – URL: http://www.iprbookshop.ru (дата обращения: 01.01.2023). – Режим доступа: для авториз. пользователей. – Текст. Аудио. Изображения : электронные.

4. Лань : электрон.-библ. система. – Санкт-Петербург : Лань, cop. 2011–2021. – URL: https://e.lanbook.com/ (дата обращения: 01.01.2023). – Текст : электронный. – Режим доступа: для авторизир. пользователей.

5. СЭБ : Консорциум сетевых электрон. б-к / Электрон.-библ. система «Лань» при поддержке Агентства стратег. инициатив. – Санкт-Петербург : Лань, cop. 2011–2021. – URL: https://seb.e.lanbook.com/ (дата обращения: 01.01.2023). – Режим доступа : для пользователей организаций – участников, подписчиков ЭБС «Лань».

6. Polpred : электрон. библ. система : деловые статьи и интернет-сервисы / ООО «Полпред Справочники». – Москва : Полпред Справочники, cop. 1997–2022. – URL: https://polpred.com (дата обращения: 01.01.2023). – Текст : электронный.

7. Book on lime : дистанц. образование / изд-во КДУ МГУ им. М.В. Ломоносова. – Москва : КДУ, cop. 2017. – URL: https://bookonlime.ru (дата обращения: 01.01.2023) – Текст . Изображение. Устная речь : электронные.

8. Научная электронная библиотека elibrary.ru : информ.-аналит. портал / ООО Научная электронная библиотека. – Москва : ООО Науч. электрон. б-ка, cop. 2000–2022. – URL: https://elibrary.ru (дата обращения: 01.01.2023). – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. – Текст : электронный.

9. cyberleninka : науч. электрон. б-ка «КиберЛенинка» / [Е. Кисляк, Д. Семячкин, М. Сергеев ; ООО «Итеос»]. – Москва : КиберЛенинка, 2012– . – URL: http://cyberleninka.ru (дата обращения: 01.01.2023). – Текст : электронный.

10. Национальная электронная библиотека : НЭБ : федер. гос. информ. система / М-во культуры Рос. Федерации [и др.]. – Москва : Рос. гос. б-ка : ООО ЭЛАР, [2008–]. – URL: https://rusneb.ru/ (дата обращения: 01.01.2023) – Текст. Изображение : электронные.

11. Научно-информационный библиотечный центр имени академика Л.И. Абалкина / Рос. экон. ун-т им. В.Г. Плеханова. – Москва: KnowledgeTree Inc., 2008– . – URL: http://liber.rea.ru/login.php (дата обращения: 01.01.2023). – Режим доступа: для авторизир. пользователей. – Текст : электронный.

12. Библиотечно-информационный комплекс / Финансовый ун-т при Правительстве Рос. Федерации. – Москва: Финансовый университет, 2019– . – URL: http://library.fa.ru/ (дата обращения: 01.01.2023) – Режим доступа: для авторизир. пользователей. – Текст : электронный.

13. Университетская библиотека онлайн : электрон. библ. система. – ООО «Директ-Медиа», 2006– . – URL: https://biblioclub.ru/ (дата обращения: 01.01.2023) – Режим доступа: для авторизир. пользователей. – Текст : электронный.

14. Электронный каталог Научной библиотеки Донецкого национального университета экономики и торговли им. Михаила Туган-Барановского. – Донецк : НБ ДОННУЭТ, 1999–. – URL: http://catalog.donnuet.education (дата обращения: 01.01.2023). – Текст : электронный.

15. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Минимально необходимый для реализации ОПОП бакалавриата перечень материально-технического обеспечения включает аудиторный фонд в соответствии с утвержденным расписанием с использованием мультимедийного демонстрационного комплекса кафедры международной экономики (проектор, ноутбук).

16. КАДРОВОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Ф.И.О. педагогического (научно-педагогического) работника, участвующего в реализации образовательной программы	Условия привлечения (по основному месту работы, на условиях внутреннего/ внешнего совместительства; на условиях договора гражданско-правового характера (далее – договор ГПХ)	Должность, ученая степень, ученое звание	Уровень образования, наименование специальности, направления подготовки, наименование присвоенной квалификации	Сведения о дополнительном профессиональном образовании[1]
Пятаченко Анна Максимовна	По совместительству	Должность – доцент кафедры банковского дела, ученая степень – отсутствует, ученое звание – отсутствует	Высшее, специальность: экономика, экономика предприятия, магистр по экономике предприятия	1. Удостоверение о повышении квалификации, Регистрационный номер и№ 1-27863 от 10.10.2024г. «Научно-технологическое развитие Российской Федерации в области информационных технологий», 36 часов, Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Донской государственный технический университет», г. Ростов-на-Дону, Российская Федерация.

Примечание. За последние 3 года.

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ
Б1.В.ДВ.11.02 АНАЛИЗ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

(шифр и наименование дисциплины)

Направление подготовки 38.03.01 Экономика
(код и наименование)

Профиль: Банковское дело
(наименование)

Трудоемкость дисциплины: 2 з.е.

Планируемые результаты обучения по дисциплине:

знать: основные сегменты финансовых рынков (фондовый, валютный, долговой, срочный, товарный) и их взаимосвязи; ключевые участники рынков и их функции (эмитенты, инвесторы, брокеры, дилеры, регуляторы); базовые финансовые инструменты: акции и облигации; производные инструменты (фьючерсы, опционы, свопы); валютные пары и депозитарные расписки; принципы ценообразования финансовых активов и модели оценки (CAPM, APT, Блэка-Шоулза и др.); методы фундаментального анализа: макроэкономические индикаторы; анализ отраслевых и корпоративных отчётов; оценка финансовой устойчивости и рентабельности компаний; методы технического анализа: графические паттерны; индикаторы (скользящие средние, RSI, MACD и др.); волновые теории; основы риск-менеджмента: виды рисков, методы их идентификации и количественной оценки (VaR, стресс-тестирование); нормативно-правовую базу регулирования финансовых рынков (в т. ч. требования к раскрытию информации, правила биржевой торговли); современные тенденции и технологии на финансовых рынках (алгоритмическая торговля, Big Data, ИИ в анализе); международные стандарты финансовой отчётности (МСФО/GAAP) в контексте анализа рынков.

уметь: собирать и систематизировать рыночные данные (котировки, объёмы, новостной фон); проводить фундаментальный анализ компании: рассчитывать и интерпретировать финансовые коэффициенты (P/E, P/B, ROE, Debt/EBITDA и др.); строить прогнозы доходов и денежных потоков; выполнять технический анализ: выявлять тренды и уровни поддержки/сопротивления; применять индикаторы для генерации торговых сигналов; оценивать стоимость финансовых инструментов: дисконтировать денежные потоки (DCF); использовать сравнительные мультипликаторы; моделировать опционы; рассчитывать показатели риска и доходности портфеля: ожидаемая доходность, стандартное отклонение, бета-коэффициент; коэффициенты Шарпа, Трейнора, Сортино; формировать инвестиционные стратегии с учётом: горизонта инвестирования; толерантности к риску; рыночных условий.

владеть: навыками работы с источниками рыночной информации: биржевые терминалы (QUIK, MetaTrader); базы данных (Bloomberg, Reuters, CBonds); официальные отчёты компаний и регуляторов; методами количественного анализа: корреляционный и регрессионный анализ; моделирование временных рядов (ARIMA, GARCH); сценарное моделирование и симуляции (Monte Carlo); инструментами портфельного управления: оптимизация по Марковицу; диверсификация по классам активов; ребалансировка портфеля; техниками риск-менеджмента: расчёт VaR и Expected Shortfall; хеджирование позиций с помощью деривативов; установка стоп-лоссов и тейк-профитов; программными средствами: Excel (формулы, сводные таблицы, надстройки для финансов); Python/R (библиотеки для анализа данных: pandas, numpy, quantmod); специализированные пакеты (EViews, STATA); навыками визуализации данных: построение графиков цен и индикаторов; создание дашбордов для мониторинга портфеля; методами коммуникации результатов анализа.

Компетенции выпускников и индикаторы их достижения:

Код и наименование компетенции	*Код и наименование индикатора достижения компетенции*
УК-10. Способен принимать обоснованные	ИДК-1УК-10 Понимает базовые

экономические решения в различных областях жизнедеятельности	принципы функционирования экономики, цели и механизмы основных видов социально-экономической политики и ее влияние на индивида.
ПК-9. Способен осуществлять мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты с целью консультирования клиентов по использованию финансовых продуктов и услуг	ИДК-1$_{пк-9}$ Осуществляет сбор, обработку и анализ информации о состоянии финансового рынка, изучает спрос и предложения на рынке финансовых услуг. ИДК-3$_{пк-9}$ Составляет аналитические заключения, рейтинги, прогнозы с целью предотвращения сделок с недобросовестными партнерами

Смысловые модули и темы дисциплины:

МОДУЛЬ 1. АНАЛИЗ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

Смысловой модуль 1 Основы финансового анализа

Тема 1. Виды и особенности составляющих финансового рынка

Тема 2. Макроэкономические основы финансовых рынков

Тема 3. Фундаментальный анализ

Смысловой модуль 2 Показатели финансового анализа

Тема 4. Фундаментальный анализ экономических отраслей и показателей развития компаний

Тема 5. Технический анализ и гипотеза эффективности рынков

Тема 6. Графики в техническом анализе

Тема 7. Основные принципы анализа осцилляторов

Форма промежуточной аттестации: зачет
(зачет, экзамен)

Разработчик:
Пятаченко А.М.
(ФИО, ученая степень, ученое звание) _____ (подпись)

Заведующий кафедрой банковского дела
Попова И.В., доктор экономических наук, доцент _____ (подпись)