

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего профессионального образования

**«УФИМСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АВИАЦИОННЫЙ  
ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ»**

Кафедра финансов и экономического анализа

**АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ**

УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

**« СТРАТЕГИИ ПОВЕДЕНИЯ НА ФИНАНСОВЫХ РЫНКАХ »**

Уровень подготовки

высшее образование-магистратура

(высшее образование - бакалавриат; высшее образование – специалитет, магистратура)

Направление подготовки (специальность)

38.04.08. "Финансы и кредит"

(код и наименование направления подготовки, специальности)

Направленность подготовки (профиль, специализация)

"Финансы и кредит "

(наименование профиля подготовки, специализации)

Квалификация (степень) выпускника

Магистр

Форма обучения

очная

Уфа 2015

Исполнители:

доцент каф.ФиЭА

должность



подпись

Стрельцов М.А.

расшифровка подписи

Заведующий кафедрой

Финансов и экономического анализа

наименование кафедры



личная подпись

Кошегулова И.Р.

расшифровка подписи

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего профессионального образования

**«УФИМСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АВИАЦИОННЫЙ  
ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ»**

Кафедра финансов и экономического анализа

**АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ**

**УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ**

**« СТРАТЕГИИ ПОВЕДЕНИЯ НА ФИНАНСОВЫХ РЫНКАХ »**

Уровень подготовки

высшее образование-магистратура

(высшее образование - бакалавриат, высшее образование – специалитет, магистратура)

Направление подготовки (специальность)

38.04.08. "Финансы и кредит"

(код и наименование направления подготовки, специальности)

Направленность подготовки (профиль, специализация)

"Финансы и кредит "

(наименование профиля подготовки, специализации)

Квалификация (степень) выпускника

Магистр

Форма обучения

очная

Уфа 2015

Исполнители:

доцент каф.ФиЭА

*должность*

*подпись*

Стрельцов М.А.

*расшифровка подписи*

Заведующий кафедрой

Финансов и экономического анализа

*наименование кафедры*

*личная подпись*

Коцегулова И.Р

*расшифровка подписи*

## Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина Стратегии поведения на финансовых рынках является дисциплиной *вариативной* части ОПОП по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и Кредит. Является дисциплиной по выбору обучающихся. Рабочая программа составлена в соответствии с требованиями Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки магистров 38.04.08 Финансы и Кредит, утвержденного приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от «30» октября 2014 г. № 1420. Является неотъемлемой частью основной образовательной профессиональной программы (ОПОП).

**Целью освоения дисциплины** является формирование у будущих магистров в области финансов и кредита теоретических знаний и практических навыков формирования инвестиционной стратегии на финансовом рынке.

### Задачи:

- обучение магистрантов комплексному анализу финансового рынка на основе фундаментального и технического анализа, а также использования равновесных рыночных моделей.
- Научить определять основные количественные характеристики финансовых активов.
- Научить осуществлять выбор финансовых активов в инвестиционный портфель, исходя из предпочтений инвестора.

### Входные компетенции:

На пороговом уровне ряд компетенций был сформирован за счет обучения на предыдущих уровнях высшего образования (специалитет, бакалавриат).

### Исходящие компетенции:

№	Компетенция	Код	Уровень освоения, определяемый этапом формирования компетенции	Название дисциплины (модуля), для которой данная компетенция является входной
1	способность дать оценку текущей, кратко- и долгосрочной финансовой устойчивости организации, в том числе кредитной	ПК-6	Базовый уровень, второй этап	Преддипломная практика, ВКР
2	способностью разработать и обосновать финансово-экономические показатели, характеризующие деятельность коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно-правовых форм, включая финансово-кредитные, органов государственной власти и местного самоуправления и методики их расчета	ПК-3	Повышенный	ВКР
3	способностью на основе комплексного экономического и финансового анализа дать оценку	ПК-5	Повышенный	ВКР

	результатов и эффективности финансово-хозяйственной деятельности организаций различных организационно-правовых форм, включая финансово-кредитные, органов государственной власти и местного самоуправления			
4	способностью оказывать консалтинговые услуги коммерческим и некоммерческим организациям различных организационно-правовых форм, включая финансово-кредитные, по вопросам совершенствования их финансовой деятельности	ПК-15	Повышенный	ВКР
5	способностью провести анализ и дать оценку существующих финансово-экономических рисков, составить и обосновать прогноз динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро- и мезоуровне	ПК-4	Повышенный	ВКР
6	способностью владеть методами аналитической работы, связанными с финансовыми аспектами деятельности коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно-правовых форм	ПК-1	Повышенный	ВКР
7	способностью анализировать и использовать различные источники информации для проведения финансово-экономических расчетов	ПК-2	Повышенный	ВКР

### Перечень результатов обучения.

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование элементов следующих компетенций.

Планируемые результаты обучения по дисциплине

№	Формируемые компетенции	Код	Знать	Уметь	Владеть
1	способностью обосновать на основе анализа финансово-экономических рисков стратегию поведения экономических агентов на различных сегментах финансового рынка	ПК - 11	- Основные идеи и положения технического и фундаментального анализа финансового рынка - Способы оценки основных параметров финансовых активов	- Оценить основные параметры финансовых активов - Охарактеризовать предпочтения инвестора в отношении формируемого инвестиционного портфеля	- Методами формирования инвестиционных портфелей, учитывающих индивидуальные предпочтения инвестора

## Содержание и структура дисциплины (модуля)

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетные единицы (108 часов).

### Трудоемкость дисциплины по видам работ

Вид работы	Трудоемкость, час.
	<b>2 семестр</b>
Лекции (Л)	12
Практические занятия (ПЗ)	16
КСР	3
Самостоятельная работа (проработка и повторение лекционного материала и материала учебников и учебных пособий, подготовка к лабораторным и практическим занятиям, коллоквиумам, рубежному контролю и т.д.)	68
Подготовка и сдача зачета (контроль)	9
Вид итогового контроля (зачет, экзамен)	зачет

Содержание разделов и формы текущего контроля

№	Наименование и содержание раздела	Количество часов					Литература, рекомендуемая студентам*	Виды интерактивных образовательных технологий**	
		Аудиторная работа			СРС				Всего
		Л	ПЗ	ЛР	КСР				
1	<p><b>Фундаментальный и технический анализ финансового рынка.</b>                      Основные идеи и понятия фундаментального анализа. Экономические фундаментальные факторы, теории определения валютных курсов. Экономические индикаторы: индикаторы промышленности, индикаторы инфляции, индикаторы занятости, индикаторы потребительских расходов.                      Основные идеи и понятия технического анализа. Линии тренда и графики. Основные модели продолжения и разворота тренда. Линии поддержки и сопротивления. Торговые диапазоны.</p>	4	6		1	20	31	<p>1. Дацко С. Н. Предпринимательство на потребительском рынке. Финансовые аспекты / Дацко С.Н. - Москва: Финансы и статистика, 2014                      2. Саввина О.В. Регулирование финансовых рынков [Электронный ресурс]: учеб. пособие / О. В. Саввина - Москва: Дашков и К, 2012 - 202, [1] с.</p>	<i>лекция-визуализация, проблемное обучение, обучение на основе опыта</i>
2	<p><b>Теория инвестиционного портфеля.</b>                      Теория инвестиционного портфеля Г. Марковица. Основные равновесные модели оценки финансовых активов: Рыночная модель, Модель CAPM, Модель Арбитражного ценообразования. Оценка индивидуальных предпочтений инвестора. Формирование оптимального инвестиционного портфеля</p>	8	10		2	48	68	<p>1. Щебарова Н. Н. Международные валютно-финансовые отношения: учеб. пособие / Н. Н. Щебарова; Рос. акад. образования, Моск. психол.-соц. ин-т - Москва: Флинта, 2011 - 217, [1] с.</p>	<i>лекция-визуализация, проблемное обучение, обучение на основе опыта</i>

## Лабораторные работы

№ занятия	№ раздела	Тема	Кол-во часов
		Не предусмотрены	

## Практические занятия (семинары)

№ занятия	№ раздела	Тема	Кол-во часов
1	1	Прогнозирование динамики доходности финансовых инструментов на основе фундаментального анализа	2
2	1	Прогнозирование динамики доходности финансовых инструментов на основе фундаментального анализа	2
3	1	Прогнозирование динамики доходности финансовых инструментов на основе технического анализа	2
4	2	Прогнозирование динамики доходности финансовых инструментов на основе технического анализа	2
5	2	Расчет основных показателей финансовых активов и портфелей согласно теории Марковица	2
6	2	Расчет основных показателей финансовых активов и портфелей на основе равновесных моделей: CAPM	2
7	2	Расчет основных показателей финансовых активов и портфелей на основе равновесных моделей: рыночной модели и модели арбитражного ценообразования	2
8	2	Оценка индивидуальных предпочтений инвестора. Формирование оптимального инвестиционного портфеля	2

### Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины (модуля)

#### Основная литература

1. Дацко С. Н. Предпринимательство на потребительском рынке. Финансовые аспекты / Дацко С.Н. - Москва: Финансы и статистика, 20142.
2. Саввина О.В. Регулирование финансовых рынков [Электронный ресурс]: учеб. пособие / О. В. Саввина - Москва: Дашков и К, 2012 - 202, [1] с.
3. Щебарова Н. Н. Международные валютно-финансовые отношения: учеб. пособие / Н. Н. Щебарова; Рос. акад. образования, Моск. психол.-соц. ин-т - Москва: Флинта, 2011 - 217, [1] с.

#### Дополнительная литература.

1. Шарп, У. Ф. Инвестиции : [учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям] / У. Ф. Шарп , Александер, Бэйли ; пер. с англ. А. Н. Буренина, А. А. Васина .— М. : Инфра-М, 2007 .— XII, 1028 с.

**Интернет-ресурсы (электронные учебно-методические издания, лицензионное программное обеспечение)**

1. [www.bankir.ru](http://www.bankir.ru)
2. [www.cbr.ru](http://www.cbr.ru)
3. [www.invest-info.ru](http://www.invest-info.ru)
4. [www.forex.com](http://www.forex.com)
5. [www.minfin.ru](http://www.minfin.ru)
6. [www.credits.ru](http://www.credits.ru)

**Материально-техническое обеспечение дисциплины**

Лекционные аудитории с современными средствами демонстрации.

**Адаптация рабочей программы для лиц с ОВЗ**

Адаптированная программа разрабатывается при наличии заявления со стороны обучающегося (родителей, законных представителей) и медицинских показаний (рекомендациями психолого-медико-педагогической комиссии). Для инвалидов адаптированная образовательная программа разрабатывается в соответствии с индивидуальной программой реабилитации.