

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Гнатюк Максим Александрович
Должность: Первый проректор
Дата подписания: 11.07.2022 09:51:21
Уникальный программный ключ:
8873f497f100e798ae8c92c0d38e105c818d5410

**МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ АГЕНТСТВО ЖЕЛЕЗНОДОРОЖНОГО ТРАНСПОРТА
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
САМАРСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПУТЕЙ СООБЩЕНИЯ
(СамГУПС)**

УТВЕРЖДАЮ
Начальник УМУ

_____ Ю.Ю.Оберт

_____ 2016 г.

**Фундаментальный и технический анализ
на финансовых рынках (ФТАФР)
рабочая программа дисциплины (модуля)**

Кафедра **«Экономика и финансы»**

Направление подготовки **38.04.01 Экономика**

Направленность
(профиль) **«Учет, анализ и аудит»**

Квалификация **магистр**

Форма обучения **заочная**

Объем дисциплины **2 ЗЕТ**

Программу составил(и):

профессор кафедры "Экономика и финансы" М.Ю. Карышев _____

Рабочая программа дисциплины

Финансовые рынки

Федеральный государственный образовательный стандарт

Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования по направлению подготовки 38.04.01 Экономика (уровень магистратуры) утвержден Приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от 30 марта 2015 г. N 321.

Составлена на основании учебного плана:

Направление подготовки 38.04.01 Экономика

Направленность (профиль) «Учет, анализ и аудит»
утвержденного учёным советом вуза от 25.02.2016 протокол № 15.

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры

Экономика и финансы

Протокол от 1 сентября 2016 г. № 1

Срок действия программы: 2016-2019 уч. г.

Зав. кафедрой к.э.н., доцент Первов П.А. _____

Согласовано:

Председатель СОП по направлению подготовки/специальности

38.04.01 Экономика

к.э.н., доцент Первов П.А. _____

Рабочая программа дисциплины зарегистрирована в учебно-методическом управлении

Регистрационный № _____ Дата регистрации _____

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Председатель СОП

_____ 2017 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения
в 2017-2018 учебном году на заседании кафедры

Экономика и финансы

с изменениями/дополнениями:

Протокол от _____ 2017 г. № _____
Зав. кафедрой к.э.н., доцент Первов П.А.

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Председатель СОП

_____ 2018 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для
исполнения в 2018-2019 учебном году на заседании кафедры

Экономика и финансы

Протокол от _____ 2018 г. № _____
Зав. кафедрой к.э.н., доцент Первов П.А.

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Председатель СОП

_____ 2019 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для
исполнения в 2019-2020 учебном году на заседании кафедры

Экономика и финансы

Протокол от _____ 2019 г. № _____
Зав. кафедрой к.э.н., доцент Первов П.А.

1. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ), СООТНЕСЕННЫЕ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

1.1. Цели освоения дисциплины (модуля)

Целью дисциплины является подготовка к ведению экономической деятельности на финансовых рынках с применением соответствующих методов фундаментального и технического анализа по направлению подготовки 38.04.01 «Экономика» направленности (профиля) «Учет, анализ и аудит» посредством обеспечения этапов формирования компетенций, предусмотренных учебным планом, в части представленных ниже знаний, умений и владений. Задачами дисциплины является изучение понятийного аппарата дисциплины, основных теоретических положений и методов, развитие навыков применения теоретических знаний для решения практических задач.

1.2 Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины (модуля)

ОК-2: готовностью действовать в нестандартных ситуациях, нести социальную ответственность за принятые решения

Знать:

Уровень 1 (базовый)	принципы действия в нестандартных ситуациях, связанных со спецификой реализации экономических процессов на финансовых рынках, руководствуясь методами фундаментального и технического анализа
Уровень 2 (повышенный)	способы действия в нестандартных ситуациях, связанных со спецификой реализации экономических процессов на финансовых рынках, руководствуясь методами фундаментального и технического анализа
Уровень 3 (продвинутый)	методы действия в нестандартных ситуациях, связанных со спецификой реализации экономических процессов на финансовых рынках, руководствуясь методами фундаментального и технического анализа

Уметь:

Уровень 1 (базовый)	нести социальную ответственность за принятые решения на финансовых рынках, являющиеся последствиями реализации фундаментальных аналитических выводов
Уровень 2 (повышенный)	нести социальную ответственность за принятые решения на финансовых рынках, являющиеся последствиями реализации технических аналитических выводов
Уровень 3 (продвинутый)	нести социальную ответственность за принятые решения на финансовых рынках, являющиеся последствиями реализации фундаментальных и технических аналитических выводов

Владеть:

Уровень 1 (базовый)	базовыми методами фундаментального и технического анализа финансовых рынков с целью получения позитивного экономического результата в условиях неопределенности
Уровень 2 (повышенный)	продвинутыми методами фундаментального и технического анализа финансовых рынков с целью получения позитивного экономического результата в условиях неопределенности
Уровень 3 (продвинутый)	широким спектром методов фундаментального и технического анализа финансовых рынков с целью получения позитивного экономического результата в условиях неопределенности

ОПК-3: способностью принимать организационно-управленческие решения

Знать:

Уровень 1 (базовый)	принципы принятия организационно-управленческих решений при реализации методов фундаментального и технического анализа в условиях неопределенности на финансовых рынках
Уровень 2 (повышенный)	способы принятия организационно-управленческих решений при реализации методов фундаментального и технического анализа в условиях неопределенности на финансовых рынках
Уровень 3 (продвинутый)	методы принятия организационно-управленческих решений при реализации методов фундаментального и технического анализа в условиях неопределенности на финансовых рынках

Уметь:

Уровень 1 (базовый)	принимать организационно-управленческие решения при реализации методов фундаментального анализа в условиях неопределенности на финансовых рынках и нести за свои действия социальную и иную ответственность
Уровень 2 (повышенный)	принимать организационно-управленческие решения при реализации методов технического анализа в условиях неопределенности на финансовых рынках и нести за свои действия социальную и иную ответственность
Уровень 3 (продвинутый)	принимать организационно-управленческие решения при реализации методов фундаментального и технического анализа в условиях неопределенности на финансовых рынках и нести за свои действия социальную и иную ответственность

Владеть:

Уровень 1 (базовый)	базовыми способностями принятия организационно-управленческих решений при реализации методов фундаментального и технического анализа в условиях неопределенности на финансовых рынках
Уровень 2 (повышенный)	продвинутыми способностями организационно-управленческих решений при реализации методов фундаментального и технического анализа в условиях неопределенности на финансовых рынках
Уровень 3 (продвинутый)	всем спектром способностей принятия организационно-управленческих решений при реализации методов фундаментального и технического анализа в условиях неопределенности на финансовых рынках

Консультации																				
Инд. работа																				
Контроль	4	4																	4	4
Сам. работа	48	48																	48	48
ИТОГО	72	72																	72	72

3.3. Формы контроля и виды самостоятельной работы обучающегося

Форма контроля	Семестр (офо)/ курс(зфо)	Нормы времени на самостоятельную работу обучающегося	
		Вид работы	Нормы времени, час
Экзамен		Подготовка к лекциям	0,5 часа на 1 час аудиторных занятий
		Подготовка к практическим/ лабораторным занятиям	1 час на 1 час аудиторных занятий
Зачет	1	Подготовка к зачету	9 часов (офо)
Курсовой проект		Выполнение курсового проекта	72 часа
Курсовая работа		Выполнение курсовой работы	36 часов
Контрольная работа		Выполнение контрольной работы	9 часов
РГР		Выполнение РГР	18 часов
Реферат/эссе		Выполнение реферата/эссе	9 часов

4. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ), СТРУКТУРИРОВАННОЕ ПО ТЕМАМ (РАЗДЕЛАМ) С УКАЗАНИЕМ ОТВЕДЕННОГО НА НИХ КОЛИЧЕСТВА АКАДЕМИЧЕСКИХ ЧАСОВ И ВИДОВ УЧЕБНЫХ ЗАНЯТИЙ

Код занятия	Наименование разделов и тем	Вид занятия	Семестр / курс	К-во ак. часов	Компетенции	Литература	Часы в интерактивной форме	
							К-во ак. часов	Форма занятия
	Раздел 1 Фундаментальный анализ на финансовых рынках							
1.1	Общэкономический аспект проведения фундаментального	Л.	1	2	ОК-2, ОПК-3	Л1.1	2	дискуссия
1.2	Отраслевой и региональный аспект проведения фундаментального анализа	Л.	1	2	ОК-2, ОПК-3	Л2.1, Л2.2	2	дискуссия
1.3	Фундаментальный анализ отдельных компаний	Пр.	1	2	ОК-2, ОПК-3	Л2.1, Л2.2	2	дискуссия
1.4	Методы проведения фундаментального анализа в целом по экономике	Пр.	1	1	ОК-2, ОПК-3	Л1.1	1	дискуссия
1.5	Методы проведения фундаментального анализа на региональном и отраслевом уровнях	Пр.	1	2	ОК-2, ОПК-3	Л2.1, Л2.2	2	дискуссия
1.6	Методы проведения фундаментального анализа на уровне компании	Пр.	1	1	ОК-2, ОПК-3	Л2.1, Л2.2	1	дискуссия
1.7	Система показателей общеэкономического анализа	Ср.	1	7	ОК-2, ОПК-3	Л1.1		
1.8	Система показателей отраслевого анализа	Ср.	1	6	ОК-2, ОПК-3	Л2.1, Л2.2		
1.9	Система показателей анализа отдельных компаний	Ср.	1	6	ОК-2, ОПК-3	Л2.1, Л2.2		
	Раздел 2. Технический анализ на финансовых рынках							
2.1	Общэкономический аспект проведения технического анализа	Л.	1	2	ОК-2, ОПК-3	Л1.1	2	дискуссия
2.2	Отраслевой и региональный аспект проведения технического анализа	Л.	1	2	ОК-2, ОПК-3	Л2.1, Л2.2	2	дискуссия
2.3	Технический анализ отдельных компаний	Пр.	1	2	ОК-2, ОПК-3	Л2.1, Л2.2	2	дискуссия

2.4	Методы проведения технического анализа в целом по экономике	Пр.	1	1	ОК-2, ОПК-3	Л1.1	1	дискуссия
2.5	Методы проведения технического анализа на региональном и отраслевом уровнях	Пр.	1	2	ОК-2, ОПК-3	Л2.1, Л2.2	2	дискуссия
2.6	Методы проведения технического анализа на уровне компании	Пр.	1	1	ОК-2, ОПК-3	Л2.1, Л2.2	1	дискуссия
2.7	Система показателей общеэкономического анализа	Ср.	1	7	ОК-2, ОПК-3	Л1.1		
2.8	Система показателей отраслевого анализа	Ср.	1	6	ОК-2, ОПК-3	Л2.1, Л2.2		
2.9	Система показателей анализа отдельных компаний	Ср.	1	6	ОК-2, ОПК-3	Л2.1, Л2.2		
Раздел 3. Самостоятельная работа обучающихся								
3.1	Подготовка к лекциям	Ср.	1	4	ОК-2, ОПК-3	Л2.1, Л2.2		
3.2	Подготовка к практическим занятиям	Ср.	1	6	ОК-2, ОПК-3	Л2.1, Л2.2		

5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

5.1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

ОК-2: готовностью действовать в нестандартных ситуациях, нести социальную ответственность за принятые решения

ОПК-3: способностью принимать организационно-управленческие решения

Матрица оценки результатов обучения по дисциплине

Код компетенции	Планируемые результаты обучения (показатели освоения компетенций)	Оценочные средства/формы контроля				
		Дискуссия	Тестовое задание	Курсовая работа	Зачет	Экзамен
ОК-2	Знает	+	+		+	
	Умеет	+	+		+	
	Владеет	+	+		+	
ОПК-3	Знает	+	+		+	
	Умеет	+	+		+	
	Владеет	+	+		+	

5.2 Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

Критерии формирования оценок по выполнению тестовых заданий

«Отличный уровень компетенции» (5 баллов) – получают обучающиеся с правильным количеством ответов на тестовые вопросы – 100 – 90% от общего объема заданных тестовых вопросов.

«Хороший уровень компетенции» (4 балла) – получают обучающиеся с правильным количеством ответов на тестовые вопросы – 89 – 70% от общего объема заданных тестовых вопросов.

«Удовлетворительный уровень компетенции» (3 балла) – получают обучающиеся с правильным количеством ответов на тестовые вопросы – 69 – 40% от общего объема заданных тестовых вопросов.

«Неудовлетворительный уровень компетенции» (0 баллов) - получают обучающиеся с правильным количеством ответов на тестовые вопросы – менее 39% от общего объема заданных тестовых вопросов.

Критерии формирования оценок по зачету

«Уровень освоения компетенции «зачтено»» - обучающийся демонстрирует знание основных разделов программы изучаемого курса: его базовых понятий и фундаментальных проблем; приобрел необходимые умения и навыки, освоил вопросы практического применения полученных знаний, не допустил фактических ошибок при ответе, достаточно последовательно и логично излагает теоретический материал, допуская лишь незначительные нарушения последовательности изложения и некоторые неточности.

«Уровень освоения компетенции «не зачтено»» - выставляется в том случае, когда обучающийся демонстрирует фрагментарные знания основных разделов программы изучаемого курса: его базовых понятий и фундаментальных проблем. У экзаменуемого слабо выражена способность к самостоятельному аналитическому мышлению, имеются затруднения в изложении материала, отсутствуют необходимые умения и навыки, допущены грубые ошибки и незнание терминологии, отказ отвечать на дополнительные вопросы, знание которых необходимо для получения положительной оценки.

5.3 Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций**Вопросы к зачету**

1. Понятие и предмет фундаментального анализа
2. Общеэкономический аспект проведения фундаментального анализа
3. Отраслевой и региональный аспекты проведения фундаментального анализа
4. Проведение фундаментального анализа на уровне компании
5. Методы проведения фундаментального анализа на общеэкономическом уровне
6. Методы проведения фундаментального анализа на отраслевом и региональном уровнях
7. Методы проведения фундаментального анализа компании
8. Система показателей общеэкономического фундаментального анализа
9. Система показателей отраслевого и регионального фундаментального анализа
10. Система показателей фундаментального анализа компании
11. Понятие и предмет технического анализа
12. Общеэкономический аспект проведения технического анализа
13. Отраслевой и региональный аспекты проведения технического анализа
14. Проведение технического анализа на уровне компании
15. Методы проведения технического анализа на общеэкономическом уровне
16. Методы проведения технического анализа на отраслевом и региональном уровнях
17. Методы проведения технического анализа компании
18. Система показателей общеэкономического технического анализа
19. Система показателей отраслевого и регионального технического анализа
20. Система показателей технического анализа компании

5.4 Методические материалы, определяющие процедуры оценивания

Критерием успешности освоения учебного материала обучающимся является экспертная оценка преподавателя регулярности посещения учебных занятий, результатов работы на практических занятиях, а так же тестовых заданий.

Оценочные средства для текущего контроля успеваемости включают в себя вопросы к теоретическим занятиям для участия в дискуссии; практические задания, контрольные тесты.

Промежуточная аттестация основывается на оценке знаний при ответе на контрольные вопросы и (или) выполнении итоговых тестовых заданий (в системе «Moodle»: режим доступа: <http://do.samgups.ru/moodle/>).

Порядок проведения зачета:

Зачет проводится по итогам текущей успеваемости и других видов работ, предусмотренных программой дисциплины и (или) путем организации специального опроса, проводимого в устной и (или) письменной форме.

6. ПЕРЕЧЕНЬ УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ ДЛЯ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)**6.1 Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)****6.1.1. Основная литература**

	Авторы,	Заглавие	Издательство, год	Кол-во
Л1.1	Саввина О.В	Регулирование финансовых рынков	М.: Дашков и К, 2012. – 204 с.	http://e.lanbook.com/book/5668

6.1.2 Дополнительная литература

	Авторы,	Заглавие	Издательство, год	Кол-во
Л2.1	Нешитой А.С.	Финансы, денежное обращение и кредит	М.: Дашков и К, 2012. – 640 с.	http://e.lanbook.com/book/3588
Л2.2	Воронина М.В.	Финансовый менеджмент	М.: Дашков и К, 2015, - 400 с.	http://e.lanbook.com/book/70598

6.2 Методические разработки

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Кол-во
-	-	-	-	-

6.3. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"

	Наименование ресурса	Эл.адрес
Э1	Дистанционные образовательные ресурсы СамГУПС	http://do.samgups.ru/moodle/
Э2	Образовательно-справочный сайт по экономике	http://www.economicus.ru/
Э3	Экономика и финансы – публикации, статьи, обзоры, аналитика	http://www.finansy.ru/
Э4	Федеральный образовательный портал – Экономика, Социология, Менеджмент	http://www.ecsocman.edu.ru/

7. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Для освоения дисциплины обучающемуся необходимо: систематически посещать лекционные занятия; активно участвовать в обсуждении предложенных вопросов и выполнять практические задания; выполнить курсовую работу; успешно пройти все формы текущего контроля; сдать зачет.

Для подготовки к итоговым испытаниям по дисциплине необходимо использовать: материалы лекций, рекомендуемой основной и дополнительной литературой; методические материалы.

Для теоретического и практического усвоения дисциплины большое значение имеет самостоятельная работа обучающихся, которая может осуществляться как индивидуально, так и под руководством обучающего. Данная работа предполагает самостоятельное изучение обучающимся отдельных тем, дополнительную подготовку к каждому лекционному и практическому занятию.

Самостоятельная работа обучающихся является важной формой образовательного процесса. Она реализуется вне рамок расписания, а также в библиотеке, дома, при выполнении учебных и творческих задач.

Цель самостоятельной работы - научить обучающегося осмысленно и самостоятельно работать сначала с учебным материалом, затем с научной информацией, заложить основы самоорганизации и самовоспитания с тем, чтобы повысить уровень освоения компетенций, а так же привить умение в дальнейшем непрерывно повышать свою квалификацию.

8. ИНФОРМАЦИОННЫЕ ТЕХНОЛОГИИ, ИСПОЛЬЗУЕМЫЕ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

Размещение учебных материалов в разделе «Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках» системы обучения Moodle: <http://do.samgups.ru/moodle/>

8.1 Перечень программного обеспечения и информационных справочных систем

8.1.1	Использование специализированного программного обеспечения данной программой не предусматривается
--------------	---

9. ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

Лекционная аудитория (50 и более посадочных мест) и аудитория для проведения практических занятий (25 и более посадочных мест); неограниченный доступ к электронно-библиотечным системам (через ресурсы библиотеки СамГУПС), к электронной информационно-образовательной среде moodle и к информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» в рамках самостоятельной работы обучающегося.