

## **АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ**

### **Б1.В.ДВ.13.01 СТАТИСТИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ**

**Автор:** к.э.н., доцент, Е.С. Дарда

**Код и наименование направления подготовки:** 38.03.02 Менеджмент

**Профиль:** Инвестиционный менеджмент

**Квалификация (степень) выпускника:** бакалавр

**Форма обучения:** очно-заочная

#### **Цель освоения дисциплины:**

Сформировать компетенции

- ПК - 10 Владение навыками количественного и качественного анализа информации при принятии управленческих решений, построения экономических, финансовых и организационно-управленческих моделей путем их адаптации к конкретным задачам управления.

#### **План курса:**

##### **Тема 1. Предмет, метод и задачи статистического анализа финансовых рынков.**

Финансовые рынки. Краткая характеристика основных видов финансовых рынков. Цели и задачи статистического изучения финансовых рынков. Методологическая основа статистического изучения финансовых рынков. Источники статистической информации. Система показателей статистики финансовых рынков.

##### **Тема 2. Статистический анализ фондового рынка.**

Фондовый рынок. Краткая характеристика основных видов ценных бумаг. Субъекты фондового рынка. Эмитенты. Инвесторы. Посредники. Профессиональные участники рынка ценных бумаг. Источники статистической информации. Система показателей статистики рынка ценных бумаг.

##### **Тема 3. Статистический анализ структуры и тенденций фондового рынка.**

Понятие структуры. Виды структур. Показатели структурных изменений. Понятия «концентрация» и «централизация» рынка. Кривая концентрации Лоренца. Коэффициент Джини. Индекс Герфендаля-Хиршмана. Общая характеристика метода скользящих средних. Особенности применения метода скользящих средних на фондовом рынке. Выбор периода осреднения: преимущества и недостатки различных порядков осреднения. Простые скользящие средние. Взвешенные скользящие средние. Экспоненциальные скользящие средние. Интерпретация линий скользящих средних. Общие правила торговли по скользящим средним.

##### **Тема 4. Статистический анализ страхового рынка.**

Понятие страхового рынка. Задачи статистики страхового рынка. Информационная база статистики страхования. Система показателей статистики страхования. Система показателей имущественного и личного страхования. Методология статистического анализа страховых сумм. Анализ показателей эффективности деятельности страховых организаций.

##### **Тема 5. Статистический анализ рынка инвестиций.**

Понятие инвестиций. Виды инвестиций. Задачи статистики инвестиций.

рынка. Информационная база инвестиционного рынка. Система показателей статистики инвестиционного рынка. Статистические методы анализа инвестиций.

#### **Тема 6. Статистический анализ денежного рынка.**

Понятие, виды денежного обращения и задачи его статистического изучения. Статистика денежной массы. Денежные агрегаты. Денежная база. Денежный мультипликатор. Анализ структуры и динамики денежной массы. Оценка скорости обращения денег. Анализ факторов, влияющих на скорость обращения денежной массы. Определение количества денег, необходимого для обращения. Факторы, влияющие на объем денег в обращении. Анализ купюрного строения. Система показателей безналичного платежного оборота.

#### **Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:**

**В ходе реализации дисциплины Б1.В.ДВ.13.01 «Статистический анализ финансовых рынков» используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:**

Предмет, метод и задач и статистического анализа финансовых рынков.	Опрос
Статистический анализ фондового рынка.	Тестирование, расчетное задание
Статистический анализ структуры и тенденций фондового рынка	Опрос, расчетное задание, контрольная работа
Статистический анализ страхового рынка	Опрос, расчетное задание
Статистический анализ рынка инвестиций	Опрос, расчетное задание
Статистический анализ денежного рынка	Расчетное задание, контрольная работа

**Промежуточная аттестация проводится в форме зачета с оценкой.**

#### **Основная литература:**

1. Балдин К.В. Теория вероятностей и математическая статистика [Электронный ресурс]: учебник/ К.В. Балдин, В.Н. Башлыков, А.В. Рукоусев— Электрон. текстовые данные.— М.: Дашков и К, 2016.— 473 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/4444.html>.— ЭБС «IPRbooks»
2. Миркин Я.М., Добашина И.В., Салин В.Н. Статистика финансовых рынков. – М. : КНОРУС, 2016. <https://e.lanbook.com/book/5537#authors>
3. Саблина Е. Статистика финансов. - М.: Издательский Дом "ИНФРА-М", 2016. <http://e.lanbook.com/book/53546>