

**Федеральное государственное бюджетное образовательное
учреждение высшего образования
«РОССИЙСКАЯ АКАДЕМИЯ НАРОДНОГО ХОЗЯЙСТВА
И ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ
ПРИ ПРЕЗИДЕНТЕ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»**

**ИНСТИТУТ ЭМИТ
ЭКОНОМИЧЕСКИЙ ФАКУЛЬТЕТ
ОТДЕЛЕНИЕ ЭКОНОМИКИ
кафедра Эконометрики и математической экономики**

УТВЕРЖДЕНА
на заседании кафедры эконометрики и
математической экономики
Протокол от «02» июня 2021 г. № 10

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Индекс ФТД.03 «Экономический и финансовый анализ в терминале Bloomberg»

по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика»

направленность «Экономика и финансы»

квалификация бакалавр

очная форма обучения

Год набора – 2021

Москва, 2021 г.

Автор(ы)–составитель(и): ст. преп. кафедры эконометрики и математической экономики
Чернова М.И.

Заведующий кафедрой
эконометрики и математической экономики, к. ф.-м. н, Носко В.П.

СОДЕРЖАНИЕ

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы.....	4
2. Объем и место дисциплины в структуре образовательной программы.....	5
3. Содержание и структура дисциплины.....	5
4. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся и фонд оценочных средств промежуточной аттестации по дисциплине	7
5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины	11
6. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающихся по дисциплине	14
6.1. Основная литература	14
6.2. Дополнительная литература	14
6.3. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы	14
6.4. Нормативные правовые документы	14
6.5. Интернет-ресурсы	14
6.6. Иные источники	14
7. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы	14

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения программы

1.1. Дисциплина «Экономический и финансовый анализ в терминале Bloomberg» обеспечивает овладение следующими компетенциями с учетом этапа:

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
УК ОС-2	способность разработать проект на основе оценки ресурсов и ограничений	УК ОС-2.2	способность разработать проект на основе оценки ресурсов и ограничений

1.2. В результате освоения дисциплины у студентов должны быть сформированы:

ОТФ/ТФ (при наличии профстандарта)	Код этапа освоения компетенции	Результаты обучения
ведение аналитической работы в области экономики и финансов	УК ОС-2.2	на уровне знаний: об ресурсах и ограничениях проектов
		на уровне умений: определять и оценивать ресурсы и существующие ограничения проекта
		на уровне навыков: работы с проектами

2. Объем и место дисциплины в структуре ОП ВО

Объем дисциплины

1 ЗЕ, 16 ак. часов на контактную работу с преподавателем, 16 ак. часов на самостоятельную работу обучающихся, 4 ак. часа на промежуточную аттестацию;

Место дисциплины в структуре ОП ВО

- ФТД.03 «Экономический и финансовый анализ в терминале Bloomberg» 3 курс, 5 семестр.
 - дисциплина реализуется после изучения дисциплин: экономическая информатика, микроэкономика 1, макроэкономика 1, макроэкономика 2, микроэкономика 2.
 - дисциплина может реализоваться частично или полностью с применением ЭО и/или ДОТ.
- Учебные материалы дисциплины размещаются по адресу lms.ganepa.ru
- форма промежуточной аттестации – зачет.

3. Содержание и структура дисциплины

№ п/п	Наименование тем (разделов)	Объем дисциплины, ак. час./ час.						Форма текущего контроля успеваемости*, промежуточно й аттестации
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий**				СР	
			Л	ЛР	ПЗ	КСР		
Очная форма обучения								
Тема 1	Введение в работу с терминалом Bloomberg	6			2		4	ДЗ
Тема 2	Экономический анализ в терминале Bloomberg	6			4		2	ДЗ
Тема 3	Финансовый анализ компании в терминале Bloomberg	6			4		2	ДЗ
Тема 4	Интеграция Bloomberg и Microsoft Excel	8			4		4	ДЗ
Тема 5	Интеграция финансовой теории и терминала Bloomberg	6			2		4	ДЗ

№ п/п	Наименование тем (разделов)	Объем дисциплины, ак. час./ час.						Форма текущего контроля успеваемости*, промежуточно й аттестации
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий**				СР	
			Л	ЛР	ПЗ	КСР		
Очная форма обучения								
Промежуточная аттестация		4						зачет
Всего:		36/27			16/12		16/12	

Примечание: * – формы текущего контроля успеваемости: домашнее задание (ДЗ).

Примечание **: в рамках указанной контактной работы с обучающимися учебные занятия могут проводиться с использованием ДОТ и/или ЭО

Содержание дисциплины

Тема 1 Введение в работу с терминалом Bloomberg

Основные понятия при работе с терминалом Bloomberg. Навигация в терминале Bloomberg. Основные подходы к поиску данных в терминале Bloomberg. Использование навигационного меню для поиска и первичного анализа финансовых данных. Обзор данных, предоставляемых агентством Bloomberg. Анализ новостей и исследований. Графический анализ данных.

Тема 2 Экономический анализ компании в терминале Bloomberg

Экономический календарь в терминале Bloomberg. Экономические прогнозы и прогнозы макропоказателей. Анализ и экспорт прогнозов из различных источников. Ожидания и прогнозное состояние экономики на примере макропоказателей Российской Федерации в терминале Bloomberg. Анализ кейсов на примере развития кризисов в разных странах и на примере формирования ожиданий инвесторов и регуляторов. Анализ спотового и срочного финансового рынка. Кейсы по колебаниям прогнозов на валютном и срочном рынках. Экспорт экономических показателей.

Тема 3 Финансовый анализ компании в терминале Bloomberg

Тикер компании. Описание компании в терминале Bloomberg. Экспорт общих сведений о компании и ее финансовом результате из терминала Bloomberg. Анализ информации о выпусках ценных бумаг, произведенных компанией. Обзор показателей финансовых показателей компании и их анализ в терминале Bloomberg. Экспорт финансовой отчетности. Использование функций терминала Bloomberg для детального абсолютного и сравнительного анализа текущего, прошлого и прогнозируемого состояния компании. Анализ финансовых рисков компании.

Тема 4 Интеграция Bloomberg и Microsoft Excel

Обзор плагина Bloomberg Excel и его функционала. Виды и тип данных, доступных для экспорта данных из терминала Bloomberg. Работа с диалоговым окном для автоматизированного экспорта данных. Создание листов с обновлением данных в реальном времени. Основные операторы для экспорта данных, их опции и синтаксис. Формирование и автоматизированное редактирование временных рядов данных.

Тема 5 Интеграция финансовой теории и терминала Bloomberg

Обзор теории финансовых рынков и анализ кейсов в терминале Bloomberg. Практические навыки и применение теории финансовых рынков. Экономические индикаторы, теория, практика и оценка здоровья экономики. Оценка качества и применение экономических индикаторов в терминале Bloomberg. Влияние экономических индикаторов на спотовый финансовый рынок. Исторический анализ и механизм валютного рынка, оценка роли центральных банков с помощью терминала Bloomberg. Оценка и смягчение валютного риска. Анализ основных финансовых инструментов (акции и облигации) в терминале Bloomberg: теория и практика. Международный сертификат Bloomberg Market Concepts.

4. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся и фонд оценочных средств промежуточной аттестации по дисциплине

4.1. Формы и методы текущего контроля успеваемости обучающихся и промежуточной аттестации.

4.1.1. В ходе реализации дисциплины ФТД.03 «Экономический и финансовый анализ в терминале Bloomberg» используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

Тема (раздел)	Методы текущего контроля успеваемости
Тема 1	Домашнее задание 1
Тема 2	Домашнее задание 2

Тема (раздел)	Методы текущего контроля успеваемости
Тема 3	Домашнее задание 3
Тема 4	Домашнее задание 4
Тема 5	Домашнее задание 5

4.1.2. Зачет проводится с применением следующих методов (средств): в виде устного собеседования по результатам выполнения заданий текущего контроля успеваемости.

4.2. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся

Типовые оценочные материалы по теме 1

Домашнее задание 1. Изучить основные функции для работы с терминалом, составить список наиболее часто используемых функций для сбора данных. Собрать информацию об идентификаторах макроэкономических показателей для выборки стран.

Типовые оценочные материалы по теме 2

Домашнее задание 2. Получить данные об основных экономических показателях для выборки стран, например, темпах роста ВВП, курсов национальных валют, инфляции и т.п. за заданный интервал времени

Типовые оценочные материалы по теме 3

Домашнее задание 3. Изучить основные функции для сбора данных о компании. Создать выборку компаний на основе заданного критерия. Получить данные об основных финансовых показателях для выборки компаний. Собрать данные об основных ценных бумагах, выпущенных компанией и их исторические котировки.

Типовые оценочные материалы по теме 4

Домашнее задание 4. С применением полного функционала плагина Bloomberg для Excel выгрузить исторические данные о всех изученных ранее макроэкономических и финансовых рядах. Выгрузить данные о данных с товарного рынка, а также текущие данные по полям без исторической глубины.

Типовые оценочные материалы по теме 5

Домашнее задание 5. С применением полного функционала плагина Bloomberg для Excel выгрузить исторические данные о котировках ценных бумаг заданной компании и применить основы финансовой теории при сопоставлении полученных данных с бенчмарками по доходности и рискам.

4.3. Оценочные средства для промежуточной аттестации.

4.3.1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы. Показатели и критерии оценивания компетенций с учетом этапа их формирования

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
УК ОС-2	способность разработать проект на основе оценки ресурсов и ограничений	УК ОС-2.2	способность разработать проект на основе оценки ресурсов и ограничений

Этап освоения компетенции	Показатель оценивания	Критерий оценивания
УК ОС-2.2	представляет и защищает самостоятельно разработанный проект любого типа, включая исследовательскую работу, с обоснованием ресурсов и ограничений при его разработке и реализации	Результат критического анализа НИР, представленного в виде доклада, включающего себя практические результаты исследования

4.3.2. Типовые оценочные средства.

Контрольные вопросы к зачету

1. Соберите идентификаторы и выгрузите в Excel исторические данные о темпах роста ВВП, инфляции и ключевой ставке в Италии, Франции и России за последние 10 лет.
2. Выгрузить прошлые значения прогнозов (ожидания экспертов) о темпах роста ВВП, инфляции и ключевой ставке в Италии, Франции и России за последние 10 лет
3. Выгрузить ежедневные данные о курсах валют, их волатильности и темпах роста для Италии, Франции и России за последние 10 лет
4. Выгрузить ежедневные данные о ценах на кофе, золото и нефть за последние 20 лет
5. Создать выборку компаний из заданной отрасли и выгрузить основную информацию по их текущим данным (название, дата основания, классификаторы), а также исторической финансовой отчетности (прибыль, активы, капитализация)
6. Выгрузить структуру собственности и данные об основном индексе для бирж Италии, Франции и России
7. На примере модели долгосрочного ценообразования активов проанализировать динамику доходности акций ПАО Газпром

Шкала оценивания.

Оценка определяется по формуле:

$$I = 0.3 \frac{\sum_{i=1}^n B_i}{n} + 0.7 * Z \quad (1)$$

где n – домашних заданий; B_i – оценка за домашнее задание по 10-ти бальной шкале, Z – оценка за сформированный к зачету файл с выполненными заданиями согласно перечню контрольных вопросов по 10-ти бальной шкале, I – итоговое количество баллов.

10-бальная шкала	Традиционная шкала	«Зачтено»/ «Не зачтено»	Определение
10	Отлично	Зачтено	Данные собраны в полном объеме, навык работы с терминалом Bloomberg по заданной теме получен в полном объеме. Студент может ответить на дополнительные вопросы по проведенной работе.
9	Отлично	Зачтено	Данные собраны в полном объеме, навык работы с терминалом Bloomberg по заданной теме получен в полном объеме. Студент может частично ответить на дополнительные вопросы по проведенной работе.
8	Отлично	Зачтено	Данные собраны с незначительными недостатками, навык работы с терминалом Bloomberg по заданной теме получен в полном объеме. Студент может частично ответить на дополнительные вопросы по проведенной работе.
7	Хорошо	Зачтено	Данные собраны с незначительными недостатками, навык работы с терминалом Bloomberg по заданной теме получен. Студент может частично ответить на дополнительные вопросы по проведенной работе.
6	Хорошо	Зачтено	Данные собраны с незначительными недостатками, навык работы с терминалом Bloomberg по заданной теме

10-бальная шкала	Традиционная шкала	«Зачтено»/«Не зачтено»	Определение
			получен. Студент может частично ответить на некоторые дополнительные вопросы по проведенной работе
5	Удовлетворительно	Зачтено	Данные собраны с недостатками, навык работы с терминалом Bloomberg по заданной теме получен. Студент может частично ответить на некоторые дополнительные вопросы по проведенной работе
4	Удовлетворительно	Зачтено	Данные собраны с недостатками, имеются пропущенные значения. Студент неуверенно комментирует проделанную работу.
3	Неудовлетворительно	Не зачтено	Данные собраны с недостатками, имеются пропущенные значения. Студент неуверенно комментирует проделанную работу, не может дополнить или исправить сделанные ошибки
2	Неудовлетворительно	Не зачтено	Данные собраны частично, имеются пропущенные значения или ошибки. Студент неуверенно комментирует проделанную работу, не может дополнить или исправить сделанные ошибки
1	Неудовлетворительно	Не зачтено	Данные не собраны полностью или лишь малая часть. Студент не комментирует проделанную работу, не может дополнить или исправить сделанные ошибки
0	Неудовлетворительно	Не зачтено	Нарушение академических норм (плагиат и т.п.) или работа не предоставлена

4.4. Методические материалы

Зачет проводится в компьютерной аудитории, с установленным терминалом Bloomberg, с доступом в локальную сеть Академии и глобальную сеть Интернет. Собеседование проводится индивидуально с каждым студентом. В ходе собеседования подводятся итоги успеваемости студента в соответствии с формулой (1) и выполненным к зачету заданием, которое было выдано студенту предварительно и являлось индивидуальным. В том случае, если полученная оценка устраивает студента данная оценка является итоговой. В том случае, если студент не согласен с оценкой, студент должен показать навыки работы с терминалом в процессе выполнения не более трех предложенных заданий. После этого, со студентом проводится собеседование по результатам. В сумме за задание выставляется оценка в соответствии со шкалой оценивания по 10 бальной системе. Итоговая оценка выставляется, как среднеарифметическое от суммы набранного количества баллов с округлением до целого в меньшую сторону.

При решении задач студенту разрешается использовать электронную справочную документацию терминала Bloomberg. Любые остальные электронные ресурсы и источники данных при проведении зачета запрещены. В случае нарушения данных правил студенту выставляется оценка «незачтено» (0 баллов).

При условии набора 4 и более итоговых баллов, компетенция считается сформированной в части указанной в п. 1, по данной дисциплине выставляется оценка «зачтено». В ином случае компетенция считается несформированной, по данной дисциплине выставляется оценка «незачтено».

В случае, если дисциплина полностью или частично проводилась с применением технологий электронного обучения и/или дистанционных технологий, зачет может производиться с использованием системы СДО Академии и применением прокторинга.

5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Домашние задания и примерные варианты зачетной работы для самостоятельной подготовки могут быть опубликованы:

1. В блоге преподавателя на сайте <http://economy.ranepa.ru/prepodavateli/>;
2. Высланы на общую почту группы
3. Размещены на общем диске в локальной сети Академии

Конкретный способ коммуникации со студентами определяется преподавателем.

Для подготовки к практическим занятиям необходимо ознакомиться с рекомендованным материалом, повторить материал предыдущих практических занятий и лабораторных работ. Самостоятельно разобрать ряд функций и особенности их применения. При возникновении вопросов обратиться к преподавателю по электронной почте с указанием конкретной проблемы и (или) прийти к преподавателю на консультацию в установленное время.

Для подготовки письменных домашних заданий необходимо ознакомиться с рекомендованными материалами, повторить материал предыдущих практических занятий.

Оформить работу в соответствии с требованиями:

1. В файле с расчетами:
 - Сохранить предложенную преподавателем структуру файла
 - Сохранить формульный вид запросов и обращений к терминалу
 - Комментарии по заданию располагать на полях
2. Имя файла: *ДЗ номер - фамилия*
3. Тема письма: *ЭиФбак-год ДЗномер Фамилия*
4. Отправить письмо с вложением файла с заданием на электронную почту преподавателя не позднее установленного срока преподавателем.

Для подготовки к контрольным мероприятиям необходимо ознакомиться с рекомендованными материалами, повторить материал предыдущих практических занятий, выполнить типовой вариант зачетной работы. При возникновении вопросов обратиться к преподавателю по электронной почте с указанием конкретной проблемы и (или) прийти к преподавателю на консультацию в установленное время.

Зачётная работа оформляется в соответствии с требованиями:

1. В файле с расчетами:
 - Сохранить предложенную преподавателем структуру файла
 - Сохранить формульный вид запросов и обращений к терминалу
 - Комментарии по заданию располагать на полях
2. Имя файла: *Зачет- (фамилия)*
3. Тема письма: *ЭиФбак-год Зачет Фамилия*
4. Отправить письмо с вложением файла с заданием на электронную почту преподавателя не позднее установленного срока преподавателем.

Самостоятельная работа студентом осуществляется для закрепления изученного материала после практических занятий, для выполнения домашних заданий, для подготовки к зачетной работе, для изучения дополнительных материалов.

№ п/п	Тип занятия	Указания
Тема 1. Введение в работу с терминалом Bloomberg.		
1	Л	Проработка лекционного материала
Тема 2 Экономический анализ компании в терминале Bloomberg		
2	Л	Проработка лекционного материала
3	ПЗ	Разбор и решение задачи из предложенных Подготовка домашнего задания
Тема 3. Финансовый анализ компании в терминале Bloomberg		
4	Л	Проработка лекционного материала
5	ПЗ	Разбор и решение задачи из предложенных Подготовка домашнего задания
Тема 4. Интеграция Bloomberg и Microsoft Excel.		
6	Л	Проработка лекционного материала

№ п/п	Тип занятия	Указания
7	ПЗ	Разбор и решение задачи из предложенных Подготовка домашнего задания
8	ПЗ	Разбор и решение задачи из предложенных Подготовка домашнего задания
Тема 5. Интеграция финансовой теории и терминала Bloomberg		
9	Л	Проработка лекционного материала
10	Л	
11	ПЗ	Разбор и решение задачи из предложенных Подготовка домашнего задания
12	ПЗ	
13	Л	Проработка лекционного материала
14	Л	
15	ПЗ	Разбор и решение задачи из предложенных
16	ПЗ	

6. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", включая перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

6.1. Основная литература.

1. Справочная информация о работе с терминалом Bloomberg

6.2. Дополнительная литература.

Не предусмотрена

6.3. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы.

Отдельное обеспечение не предусмотрено.

6.4. Нормативные правовые документы.

Не предусмотрены.

6.3. Интернет-ресурсы, справочные системы.

1. Агентство Блумберг <http://www.bloomberg.com/>
2. <http://lms.ranepa.ru>

7. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы

Для проведения занятий необходим компьютерный класс, оснащённый компьютерами под управлением операционной системой Windows, с доступом в интернет и в терминал Bloomberg, а также с установленными пакетами программ: Adobe Reader, MS Office и дополнительно программами эконометрического анализа и анализа многомерных данных. Компьютер преподавателя, дополнительно, должен быть оснащен проектором и программным обеспечением Microsoft PowerPoint и Adobe Reader.