Приложение 10 ОП ВО

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

СТАТИСТИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

Автор: к.э.н., доцент, Е.С. Дарда
Код и наименование направления подготовки: 38.03.02 Менеджмент
Профиль: Финансовый менеджмент
Квалификация (степень) выпускника: бакалавр
Форма обучения: очная

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 информаци. 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 страхование. 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 инвестиционного

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 «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. Рукосуев— Электрон. текстовые данные.— М.: Дашков и К, 2014.— 473 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/62453.html
2. Миркин Я.М., Добашина И.В., Салин В.Н. Статистика финансовых рынков. – М. : КНОРУС, 2014. https://e.lanbook.com/book/5537#authors
3. Пробин П.С. Финансовые рынки [Электронный ресурс]: учебное пособие для студентов вузов обучающихся по направлению подготовки «Экономика» (квалификация (степень) «бакалавр»)/ П.С. Пробин, Н.А. Проданова— Электрон. текстовые данные.— М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2014.— 175 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/34528.html.— ЭБС «IPRbooks»