Приложение 10 ОП ВО

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ СТАТИСТИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ ФОНДОВОГО РЫНКА

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

План курса:

Тема 1. Предмет, метод и задачи статистического анализа 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. Экспертный подход в исследовании тенденций на рынке ценных бумаг. Сущность фундаментального анализа и основные его направления. Технический анализ и его принципы. П

Тема 2. Графический анализ тенденций фондового рынка.

Статистические графики в анализе тенденций и распределений фондового рынка: линейный график, спиральная и радиальная диаграмма. График пиков, поминутный, почасовой, дневной, понедельный, помесячный, погодовой графики. Линейные чарты с арифметической и логарифмической шкалами. Точечные диаграммы (крестики-нолики), их особенности и основные направления анализа. Гистограммы (биржевые графики).

Японские свечи: принципы построения и интерпретации. Виды свечей.

Тема 3. Статистический анализ структуры фондового рынка.

Понятие структуры. Виды структур. Показатели структурных изменений. Абсолютный прирост удельного веса. Темп роста удельного веса. Средний абсолютный прирост удельного веса. Средний темп роста удельного веса. Среднее значение удельного веса.

Линейный коэффициент абсолютных структурных сдвигов. Квадратический коэффициент абсолютных структурных сдвигов. Линейный коэффициент относительных структурных сдвигов. Квадратический коэффициент относительных структурных сдвигов. Обобщающие коэффициенты структурных изменений за несколько последовательных периодов.

Понятия «концентрация» и «централизация» рынка. Кривая концентрации Лоренца. Коэффициент Джини. Индекс Герфендаля-Хиршмана.

Тема 4. Скользящие средние в анализе тенденций фондового рынка.

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 5. Оценка колеблемости рынка.

Показатели колеблемости динамических рядов. Понятие волатильности. Виды волатильности и основные принципы расчета. Интерпретация показателей волатильности.

Тема 6. Фондовые индексы.

Понятие фондового индекса. Виды фондовых индексов. Основные принципы расчета фондовых индексов. Основные мировые фондовые индексы. Основные факторы влияющие на фондовые индексы. Особенности влияния политических факторов на фондовый рынок.

Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:

В ходе реализации дисциплины «Статистический анализ фондового рынка» используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

Предмет, метод и задачи статистического анализа фондового рынка	Опрос
Графический анализ тенденций фондового рынка	Тестирование, расчетное задание
Статистический анализ структуры фондового рынка	Опрос, расчетное задание, контрольная работа
Скользящие средние в анализе тенденций фондового рынка	Опрос, расчетное задание
Оценка колеблемости рынка.	Опрос, расчетное задание
Фондовые индексы	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»