


Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф – Рабочая программа дисциплины		



УТВЕРЖДЕНО  
 решением Ученого совета ИЭиБ  
 от 20 июня 2024 г., протокол № 10 / 271  
 Председатель \_\_\_\_\_ И.Б.Романова  
 « 20 » июня 2024 г.

## РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина	Анализ фондового рынка
Факультет	Экономики
Кафедра	Кафедра финансов и кредита
Курс	1

Направление (специальность): 38.04.08 Финансы и кредит

Направленность (профиль/специализация): Финансовый менеджмент

Форма обучения: очная

Дата введения в учебный процесс УлГУ: 01.09.2024 г.


Программа актуализирована на заседании кафедры: протокол № \_\_\_\_\_ от \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.


Программа актуализирована на заседании кафедры: протокол № \_\_\_\_\_ от \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

Программа актуализирована на заседании кафедры: протокол № \_\_\_\_\_ от \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

Сведения о разработчиках:

ФИО	КАФЕДРА	Должность, ученая степень, звание
Тимагина Юлия Анатольевна	Кафедра финансов и кредита	Доцент, Кандидат экономических наук, Доцент

<b>СОГЛАСОВАНО</b>	
Заведующий кафедрой «Финансы и кредит»	выпускающей
 _____ / Ширяева Н.В./	
« 19 » июня 2024 г.	

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф – Рабочая программа дисциплины		

## 1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ Цели освоения

### дисциплины:

Формирование у магистрантов целостного представления о ценных бумагах, современных подходов к анализу фондового рынка.

### Задачи освоения дисциплины:

- изучение основных подходов к анализу фондового рынка;
- овладение навыками работы с финансовой информацией, основными индикаторами экономической статистики, публикуемыми информационными агентствами, центральными банками и правительствами, а также данными финансовой корпоративной отчетности.
- выработка у магистров системного понимания организации фондового рынка. ;
- развитие навыков по умению анализировать действующее законодательство и профессионально применять его нормы к конкретным управленческим ситуациям;
- обучение способам оценки эффективности принимаемых управленческих решений и разработанных рекомендаций.

## 2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП


Дисциплина «Анализ фондового рынка» относится к числу дисциплин блока ФТД, предназначенного для студентов, обучающихся по направлению: 38.04.08 Финансы и кредит.

В процессе изучения дисциплины формируются компетенции: ПК-2.

Основные положения дисциплины используются в дальнейшем при изучении таких дисциплин как: Инвестиционный менеджмент, Преддипломная практика, Управление инвестиционными проектами в условиях риска и неопределенности, Организация финансового планирования на предприятии, Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы, Управление портфелем инвестиций, Бюджетирование в системе управления финансами организаций, Анализ фондового рынка.

## 3. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ, СООТНЕСЕННЫХ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОСНОВНОЙ ПРОФЕССИОНАЛЬНОЙ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Код и наименование реализуемой компетенции	Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с индикаторами достижения компетенций
ПК-2 Способен осуществлять консультирование по составлению финансового плана и формированию инвестиционного портфеля.	<b>знать:</b> Знать экономические и юридические аспекты инвестиционной деятельности в целях анализа фондового

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф – Рабочая программа дисциплины		

Код и наименование реализуемой компетенции	Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с индикаторами достижения компетенций
	рынка. <b>уметь:</b> Уметь рассчитывать стоимость финансовых решений в ходе анализа фондового рынка. <b>владеть:</b> Владеть навыками разъяснения клиенту экономических и правовых последствий финансовых решений при анализе фондового рынка.

#### 4. ОБЩАЯ ТРУДОЕМКОСТЬ ДИСЦИПЛИНЫ

**4.1. Объем дисциплины в зачетных единицах (всего): 2 ЗЕТ 4.2. Объем дисциплины по видам учебной работы (в часах): 72 часа**


Форма обучения: очная

Вид учебной работы	Количество часов (форма обучения <u>очная</u> )	
	Всего по плану	В т.ч. по семестрам
		2
<b>1</b>	<b>2</b>	<b>3</b>
Контактная работа обучающихся с преподавателем в соответствии с УП	28	28
Аудиторные занятия:	28	28
Лекции	14	14
Семинары и практические занятия	14	14
Лабораторные работы, практикумы	-	-
Самостоятельная работа	44	44
Форма текущего контроля знаний и контроля самостоятельной работы: тестирование, контр. работа, коллоквиум, реферат и др. (не менее 2 видов)	Тестирование, Проверка решения задачи (выполнения задания), Устный опрос	Тестирование, Проверка решения задачи (выполнения задания), Устный опрос
Курсовая работа	-	-
Виды промежуточной аттестации (экзамен, зачет)	Зачет (0)	Зачет
Всего часов по дисциплине	72	72


#### 4.3. Содержание дисциплины. Распределение часов по темам и видам учебной работы

Форма обучения: очная

Всего	Виды учебных занятий

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф – Рабочая программа дисциплины		

Название разделов и тем		Аудиторные занятия			Занятия в интерактивной форме	Самостоятельная работа	Форма текущего контроля знаний
		Лекции	Практические занятия, семинары	Лабораторные работы, практикумы			
1	2	3	4	5	6	7	8
<b>Раздел 1. Фундаментальные основы фондового рынка</b>							
Тема 1.1. Экономические основы фондового рынка	18	2	2	0	0	14	Тестирование, Устный опрос, Проверка решения задачи (выполнение задания)
Тема 1.2. Ценные бумаги и производные финансовые инструменты	18	4	4	0	0	10	Тестирование, Устный опрос, Проверка решения задачи (выполнение задания)
<b>Раздел 2. Подходы к анализу фондового рынка</b>							
Тема 2.1. Фундаментальный анализ фондового рынка	18	4	4	0	0	10	Тестирование, Устный опрос, Проверка решения задачи (выполнение задания)
Тема 2.2. Технический анализ фондового рынка	18	4	4	0	0	10	Тестирование, Устный опрос, Проверка решения задачи (выполнение задания)
<b>Итого подлежит изучению</b>	<b>72</b>	<b>14</b>	<b>14</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>44</b>	

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф – Рабочая программа дисциплины		

## **Раздел 1. Фундаментальные основы фондового рынка**

### **Тема 1.1. Экономические основы фондового рынка**

Реальный и фиктивный капитал. Происхождение, сущность и формы фиктивного капитала. Понятие и функции фондового рынка в макро - и микроэкономике. Структура фондового рынка. Классификация фондового рынка. Первичный и вторичный фондовый рынок. Спрос и предложение на фондовом рынке. Фондовая биржа: основные принципы деятельности. Формирование фондового рынка в России.

### **Тема 1.2. Ценные бумаги и производные финансовые инструменты**

Экономическая сущность ценной бумаги. Виды ценных бумаг и доходы от них. Экономическое содержание производных финансовых инструментов. Виды производных финансовых инструментов.

## **Раздел 2. Подходы к анализу фондового рынка**

### **Тема 2.1. Фундаментальный анализ фондового рынка**

Основные положения фундаментального анализа, его терминология. Фундаментальные факторы. Индикаторы. Модель случайных (колеблющихся) гипотез. Макроэкономический анализ. Анализ отраслей. Корпоративный анализ.

### **Тема 2.2. Технический анализ фондового рынка**

Основные положения (принципы) технического анализа. Инструменты технического анализа. Графические методы технического анализа. Графики цен. Модели (фигуры) цен. Количественные методы технического анализа. Индикаторы. Осцилляторы.

## **6. ТЕМЫ ПРАКТИЧЕСКИХ И СЕМИНАРСКИХ ЗАНЯТИЙ**


### **Раздел 1. Фундаментальные основы фондового рынка**

#### **Тема 1.1. Экономические основы фондового рынка** Вопросы к

теме:

Очная форма

1. Что Вы понимаете под реальным и фиктивным капиталом?
2. В чем заключаются происхождение, сущность и формы фиктивного капитала?
3. Дайте понятие и функции фондового рынка в макро - и микроэкономике.
4. Опишите структуру фондового рынка.
5. Какие вы знаете классификации фондового рынка?
6. В чем заключается суть первичного и вторичного фондового рынка?
7. Каковы спрос и предложение на фондовом рынке?
8. Охарактеризуйте фондовую биржу, основные принципы ее деятельности. 5 / 11

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф – Рабочая программа дисциплины		

9. Какой из этапов развития фондового рынка в России, по вашему мнению, является наиболее значимым?

## **Тема 1.2. Ценные бумаги и производные финансовые инструменты** Вопросы к теме:

Очная форма

1. Что понимается под ценной бумагой?
2. Дайте основные подходы к определению понятия ценной бумаги.
3. Охарактеризуйте экономическую сущность ценной бумаги.
4. Какие существуют основные виды ценных бумаг?
5. Какие виды доходов по ценным бумагам Вы знаете?
6. Что такое производные финансовые инструменты?
7. В чем заключается экономическое содержание производных финансовых инструментов.
8. Назовите основные виды производных финансовых инструментов.

## **Раздел 2. Подходы к анализу фондового рынка** Тема 2.1.

### **Фундаментальный анализ фондового рынка** Вопросы к

теме:

Очная форма


1. Охарактеризуйте основные положения фундаментального анализа,
2. Что такое внутренняя (истинная) стоимость акции?
3. Как соотносятся внутренняя и рыночная цена акции?
4. Дайте характеристику макроэкономического анализа.
5. Опишите суть анализа отрасли.
6. Опишите этапы корпоративного анализа.
7. Какие финансовые коэффициенты применяются в фундаментальном анализе?
8. Какие методы используются в фундаментальном анализе?

### **Тема 2.2. Технический анализ фондового рынка** Вопросы к

теме:

Очная форма

1. Назовите основные положения (принципы) технического анализа.
2. Какие Вы можете назвать инструменты технического анализа?
3. Охарактеризуйте графические методы технического анализа.
4. Какие виды графиков цен Вы знаете?
5. Что такое модели (фигуры) цен?
6. Охарактеризуйте количественные методы технического анализа.
7. Что такое индикаторы и осцилляторы?

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф – Рабочая программа дисциплины		

### **7. ЛАБОРАТОРНЫЕ РАБОТЫ, ПРАКТИКУМЫ**


Данный вид работы не предусмотрен УП.

### **8. ТЕМАТИКА КУРСОВЫХ, КОНТРОЛЬНЫХ РАБОТ, РЕФЕРАТОВ**

Данный вид работы не предусмотрен УП.

### **9. ПЕРЕЧЕНЬ ВОПРОСОВ К ЗАЧЕТУ**

1. Происхождение, сущность и формы фиктивного капитала.
2. Понятие и функции фондового рынка в макро - и микроэкономике.
3. Структура фондового рынка.
4. Классификация фондового рынка.
5. Спрос и предложение на фондовом рынке.
6. Фондовая биржа: основные принципы деятельности.
7. Экономическая сущность ценной бумаги.
8. Виды ценных бумаг и доходы от них.
9. Экономическое содержание производных финансовых инструментов.
10. Виды производных финансовых инструментов.
11. Основные положения фундаментального анализа, его терминология.
12. Фундаментальные факторы.
13. Модель случайных (колеблющихся) гипотез.
14. Макроэкономический анализ.
15. Анализ отраслей.
16. Корпоративный анализ.
17. Основные положения (принципы) технического анализа.
18. Инструменты технического анализа.
19. Графические методы технического анализа.
20. Количественные методы технического анализа.

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф – Рабочая программа дисциплины		

## 10. САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА ОБУЧАЮЩИХСЯ


*Содержание, требования, условия и порядок организации самостоятельной работы обучающихся с учетом формы обучения определяются в соответствии с «Положением об организации самостоятельной работы обучающихся», утвержденным Ученым советом УлГУ (протокол №8/268 от 26.03.2019г.).*

*По каждой форме обучения: очная/заочная/очно-заочная заполняется отдельная таблица*

Форма обучения: очная

Название разделов и тем	Вид самостоятельной работы (проработка учебного материала, решение задач, реферат, доклад, контрольная работа, подготовка к сдаче зачета, экзамена и др).	Объем в часах	Форма контроля (проверка решения задач, реферата и др.)
<b>Раздел 1. Фундаментальные основы фондового рынка</b>			
Тема 1.1. Экономические основы фондового рынка	Проработка учебного материала с использованием ресурсов учебнометодического и информационного обеспечения дисциплины.	14	Тестирование
Название разделов и тем	Вид самостоятельной работы (проработка учебного материала, решение задач, реферат, доклад, контрольная работа, подготовка к сдаче зачета, экзамена и др).	Объем в часах	Форма контроля (проверка решения задач, реферата и др.)
Тема 1.2. Ценные бумаги и производные финансовые инструменты	Проработка учебного материала с использованием ресурсов учебнометодического и информационного обеспечения дисциплины.	10	Тестирование
<b>Раздел 2. Подходы к анализу фондового рынка</b>			
Тема 2.1. Фундаментальный анализ фондового рынка	Проработка учебного материала с использованием ресурсов учебнометодического и информационного обеспечения дисциплины.	10	Тестирование
Тема 2.2. Технический анализ фондового рынка	Проработка учебного материала с использованием ресурсов учебнометодического и информационного обеспечения дисциплины.	10	Тестирование



Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф – Рабочая программа дисциплины		

## 11. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

### а) Список рекомендуемой литературы основная

1. Алехин Б. И. Рынок ценных бумаг : учебник и практикум / Б. И. Алехин. - 2-е изд. ; испр. и доп. Москва : Юрайт, 2024. - 497 с. - (Высшее образование). - URL: <https://urait.ru/bcode/538065> . - Режим доступа: Электронно-библиотечная система Юрайт, для авториз. пользователей. - ISBN 978-5-534-05683-9 : 1949.00. / .— ISBN 0\_523968

2. Белов В. А. Ценные бумаги в коммерческом обороте: курс лекций : учебное пособие / В. А. Белов. - Москва : Юрайт, 2024. - 306 с. - (Высшее образование). - URL: <https://urait.ru/bcode/540265> . - Режим доступа: Электронно-библиотечная система Юрайт, для авториз. пользователей. - ISBN 978-5-534-05424-8 : 1269.00. / .— ISBN 0\_521490 **дополнительная**

1. Иванченко И. С. Производные финансовые инструменты: оценка стоимости деривативов : учебник / И. С. Иванченко. - Москва : Юрайт, 2024. - 261 с. - (Высшее образование). - URL: <https://urait.ru/bcode/542631> . - Режим доступа: Электронно-библиотечная система Юрайт, для авториз. пользователей. - ISBN 978-5-534-11386-0 : 1109.00. / .— ISBN 0\_524784

2. Михайленко М. Н. Рынок ценных бумаг : учебник и практикум / М. Н. Михайленко. - 3-е изд. ; пер. и доп. - Москва : Юрайт, 2024. - 340 с. - (Высшее образование). - URL: <https://urait.ru/bcode/536458> . - Режим доступа: Электронно-библиотечная система Юрайт, для авториз. пользователей. - ISBN 978-5-534-16066-6 : 1389.00. / .— ISBN 0\_523970

3. Рынок ценных бумаг : учебник / Н. И. Берзон, А. Ю. Аршавский, А. В. Галанова [и др.]. - 5-е изд. ; пер. и доп. - Москва : Юрайт, 2024. - 514 с. - (Высшее образование). - URL: <https://urait.ru/bcode/535435> . - Режим доступа: Электронно-библиотечная система Юрайт, для авториз. пользователей. - ISBN 978-5-534-11196-5 : 2009.00. / .— ISBN 0\_523969 **учебно-методическая**


1. Тимагина Ю. А. Анализ фондового рынка : методические рекомендации для практических, семинарских занятий и самостоятельной работы студентам направления 38.04.08 Финансы и кредит / Ю. А. Тимагина. - 2023. - 20 с. - Неопубликованный ресурс. - URL: <http://lib.ulsu.ru/MegaPro/Download/MObject/14741>. - Режим доступа: ЭБС УлГУ. - Текст : электронный. / .— ISBN 0\_504156.

### б) Программное обеспечение

- Операционная система "Альт образование"
- Офисный пакет "Мой офис"

### в) Профессиональные базы данных, информационно-справочные системы

#### 1. Электронно-библиотечные системы:

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф – Рабочая программа дисциплины		

1.1. Цифровой образовательный ресурс IPRsmart : электронно-библиотечная система : сайт /ООО Компания «Ай Пи Ар Медиа». - Саратов, [2024]. – URL: <http://www.iprbookshop.ru>. – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. - Текст : электронный.

1.2. Образовательная платформа ЮРАЙТ : образовательный ресурс, электронная библиотека : сайт / ООО Электронное издательство ЮРАЙТ. – Москва, [2024]. - URL: <https://urait.ru>. – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. - Текст : электронный.

1.3. База данных «Электронная библиотека технического ВУЗа (ЭБС «Консультант студента») : электронно-библиотечная система : сайт / ООО Политехресурс. – Москва, [2024]. – URL: <https://www.studentlibrary.ru/cgi-bin/mb4x>. – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. – Текст : электронный.

1.4. Консультант врача. Электронная медицинская библиотека : база данных : сайт / ООО Высшая школа организации и управления здравоохранением-Комплексный медицинский консалтинг. – Москва, [2024]. – URL: <https://www.rosmedlib.ru>. – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. – Текст : электронный.

1.5. Большая медицинская библиотека : электронно-библиотечная система : сайт / ООО Букап. –Томск, [2024]. – URL: <https://www.books-up.ru/ru/library/> . – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. – Текст : электронный.

1.6. ЭБС Лань : электронно-библиотечная система : сайт / ООО ЭБС Лань. – Санкт-Петербург,[2024]. – URL: <https://e.lanbook.com>. – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. – Текст : электронный.

1.7. ЭБС **Znanium.com** : электронно-библиотечная система : сайт / ООО Знаниум. - Москва, [2024]. - URL: <http://znanium.com> . – Режим доступа : для зарегистрир. пользователей. - Текст : электронный.


**2. КонсультантПлюс** [Электронный ресурс]: справочная правовая система. /ООО «Консультант Плюс» - Электрон. дан. - Москва : КонсультантПлюс, [2024].

**3. eLIBRARY.RU:** научная электронная библиотека : сайт / ООО «Научная Электронная Библиотека». – Москва, [2024]. – URL: <http://elibrary.ru>. – Режим доступа : для авториз. пользователей. – Текст : электронный

**4. Федеральная государственная информационная система «Национальная электронная библиотека» :** электронная библиотека : сайт / ФГБУ РГБ. – Москва, [2024]. – URL: <https://нэб.рф>. – Режим доступа : для пользователей научной библиотеки. – Текст : электронный.

**5. Российское образование :** федеральный портал / учредитель ФГАУ «ФИЦТО». – URL: <http://www.edu.ru>. – Текст : электронный.

**6. Электронная библиотечная система УлГУ :** модуль «Электронная библиотека» АБИС МегаПРО / ООО «Дата Экспресс». – URL: <http://lib.ulsu.ru/MegaPro/Web>. – Режим доступа : для пользователей научной библиотеки. – Текст : электронный.

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф – Рабочая программа дисциплины		

## 12. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ:

Аудитории для проведения лекций, семинарских занятий, для выполнения лабораторных работ и практикумов, для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации, курсового проектирования, групповых и индивидуальных консультаций (*выбрать необходимое*)

Аудитории укомплектованы специализированной мебелью, учебной доской. Аудитории для проведения лекций оборудованы мультимедийным оборудованием для представления информации большой аудитории. Помещения для самостоятельной работы оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде, электронно-библиотечной системе. Перечень оборудования, используемого в учебном процессе:

- Мультимедийное оборудование: компьютер/ноутбук, экран, проектор/телевизор
- Компьютерная техника

## 13. СПЕЦИАЛЬНЫЕ УСЛОВИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ

В случае необходимости, обучающимся из числа лиц с ограниченными возможностями здоровья (по заявлению обучающегося) могут предлагаться одни из следующих вариантов восприятия информации с учетом их индивидуальных психофизических особенностей:

- для лиц с нарушениями зрения: в печатной форме увеличенным шрифтом; в форме электронного документа; в форме аудиофайла (перевод учебных материалов в аудиоформат); в печатной форме на языке Брайля; индивидуальные консультации с привлечением тифлосурдопереводчика; индивидуальные задания и консультации;
- для лиц с нарушениями слуха: в печатной форме; в форме электронного документа; видеоматериалы с субтитрами; индивидуальные консультации с привлечением сурдопереводчика; индивидуальные задания и консультации;
- для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата: в печатной форме; в форме электронного документа; в форме аудиофайла; индивидуальные задания и консультации.

В случае необходимости использования в учебном процессе частично/исключительно дистанционных образовательных технологий, организация работы ППС с обучающимися с ОВЗ и инвалидами предусматривается в электронной информационно-образовательной среде с учетом их индивидуальных психофизических особенностей.

Разработчик	Доцент, Кандидат экономических наук, Доцент	Тимагина Юлия Анатольевна
	Должность, ученая степень, звание	ФИО