

АНАЛИЗ РОССИЙСКОГО И МЕЖДУНАРОДНОГО РЫНКА АКЦИЙ

ФИО преподавателя: доцент, к.э.н. Липунцов Юрий Павлович.

Место дисциплины в учебном плане: дисциплина по выбору, 4 триместр.

В дисциплине приводятся основные источники информации о фондовом рынке, представляется модель агрегирования данных, поступающих из разных источников. Модель реализована в виде базы данных, информация которой автоматически обновляется по мере поступления данных с биржевых площадок, финансовой отчетности предприятий, дивидендной истории и прочих разделов. Студентам предоставляется индивидуальный удаленный доступ в базе данных, что позволяет выполнять задания в классах и с домашних компьютеров. Используя базу данных, студенты во время изучения дисциплины реализуют собственную модель оценки инвестиционной привлекательности эмитентов, которая может включать мультипликаторы фондового рынка, финансовые коэффициенты, показатели сектора, региона, натуральные индикаторы. Для проведения сортировки по совокупности индикаторов применяется свертывание в интегральный показатель инвестиционной привлекательности инструмента. Итоговый портфель формируется из инструментов российского и зарубежных рынков. В конце изучения дисциплины проводится защита сформированных портфелей с обсуждением аналитической модели и выбранной стратегии инвестирования. В зависимости от количества студентов работа по разработке и реализации аналитической модели может быть организована в группах.

Краткое содержание дисциплины: информационная модель финансового сектора, принципы формирования информационной модели, агрегированное представление информации по рынку акций, модели оценки стоимости компании, оценка отрасли и региона, оценка финансовых характеристик эмитента, оценка доходности эмитента, агрегированная оценка российского эмитента.

Общая трудоемкость дисциплины составляет: 3 зачетные единицы, 108 часа.

Язык преподавания: русский.

Итоговый контроль по дисциплине проводится в форме защиты проектов.