

НАЗВАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ «Анализ российского и международного рынка акций»

ФИО преподавателя: Липунцов Ю.П.

Цель освоения дисциплины: научить студентов работать с информационными моделями фондового рынка и реализовывать методику аналитической обработки данных.

Место дисциплины в учебном плане: по выбору, 4-й триместр

Краткое содержание дисциплины: В курсе 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 прохождения курса 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 курса 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.

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

Итоговый контроль по дисциплине проводится в форме экзамена.