Приложение 10 ОП ВО

**АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ**

**Б1.В.ДВ.13.1 СТАТИСТИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ**

**Автор:** к.э.н., доцент, Е.С. Дарда

**Код и наименование направления подготовки:** 38.03.02 Менеджмент

**Профиль:** Инвестиционный 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 Б1.В.ДВ.13.1 «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. Миркин Я.М., Добашина И.В., Салин В.Н. Статистика финансовых рынков. – М.: КНОРУС, 2016.
2. Саблина Е. Статистика финансов. - М.: Издательский Дом "ИНФРА-М", 2017.
3. Громыко Г.Л. Теория статистики. Практикум. – М.: Издательский Дом "ИНФРА-М", 2015.