

**Федеральное государственное автономное образовательное учреждение  
высшего образования «Российский университет дружбы народов»**

**Экономический факультет**

---

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

**Анализ и прогнозирование мировых финансовых рынков**

---

**Рекомендована МСЧН для направления подготовки/специальности:**

38.04.01 Экономика

---

**Освоение дисциплины ведется в рамках реализации основной профессиональной образовательной программы высшего образования (ОП ВО):**

МФБ

---

2022 г.

## 1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Целью освоения дисциплины «Анализ и прогнозирование мировых финансовых рынков» является получение знаний и развитие навыков осмысленного применения инструментальных методов анализа мировых финансовых рынков с акцентом на рынок ценных бумаг.

## 2. ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Освоение дисциплины «Анализ и прогнозирование мировых финансовых рынков» направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций (части компетенций):

Таблица 2.1. Перечень компетенций, формируемых у обучающихся при освоении дисциплины (результаты освоения дисциплины)

Шифр	Компетенция	Индикаторы достижения компетенции (в рамках данной дисциплины)
ОПК-2	Способность применять продвинутое инструментальные методы экономического анализа в прикладных и/или фундаментальных исследованиях	ОПК-2.1 Обладает знаниями о продвинутом инструментальных методах экономического анализа. ОПК-2.2 Умеет применять знания о продвинутом инструментальных методах экономического и финансового анализа при проведении прикладных и/или фундаментальных исследований.
ОПК-4	Способность принимать экономически и финансово обоснованные организационно - управленческие решения в профессиональной деятельности и нести за них ответственность	ОПК-4.1 Разрабатывает организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности ОПК-4.2 Владеет навыками аргументированного убеждения в поддержку предлагаемых финансово-экономических и организационно-управленческих решений ОПК-4.3 Контролирует результаты выполнения принимаемых финансово-экономических и организационно-управленческих решений
ОПК-5	Способность использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач	ОПК-5.1 Знает современные информационные технологии и программные средства, применяемые при решении профессиональных задач. ОПК-5.2 Умеет среди современных информационных технологий и программных средств выбирать наиболее эффективные для решения профессиональных задач. ОПК-5.3 Владеет в полной мере навыками решения стандартных задач профессиональной деятельности с применением информационных технологий и программных средств.

<b>Шифр</b>	<b>Компетенция</b>	<b>Индикаторы достижения компетенции (в рамках данной дисциплины)</b>
ПК-2	Анализ состояния рынка ценных бумаг, рынка производных финансовых инструментов	ПК-2.1 Производит экономический и финансовый анализ компании, финансового рынка и его отдельных сегментов ПК-2.2 Знает методы и инструменты экономического и финансового анализа ПК-2.3 Методы и инструменты оценки эмитента и ценных бумаг эмитента
ПК-3	Мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков	ПК-3.1 Знает конъюнктуру и механизмы функционирования финансовых рынков, базовые банковские, страховые и инвестиционные продукты и услуги и их характеристики ПК-3.2 Производит информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг ПК-3.3 Получает, интерпретирует и документирует результаты исследований конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков

### 3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОП ВО

Дисциплина «Анализ и прогнозирование мировых финансовых рынков» относится к обязательной части блока Б1 ОП ВО (вариативная компонента).

В рамках ОП ВО обучающиеся также осваивают другие дисциплины и/или практики, способствующие достижению запланированных результатов освоения дисциплины «Анализ и прогнозирование мировых финансовых рынков».

Таблица 3.1. Перечень компонентов ОП ВО, способствующих достижению запланированных результатов освоения дисциплины

<b>Шифр</b>	<b>Наименование компетенции</b>	<b>Предшествующие дисциплины/модули, практики*</b>	<b>Последующие дисциплины/модули, практики*</b>
ОПК-2	Способность применять продвинутые инструментальные методы экономического анализа в прикладных и/или фундаментальных исследованиях	Международные финансы Макроэкономика (продвинутый уровень) Эконометрика (продвинутый уровень)	Оценка бизнеса Прикладные аспекты инвестиционного анализа Управление инвестиционным портфелем международных компаний Мировая биржевая торговля Исламские финансы Прикладные корпоративные финансы Научно-исследовательская работа

Шифр	Наименование компетенции	Предшествующие дисциплины/модули, практики*	Последующие дисциплины/модули, практики*
ОПК-4	Способность принимать экономически и финансово обоснованные организационно - управленческие решения в профессиональной деятельности и нести за них ответственность		Подготовка ВКР Оценка бизнеса Тарифно-таможенное регулирование Прикладные аспекты инвестиционного анализа Управление инвестиционным портфелем международных компаний Мировая биржевая торговля Прикладные корпоративные финансы Doing Business in Advanced and Emerging Economies / Ведение бизнеса на развитых и развивающихся рынках Международное управление рисками Практика по профилю профессиональной деятельности (экономическая) Практика по профилю профессиональной деятельности (аналитическая) Преддипломная практика
ОПК-5	Способность использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач	Эконометрика (продвинутый уровень)	Оценка бизнеса Международные стандарты финансовой отчетности и аудита Прикладные аспекты инвестиционного анализа Управление инвестиционным портфелем международных компаний Мировая биржевая торговля Прикладные корпоративные финансы Doing Business in Advanced and Emerging Economies / Ведение бизнеса на развитых и развивающихся рынках Международное управление рисками

Шифр	Наименование компетенции	Предшествующие дисциплины/модули, практики*	Последующие дисциплины/модули, практики*
			Initial Public Offering (IPO) / Первичное публичное предложение Подготовка ВКР
ПК-2	Анализ состояния рынка ценных бумаг, рынка производных финансовых инструментов		Прикладные аспекты инвестиционного анализа Agile / Методологии гибкого управления проектами Environmental, Social, and Corporate Governance (ESG) / Экологическое, социальное и корпоративное управление Мировая биржевая торговля
ПК-3	Мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков	Международные финансы	Исламские финансы Initial Public Offering (IPO) / Первичное публичное предложение

\* - заполняется в соответствии с матрицей компетенций и СУП ОП ВО

#### 4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ И ВИДЫ УЧЕБНОЙ РАБОТЫ

Общая трудоемкость дисциплины «Анализ и прогнозирование мировых финансовых рынков» составляет 2 зачетные единицы.

Таблица 4.1. Виды учебной работы по периодам освоения ОП ВО для **ОЧНОЙ** формы обучения

Вид учебной работы	ВСЕГО, ак.ч.	Семестр(-ы)			
		2			
<i>Контактная работа, ак.ч.</i>	36	36			
в том числе:					
Лекции (ЛК)	18	18			
Лабораторные работы (ЛР)	18	18			
Практические/семинарские занятия (СЗ)					
<i>Самостоятельная работа обучающихся, ак.ч.</i>	18	18			
<i>Контроль (экзамен/зачет с оценкой), ак.ч.</i>	18	18			
<b>Общая трудоемкость дисциплины</b>	ак.ч.	<b>72</b>	<b>72</b>		
	зач.ед.	<b>2</b>	<b>2</b>		

#### 5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Таблица 5.1. Содержание дисциплины (модуля) по видам учебной работы

Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела (темы)	Вид учебной работы*
Раздел 1. Сегменты финансового рынка	Сегментация финансовых рынков. Денежный рынок. Индикативные индикаторы денежного рынка. Публичный долговой рынок. Инструменты глобального долгового рынка. Структура и инструменты фондового рынка.	ЛК, СЗ
Раздел 2. Методы моделирования и прогнозирования индикаторов фондовых и валютных рынков	Методы визуально-графического анализа. Анализ структуры временного ряда. Методы сглаживания. Моделирование тенденций ARMA-модели. Единичные корни. Тесты на единичный корень. Условная гетероскедастичность. ARCH и GARCH модели.	ЛК, СЗ
Раздел 3. Количественные модели рынка капитала	Оценивание доходности акций по модели CAPM. Модель Гордона (DDM). Модель DDM и CAPM для оценки справедливой стоимости акции	ЛК, СЗ

\* - заполняется только по **ОЧНОЙ** форме обучения: ЛК – лекции; ЛР – лабораторные работы; СЗ – семинарские занятия.

## 6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Таблица 6.1. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Тип аудитории	Оснащение аудитории	Специализированное учебное/лабораторное оборудование, ПО и материалы для освоения дисциплины (при необходимости)
Лекционная	Аудитория для проведения занятий лекционного типа, оснащенная комплектом	Компьютер, мультимедийный

Тип аудитории	Оснащение аудитории	Специализированное учебное/лабораторное оборудование, ПО и материалы для освоения дисциплины (при необходимости)
	специализированной мебели; доской (экраном) и техническими средствами мультимедиа презентаций.	проектор, доступ в интернет
Компьютерный класс	Компьютерный класс для проведения занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, оснащенная персональными компьютерами (в количестве 21 шт.), доской (экраном) и техническими средствами мультимедиа презентаций.	Персональные компьютеры с установленным ПО (Excel, Eviews, R) и доступом в интернет
Для самостоятельной работы обучающихся	Аудитория для самостоятельной работы обучающихся (может использоваться для проведения семинарских занятий и консультаций), оснащенная комплектом специализированной мебели и компьютерами с доступом в ЭИОС.	

\* - аудитория для самостоятельной работы обучающихся указывается

### **ОБЯЗАТЕЛЬНО!**

## **7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ**

### *Основная литература:*

1. Основы портфельного инвестирования: учебник для бакалавриата и магистратуры / Т. В. Никитина, А. В. Репета-Турсунова, М. Фрёммель, А. В. Ядрин. — 2-е изд., испр. и доп. — М. : Издательство Юрайт, 2019
2. Эконометрика в задачах и решениях [Текст/электронный ресурс] : Учебное пособие для магистров / С.А. Балашова, И.В. Лазанюк. – 2-е изд. -Электронные текстовые данные. - М. : Изд-во РУДН, 2017. - 188 с. : ил. - ISBN 978-5-209-05771-0 : 105.19.
3. Фондовый рынок: курс для начинающих / науч. ред. А. Ильин ; пер. В. Ионов. - 3-е изд. - Москва : Альпина Паблишерз, 2016. - 278 с. : схем., табл., ил. - (Reuters для финансистов). - ISBN 978-5-9614-1460-8 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=85846> (17.09.2018).

### *Дополнительная литература:*

1. Подкорытова, О. А. Анализ временных рядов : учеб. пособие для бакалавриата и магистратуры / О. А. Подкорытова, М. В. Соколов. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 267 с. — (Серия : Бакалавр и магистр. Модуль). — ISBN 978-5-534-02556-9. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://bibli-online.ru/bcode/433180>

2. Прогнозирование финансовых кризисов: методы, модели, индикаторы: Монография / И.Я.Лукаевич, Е.А.Федорова - М.: Вузовский учебник, НИЦ ИНФРА-М, 2015. - 126 с.: 60x90 1/16. - (Научная книга)
3. Гусева, И. А. Финансовые рынки и институты : учебник и практикум для академического бакалавриата / И. А. Гусева. — М. : Издательство Юрайт, 2019.

*Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:*

1. ЭБС РУДН и сторонние ЭБС, к которым студенты университета имеют доступ на основании заключенных договоров:

- Электронно-библиотечная система РУДН – ЭБС РУДН <http://lib.rudn.ru/MegaPro/Web>
- ЭБС «Университетская библиотека онлайн» <http://www.biblioclub.ru>
- ЭБС Юрайт <http://www.biblio-online.ru>
- ЭБС «Консультант студента» [www.studentlibrary.ru](http://www.studentlibrary.ru)
- ЭБС «Лань» <http://e.lanbook.com/>
- ЭБС «Троицкий мост»
- .....

2. Базы данных и поисковые системы:

- электронный фонд правовой и нормативно-технической документации <http://docs.cntd.ru/>

- поисковая система Яндекс <https://www.yandex.ru/>
- поисковая система Google <https://www.google.ru/>
- реферативная база данных SCOPUS <http://www.elsevierscience.ru/products/scopus/>
- <http://www.gks.ru/> – портал Федеральной службы государственной статистики РФ
- <http://www.cbr.ru/> – портал Центрального банка РФ
- <http://data.worldbank.org/> - база данных Мирового банка
- <https://ec.europa.eu/eurostat/data/database> - база данных стран Евросоюза
- <https://www.imf.org/external/datamapper/datasets> - базы данных Международного валютного фонда

*Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся при освоении дисциплины/модуля\*:*

1. Курс лекций по дисциплине «Анализ и прогнозирование мировых финансовых рынков».

2. Практикум по дисциплине «Анализ и прогнозирование мировых финансовых рынков»

\* - все учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся размещаются в соответствии с действующим порядком на странице дисциплины **в ТУИС!**

## **8. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ И БАЛЛЬНО-РЕЙТИНГОВАЯ СИСТЕМА ОЦЕНИВАНИЯ УРОВНЯ СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ**

Оценочные материалы и балльно-рейтинговая система\* оценивания уровня сформированности компетенций (части компетенций) по итогам освоения дисциплины «Анализ и прогнозирование мировых финансовых рынков» представлены в Приложении к настоящей Рабочей программе дисциплины.

\* - Ом и БРС формируются на основании требований соответствующего локального нормативного акта РУДН.



**РАЗРАБОТЧИКИ:**

**Зав.кафедрой ЭММ**

Должность, БУП

Подпись

**Балашова С.А.**

Фамилия И.О.

**РУКОВОДИТЕЛЬ БУП:**

**Кафедра экономико-  
математического  
моделирования (ЭММ)**

Наименование БУП

Подпись

**Балашова С.А.**

Фамилия И.О.

**РУКОВОДИТЕЛЬ ОП ВО:**

**Руководитель программы**

Должность, БУП

Подпись

**Айдрус И.А.**

Фамилия И.О.