



АВТОНОМНАЯ НЕКОММЕРЧЕСКАЯ ОРГАНИЗАЦИЯ  
ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ПРОФЕССИОНАЛЬНОГО ОБРАЗОВАНИЯ  
"ЕВРАЗИЙСКАЯ АКАДЕМИЯ"



**УТВЕРЖДАЮ**

Ректор

*Замлелый А.Ю./*

"05" июня 2025 г.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ  
«Анализ рынка ценных бумаг»**

Дополнительная профессиональная программа  
**«Менеджмент и бизнес (экономика, финансы, административно-управленческая  
деятельность)»**

г. Москва

Территория Инновационного центра Сколково

**Наименование учебной дисциплины:** Анализ рынка ценных бумаг.

**Цель освоения учебной дисциплины:** достижение запланированных результатов освоения образовательной программы - формирование установленных в образовательной программе компетенций.

**Задачи освоения учебной дисциплины:** достижение запланированных в настоящей рабочей программе результатов освоения дисциплин - приобретение обучающимся запланированных знаний, умений, навыков.

**Планируемые результаты освоения учебной дисциплины**

Обучающийся должен сформировать следующие результаты освоения дисциплины «Анализ рынка ценных бумаг»:

**Знания:** Знание современных теорий и моделей оценки финансовых активов, факторов, влияющих на стоимость ценных бумаг, принципов портфельного инвестирования, методов управления рисками на рынке ценных бумаг, а также этических аспектов деятельности на рынке ценных бумаг.

**Умения:** Навыки работы с информационными ресурсами, специализированным программным обеспечением для анализа рынка ценных бумаг, интерпретации рыночных данных и новостей, прогнозирования динамики цен на ценные бумаги, принятия инвестиционных решений на основе проведенного анализа.

**Навыки:** Умение применять различные методы оценки стоимости ценных бумаг, разрабатывать инвестиционные стратегии, формировать и управлять инвестиционным портфелем, оценивать и минимизировать риски, связанные с инвестициями в ценные бумаги, представлять результаты анализа рынка ценных бумаг в устной и письменной форме.

**Объем (трудоемкость) учебной дисциплины:** определен в учебном плане образовательной программы.

**Форма промежуточной аттестации по учебной дисциплине** определена в учебном плане образовательной программы.

**Текущий контроль успеваемости** осуществляется посредством аналитического отчета обучающегося по дисциплине.

**Структура и содержание учебной дисциплины** определяется тематическим планом учебной дисциплины.

**Тематический план учебной дисциплины**

Тема № 1: Введение в рынок ценных бумаг

Тема № 2: Основные понятия и определения рынка ценных бумаг

Тема № 3: Участники рынка ценных бумаг

Тема № 4: Виды ценных бумаг

Тема № 5: Акции: характеристики и оценка

Тема № 6: Облигации: характеристики и оценка

Тема № 7: Деривативы: фьючерсы и опционы  
Тема № 8: Инструменты денежного рынка  
Тема № 9: Фундаментальный анализ рынка акций  
Тема № 10: Технический анализ рынка акций  
Тема № 11: Макроэкономические факторы и рынок ценных бумаг  
Тема № 12: Отраслевой анализ  
Тема № 13: Анализ финансовой отчетности компаний  
Тема № 14: Оценка стоимости компании  
Тема № 15: Управление портфелем ценных бумаг  
Тема № 16: Риск и доходность на рынке ценных бумаг  
Тема № 17: Диверсификация портфеля  
Тема № 18: Оптимизация портфеля  
Тема № 19: Измерение и управление рисками портфеля  
Тема № 20: Торговые стратегии на рынке ценных бумаг  
Тема № 21: Технический анализ: графические модели  
Тема № 22: Технический анализ: индикаторы  
Тема № 23: Фундаментальный анализ облигаций  
Тема № 24: Оценка кредитного риска  
Тема № 25: Доходность к погашению и дюрация облигаций  
Тема № 26: Рынок деривативов: стратегии хеджирования  
Тема № 27: Рынок деривативов: спекулятивные стратегии  
Тема № 28: Анализ рынка Forex  
Тема № 29: Анализ рынка криптовалют  
Тема № 30: Регулирование рынка ценных бумаг  
Тема № 31: Информационное обеспечение рынка ценных бумаг  
Тема № 32: Психология рынка ценных бумаг  
Тема № 33: Поведенческие финансы  
Тема № 34: Торговые платформы и программное обеспечение  
Тема № 35: Инвестиционные фонды  
Тема № 36: Пенсионные фонды и страховые компании на рынке ценных бумаг  
Тема № 37: Этика и профессиональные стандарты на рынке ценных бумаг

**Содержание самостоятельной работы обучающихся по учебной дисциплине:** подготовка к занятиям: изучение теоретического материала, чтение учебников и дополнительных источников, конспектирование; подготовка к промежуточной аттестации; самостоятельное изучение дополнительных материалов; анализ и интерпретация данных – составление аналитического отчета обучающегося по дисциплине.

#### **Условия реализации рабочей программы дисциплины**

**Материально-техническое обеспечение реализации дисциплины** соответствует материально-техническому обеспечению, указанному в разделе 3 образовательной программы.

## **Учебно-методическое обеспечение (электронные учебно-методические материалы) освоения учебной дисциплины**

### **Электронные учебные издания**

Куклина, Е. Н. Организация самостоятельной работы студента / Е. Н. Куклина, М. А. Мазниченко, И. А. Мушкина. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 235 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-06270-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/562503>

Зорина, Е. М. Метапредметная компетенция преподавателей и обучающихся / Е. М. Зорина. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 130 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-17997-2. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт].

### **Электронные методические издания**

Мотивация студентов к обучению и воспитательная деятельность — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 1 с. — (Юрайт.Академия). — ISBN 978-5-534-14536-6. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/533252>

Мотивация студентов к обучению и профессиональному развитию — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 5 с. — (Юрайт.Академия). — ISBN 978-5-534-14536-6. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/509597>

**Информационное обеспечение освоения учебной дисциплины** представляет собой перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем.

Каждый обучающийся обеспечивается индивидуальным неограниченным доступом к электронно-библиотечной системе (цифровой (электронной) библиотеке) «ЮРАЙТ» (<https://urait.ru/>), содержащей издания учебно-методической и иной литературы.

Каждый обучающийся обеспечивается индивидуальным неограниченным доступом к федеральной государственной информационной системе «Национальная электронная библиотека» (<https://rusneb.ru/>).

**Состав необходимого комплекта лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства:** Яндекс Браузер (реестровая запись №3722 от 23.07.2017 в едином реестре российских программ для электронных вычислительных машин и баз данных); Яндекс.Телемост (реестровая запись №13556 от 20.05.2022 в едином реестре российских программ для электронных вычислительных машин и баз данных)

**Электронные информационные ресурсы** (ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»):

#### **- Состав современных профессиональных баз данных**

Федеральная служба государственной статистики (<https://rosstat.gov.ru/>)

Открытые данные России (<https://data.gov.ru/>)

Статистический Отдел Организации Объединенных Наций (United Nations Statistics Division)  
(<http://data.un.org/>)

База данных ЮНЕСКО (<https://www.unesco.org/en/key-data>)

#### **- Состав информационных справочных систем**

База знаний Открытого правительства (<http://wiki.ac-forum.ru/>)

Высшая аттестационная комиссия при Министерстве науки и высшего образования Российской Федерации (<https://vak.minobrnauki.gov.ru/main>)

Российский фонд фундаментальных исследований (<https://www.rfbr.ru/>)

Официальный интернет-портал правовой информации (Государственная система правовой информации) (<http://pravo.gov.ru/>)

Система обеспечения законодательной деятельности (<https://sozd.duma.gov.ru/>)

Собрание законодательства Российской Федерации (<https://www.szrf.ru/>)

Государственная автоматизированная система Российской Федерации «Правосудие» (ГАС «Правосудие») (<https://sudrf.ru/>)

Нормативные правовые акты в Российской Федерации. Министерство юстиции Российской Федерации (<http://pravo.minjust.ru/>)

#### **- Иные информационные ресурсы - информационные ресурсы органов государственной власти**

Президент России (<http://kremlin.ru/>)

Правительство России (<http://government.ru/>)

Министерство науки и высшего образования РФ (<https://www.minobrnauki.gov.ru/>)

Министерство просвещения РФ (<https://edu.gov.ru/>)

Министерство экономического развития Российской Федерации (<https://www.economy.gov.ru/>)

Министерство цифрового развития, связи и массовых коммуникаций Российской Федерации (<https://digital.gov.ru/>)

#### **- Иные информационные ресурсы - периодическими издания**

ТАСС (<https://tass.ru/>)

РИА НОВОСТИ (<https://ria.ru/>)

Коммерсантъ (<https://www.kommersant.ru/>)

RT (<https://rt.com/>)

#### **- Информационные поисковые системы**

Яндекс (<https://ya.ru/>)

MAIL.RU (<https://www.mail.ru/>)