

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:

ФИО: Кандрашина Елена Александровна

Должность: И.о. ректора ФГАОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 29.10.2025 14:29:06

Уникальный программный ключ:

2db64eb9605ce27edd3b8e8fdd32c70e0674ddd2

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный экономический университет»

Институт Институт национальной и мировой экономики

Кафедра Экономической теории

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета

(протокол № 10 от 22 мая 2025 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Наименование дисциплины	Б1.О.43 Информационно-аналитические системы на финансовых рынках
Основная профессиональная образовательная программа	01.03.05 Статистика программа Информационные системы на финансовых рынках

Квалификация (степень) выпускника бакалавр

Самара 2025

Содержание (рабочая программа)

Стр.

- 1 Место дисциплины в структуре ОП
- 2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 3 Объем и виды учебной работы
- 4 Содержание дисциплины
- 5 Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины
- 6 Фонд оценочных средств по дисциплине

Целью изучения дисциплины является формирование результатов обучения, обеспечивающих достижение планируемых результатов освоения образовательной программы.

1. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Информационно-аналитические системы на финансовых рынках входит в обязательную часть блока Б1.Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Финансовые технологии и инструменты, Проектирование и реализация баз данных, Цифровая трансформация денежного обращения, Фундаментальный анализ финансовых рынков, Финансовый инжиниринг, Технический анализ финансовых рынков, Анализ и оценка финансовых рисков проекта, Организация и регулирование финансового рынка, Организованные торговые системы

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Изучение дисциплины Информационно-аналитические системы на финансовых рынках в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Общепрофессиональные компетенции (ОПК):

ОПКЭ-4 - Способен предлагать экономически и финансово обоснованные организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ОПКЭ-4	ОПКЭ-4.1: Знать:	ОПКЭ-4.2: Уметь:	ОПКЭ-4.3: Владеть (иметь навыки):
	виды, типы, формы организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности методы принятия организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности и виды ответственности за них	с позиций управленческо-правовых норм анализировать конкретные ситуации, возникающие в повседневной практике анализировать и оценивать организационно-управленческие решения; принимать адекватные решения при возникновении критических, спорных ситуаций	навыками применения организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности способностью нести ответственность за принятые организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-6 - Способен осуществлять мониторинг и анализ конъюнктуры рынка различных сегментов финансового рынка

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-6	ПК-6.1: Знать:	ПК-6.2: Уметь:	ПК-6.3: Владеть (иметь навыки):
	инструменты проведения мониторинга и анализа конъюнктуры	анализировать ключевые параметры финансового рынка	навыками подбора в интересах клиента комплекса финансовых

	финансового рынка		услуг
--	-------------------	--	-------

3. Объем и виды учебной работы

Учебным планом предусматриваются следующие виды учебной работы по дисциплине:

Очная форма обучения

Виды учебной работы	Всего час/ з.е.
	Сем 8
Контактная работа, в том числе:	74.3/2.06
Занятия лекционного типа	36/1
Занятия семинарского типа	36/1
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.3/0.01
Групповая контактная работа (ГКР)	2/0.06
Самостоятельная работа:	35.7/0.99
Промежуточная аттестация	34/0.94
Вид промежуточной аттестации:	Экз
Экзамен	
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	144
Зачетные единицы	4

4. Содержание дисциплины

4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Информационно-аналитические системы на финансовых рынках представлен в таблице.

Разделы, темы дисциплины и виды занятий

Очная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контактная работа				Самостоятельная работа	Планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по образовательной программе
		Лекции	Занятия семинарского типа	ИКР	ГКР		
			Практич. занятия				
1.	Организованные торговые системы: понятие, регулирование, параметры	18	18			15,7	ОПКЭ-4.1, ОПКЭ-4.2, ОПКЭ-4.3, ПК-6.1, ПК-6.2, ПК-6.3
2.	Виды организованных торговых систем по обращающимся активам	18	18			20	ОПКЭ-4.1, ОПКЭ-4.2, ОПКЭ-4.3, ПК-6.1, ПК-6.2, ПК-6.3
	Контроль	34					
	Итого	36	36	0.3	2	35.7	

4.2 Содержание разделов и тем

4.2.1 Контактная работа

Тематика занятий лекционного типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия лекционного типа*	Тематика занятия лекционного типа
1.	Организованные торговые системы:	лекция	Технологические принципы построения организованных торговых систем на финансовых рынках

	понятие, регулирование, параметры	лекция	Организация исполнения сделок на финансовом рынке. Основные этапы проведения сделок с ценными бумагами организатором торгов
		лекция	Технологические и институциональные принципы построения международного организованного финансового рынка
		лекция	Анализ динамики параметров, характеризующих организованную торговлю на финансовых рынках
2.	Виды организованных торговых систем по обращающимся активам	лекция	Принципы функционирования организованных торговых систем рынка корпоративных ценных бумаг
		лекция	Принципы функционирования организованных торговых систем рынка государственных федеральных ценных бумаг
		лекция	Принципы функционирования организованных торговых систем срочного рынка: система FORTS
		лекция	Особенности функционирования организованных торговых систем валютного рынка. Биржевой валютный дилинг
		лекция	Аналитическая информация на международном организованном финансовом рынке

*лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся

Тематика занятий семинарского типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия семинарского типа**	Тематика занятия семинарского типа
1.	Организованные торговые системы: понятие, регулирование, параметры	практическое занятие	Технологические принципы построения организованных торговых систем на финансовых рынках: функции системы заключения сделок, клиринговой и расчетной систем
		практическое занятие	Инфраструктурные организации, обеспечивающие торговлю на финансовом рынке, их взаимодействие. Участники торговых систем и организация доступа к участию в торгах
		практическое занятие	Организация исполнения сделок на финансовом рынке: технологии клиринга по сделкам в организованных торговых системах
		практическое занятие	Основные этапы проведения сделок с ценными бумагами организатором торгов: организация денежных расчетов и поставки по результатам сделки
2.	Виды организованных торговых систем по обращающимся активам	практическое занятие	Технологические принципы построения международного организованного финансового рынка: особенности международного брокеринга, дилинга, клиринга и расчетов
		практическое занятие	Особенности аукционов по размещению государственных федеральных и субфедеральных обязательств через организатора торговли на примере MoEx
		практическое занятие	Система FORTS MoEx: требования к участникам, типы срочных контрактов и, их спецификации, порядок расчета гарантийного обеспечения, особенности проведения

			клиентских сделок
		практическое занятие	Раскрытие информации на международном организованном финансовом рынке
		практическое занятие	Аналитические и информационные материалы на международном организованном финансовом рынке на примере WFE (World Federation of Exchanges)

** семинары, практические занятия, практикумы, лабораторные работы, коллоквиумы и иные аналогичные занятия

Иная контактная работа

При проведении учебных занятий СГЭУ обеспечивает развитие у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств (включая при необходимости проведение интерактивных лекций, групповых дискуссий, ролевых игр, тренингов, анализ ситуаций и имитационных моделей, преподавание дисциплин (модулей) в форме курсов, составленных на основе результатов научных исследований, проводимых организацией, в том числе с учетом региональных особенностей профессиональной деятельности выпускников и потребностей работодателей).

Формы и методы проведения иной контактной работы приведены в Методических указаниях по основной профессиональной образовательной программе.

4.2.2 Самостоятельная работа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид самостоятельной работы ***
1.	Организованные торговые системы: понятие, регулирование, параметры	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование
2.	Виды организованных торговых систем по обращающимся активам	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование

*** самостоятельная работа в семестре, написание курсовых работ, докладов, выполнение контрольных работ

5. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

5.1 Литература:

Основная литература

1. Лукасевич, И. Я. Финансовый менеджмент : учебник и практикум для вузов / И. Я. Лукасевич. — 4-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 680 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16271-4. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/568502>

2. Международный финансовый рынок : учебник и практикум для вузов / М. А. Эскиндаров [и др.] ; под общей редакцией М. А. Эскиндарова, Е. А. Звоновой. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 430 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16871-6. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/561158>

Дополнительная литература

1. Лукасевич, И. Я. Финансовая политика : учебник и практикум для вузов / И. Я. Лукасевич. — 4-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 208 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-19229-2. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/569115>

2. Международный финансовый рынок : учебник и практикум для вузов / М. А. Эскиндаров [и др.] ; под общей редакцией М. А. Эскиндарова, Е. А. Звоновой. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 430 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16871-6. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/561158>

3. Мировые финансы: структура и анализ мировых рынков : учебник и практикум для вузов / М. А. Эскиндаров [и др.] ; под общей редакцией М. А. Эскиндарова, Е. А. Звоновой. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 409 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-17687-2. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL:

5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения

1. Astra Linux Special Edition «Смоленск», «Орел»; РедОС ; ОС "Альт Рабочая станция" 10; ОС "Альт Образование" 10
2. МойОфис Стандартный 2, МойОфис Образование, Р7-Офис Профессиональный, МойОфис Стандартный 3, МойОфис Профессиональный 3

5.3 Современные профессиональные базы данных, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Профессиональная база данных «Информационные системы Министерства экономического развития Российской Федерации в сети Интернет» (Портал «Официальная Россия» - <http://www.gov.ru/>)
2. Государственная система правовой информации «Официальный интернет-портал правовой информации» (<http://pravo.gov.ru/>)
3. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/ru/>)
4. Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики - <http://www.gks.ru/>)

5.4. Информационно-справочные системы, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Справочно-правовая система «Консультант Плюс»
2. Справочно-правовая система «ГАРАНТ-Максимум»

5.5. Специальные помещения

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран
Учебные аудитории для проведения практических занятий (занятий семинарского типа)	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для самостоятельной работы	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ

Помещения для хранения и профилактического обслуживания оборудования	Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования
--	---

5.6 Лаборатории и лабораторное оборудование

6. Фонд оценочных средств по дисциплине Информационно-аналитические системы на финансовых рынках:

6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

Вид контроля	Форма контроля	Отметить нужное знаком « + »
Текущий контроль	Оценка докладов	+
	Устный/письменный опрос	+
	Тестирование	+
	Практические задачи	+
Промежуточный контроль	Экзамен	+

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования; Положением о балльно-рейтинговой системе оценки успеваемости обучающихся по основным образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры в федеральном государственном автономном образовательном учреждении высшего образования «Самарский государственный экономический университет».

6.2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Общепрофессиональные компетенции (ОПК):

ОПКЭ-4 - Способен предлагать экономически и финансово обоснованные организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ОПКЭ-4.1: Знать:	ОПКЭ-4.2: Уметь:	ОПКЭ-4.3: Владеть (иметь навыки):
	виды, типы, формы организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности методы принятия организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности и виды ответственности за них	с позиций управленческо-правовых норм анализировать конкретные ситуации, возникающие в повседневной практике анализировать и оценивать организационно-управленческие решения; принимать адекватные решения при возникновении критических, спорных ситуаций	навыками применения организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности способностью нести ответственность за принятые организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности
Пороговый	инструменты и	применять	навыками реализации

	методы профессиональных коммуникаций в проектной деятельности	информационно-технические средства групповых профессиональных коммуникаций для проведения презентаций и подготовки демонстрационного материала.	профессиональных коммуникаций при проведении презентаций, переговоров, публичных выступлений
Стандартный (в дополнение к пороговому)	каналы и модели профессиональных коммуникаций в рамках проектных групп	использовать методы логического анализа и объективной аргументации с заинтересованными участниками проектной деятельности при обсуждении проектов информационных экономических систем и технологий	навыками осуществлять взаимодействие с заказчиком в процессе реализации проектной деятельности; принимать участие в командообразовании и развитии персонала
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	технологии межличностной и групповой коммуникации в деловом взаимодействии, основы конфликтологии, технологии подготовки и проведения презентаций	формализовать и обобщить процесс профессиональных коммуникаций при разработке проекта в рамках проектной группы, руководствуясь требованиями заказчика и состоянием системы	навыками выбора, применения и адаптации методов командообразования в рамках проектных групп для решения задач в профессиональной деятельности с использованием финтех

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-6 - Способен осуществлять мониторинг и анализ конъюнктуры рынка различных сегментов финансового рынка

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ПК-6.1: Знать:	ПК-6.2: Уметь:	ПК-6.3: Владеть (иметь навыки):
	инструменты проведения мониторинга и анализа конъюнктуры финансового рынка	анализировать ключевые параметры финансового рынка	навыками подбора в интересах клиента комплекса финансовых услуг
Пороговый	базовые инновационные финансовые технологии и простые методы управления простыми проектами в области ИФТ	осуществлять подготовку проектов области ИФТ на основе полученных планов в условиях, когда проект не выходит за пределы утвержденных параметров в рамках учебных задач	базовым практическим опытом подготовки и управления простыми проектами в области ИФТ на основе полученных планов проектов в условиях, когда проект не выходит за пределы утвержденных параметров в рамках учебных задач
Стандартный (в дополнение к	большинство принципов и методов	управлять проектами среднего уровня сложности в области	практическим опытом управления проектами

пороговому)	управления проектами среднего уровня сложности в области ИФТ на основе полученных планов проектов и их администрирования	ИФТ на основе полученных планов проектов в условиях, когда проект не выходит за пределы утвержденных параметров	среднего уровня сложности в области ИФТ на основе полученных планов проектов в условиях, когда проект не выходит за пределы утвержденных параметров
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	классические и современные принципы и методы управления сложными и масштабными проектами в области ИФТ на основе полученных планов проектов и принципы, результаты их администрирования	реализовывать и администрировать масштабные проекты, состоящие из нескольких модулей и компонентов в области ИФТ, когда проект не выходит за пределы утвержденных параметров	практическим опытом реализации и администрирования сложных масштабных проектов, состоящими из нескольких модулей и компонент в области ИФТ на основе полученных проектных планов

6.3. Паспорт оценочных материалов

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контролируемые планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по программе	Вид контроля/используемые оценочные средства	
			Текущий	Промежуточный
1.	Организованные торговые системы: понятие, регулирование, параметры	ОПКЭ-4.1, ОПКЭ-4.2, ОПКЭ-4.3, ПК-6.1, ПК-6.2, ПК-6.3	- доклад -устный/письменный опрос - тестирование	Экзамен
2.	Виды организованных торговых систем по обращающимся активам	ОПКЭ-4.1, ОПКЭ-4.2, ОПКЭ-4.3, ПК-6.1, ПК-6.2, ПК-6.3	- доклад -устный/письменный опрос - тестирование -практические задачи	Экзамен

6.4.Оценочные материалы для текущего контроля

Примерная тематика докладов

Раздел дисциплины	Темы
Организованные торговые системы: понятие, регулирование, параметры	1. Роль информации и требования, предъявляемые к ней у организаторов торгов. 2. Специфика и классификация биржевых товаров в системе мировой организованной торговли. 3. Общественная структура и инфраструктура организатора торговли (на примере крупнейших мировых организаторов торговли). 4. Отличительные особенности сделок с форвардными и фьючерсными контрактами. 5. Спрэдовые операции маркет-мейкеров в рамках организованных торгов. 6. Три модуля торговой системы: метчинг, акцепт, отчетность.

	7. Понятие и процедура фиксинга. 8. Хеджирование и биржевая спекуляция. 9. История развития биржевой торговли, ее тенденции в мировой и отечественной практике. 10. Современный биржевой рынок России: институты, специализация. 11. Роль биржевой торговли в современной мировой экономике. Крупнейшие международные биржевые центры. 12. Организация и регулирование деятельности российских организаторов торговли. Государственное регулирование биржевой деятельности. Закон РФ «Об организованных торгах» № 325-ФЗ.
Виды организованных торговых систем по обращающимся активам	13. Порядок организации и лицензирования биржевой торговли. Учредители биржи и оформление документов на регистрацию. 14. Брокерская фирма и ее место в организованных торгах. 15. Роль расчетной палаты в организованных торгах. 16. Современная роль товарных и фьючерсных бирж в процессе ценообразования товарных активов. 17. Организация и техника торгов в России и за рубежом. 18. Виды поручений клиентов и условия покупки реального товара на бирже. 19. Основные функции фьючерсных бирж. Биржевые спекуляции. Характеристика участников фьючерсных торгов. 20. Механизм биржевой фьючерсной торговли. Методы ведения торгов. 21. Порядок определения цены контракта, его основные характеристики. 22. Роль расчетной палаты, как гаранта выполнения сделок. Маржа во фьючерсной торговле. 23. Процедура национального и международного клиринга. 24. Операции с опционами на фьючерсных биржах (понятие и виды опционов, основные характеристики цены опциона, стратегии использования опционов). 25. Страхование рисков на рынке фьючерсных контрактов (концепция и практика хеджирования). Основные фьючерсные и опционные рынки.

Вопросы для устного/письменного опроса

Раздел дисциплины	Вопросы
Организованные торговые системы: понятие, регулирование, параметры	1. Технологические принципы построения организованных торговых систем на финансовых рынках 2. Организация исполнения сделок на финансовом рынке. 3. Основные этапы проведения сделок с ценными бумагами организатором торгов 4. Технологические и институциональные принципы построения международного организованного финансового рынка 5. Анализ динамики параметров, характеризующих организованную торговлю на финансовых рынках 6. Принципы функционирования организованных торговых систем рынка корпоративных ценных бумаг 7. Принципы функционирования организованных торговых систем рынка государственных федеральных ценных бумаг 8. Принципы функционирования организованных торговых систем срочного рынка: система FORTS 9. Особенности функционирования организованных торговых систем срочного рынка 10. Система FORTS MoEx: требования к участникам, типы срочных контрактов и, их спецификации, порядок расчета гарантийного обеспечения, особенности проведения клиентских сделок

	11. Особенности функционирования организованных торговых систем валютного рынка. 12. Биржевой валютный дилинг. 13. Особенности биржевого валютного дилинга: национальный и международный аспекты 14. Участники и условия проведения валютных операций через организатора торговли 15. Раскрытие информации на международном организованном финансовом рынке 16. Аналитическая информация на международном организованном финансовом рынке 17. Инфраструктурные организации, обеспечивающие торговлю на финансовом рынке, их взаимодействие. 18. Участники торговых систем и организация доступа к участию в торгах 19. Организация исполнения сделок на финансовом рынке: технологии клиринга по сделкам в организованных торговых системах Основные этапы проведения сделок с ценными бумагами организатором торгов: организация денежных расчетов и поставки по результатам сделки
Виды организованных торговых систем по обращающимся активам	20. Технологические принципы построения международного организованного финансового рынка: особенности международного брокеринга, дилинга, клиринга и расчетов 21. Институциональные принципы построения международного организованного финансового рынка и его доминирующие тенденции 22. Биржевые индексы и биржевые средние: принципы расчета и применения на финансовых рынках в современных условиях 23. Информационное сопровождение организованной торговли на финансовых рынках: кредитные рейтинги и обзоры международных и национальных рейтинговых и аналитических агентств 24. Принципы функционирования организованных торговых систем рынка корпоративных ценных бумаг на примере фондовой секции MoEx 25. Правила листинга и делистинга корпоративных ценных бумаг. Особенности формирования котировальных списков организаторов торгов 26. Особенности аукционов по размещению государственных федеральных и субфедеральных обязательств через организатора торговли на примере MoEx 27. Особенности обращения государственных федеральных, субфедеральных обязательств через организатора торговли на примере MoEx Аналитические и информационные материалы на международном организованном финансовом рынке на примере WFE (World Federation of Exchanges)

Задания для тестирования и практические задачи по дисциплине для оценки сформированности компетенций (min 20, max 50 + ссылку на ЭИОС с тестами)

ОПКЭ-4 - Способен предлагать экономически и финансово обоснованные организационно- управленческие решения в профессиональной деятельности			
№ п/п	Задание	Ключ к заданию / Эталонный ответ	Критерии оценивания
Тестовые задания			
1.	Какое из следующих решений является наиболее обоснованным при выявлении через аналитическую систему тренда на снижение стоимости акций? а) Увеличить объем покупок для поддержки цены б) Продать активы, чтобы	b	Дан верный ответ

	минимизировать убытки с) Игнорировать данные и держать позицию d) Вложиться в долгосрочные активы вне рынка		
2.	При использовании информационно-аналитической системы обнаружена высокая волатильность активов без фундаментальных причин. Что является наиболее разумным управленческим решением? a) Войти в рынок с большими объемами для получения быстрой прибыли b) Оценить риск и снизить позиции по данным активам c) Игнорировать показатели волатильности и продолжать торговлю как обычно d) Вкладывать в более рискованные активы для компенсации убытков	b	Дан верный ответ
3.	Какие преимущества в управлении предусматривает автоматизация анализа данных по финансовым рынкам? a) Увеличение времени реакции на изменения рынка b) Исключение человеческого фактора без возможности контроля c) Повышение оперативности и снижение ошибок d) Уменьшение качества принимаемых решений	c	Дан верный ответ
4.	В ходе анализа информационно-аналитической системы обнаружены несогласованности данных с внешними источниками. Что следует сделать в первую очередь? a) Провести проверку источников и обновление данных b) Игнорировать несоответствия, так как система показывает тренды c) Увеличить объем данных без проверки их качества d) Немедленно прекращать использование системы	a	Дан верный ответ
5.	Какое из следующих решений является наиболее финансово обоснованным при выявлении через систему роста объема торгов без существенного изменения цены? a) Войти в длинную позицию, ожидая дальнейшего роста цены b) Не предпринимать действий, так как это ложный сигнал c) Продажа активов для фиксации прибыли или уменьшения рисков d) Покупка с целью воздействия на цену	c	Дан верный ответ
6.	Выявлено, что аналитическая система показывает долгосрочный нисходящий тренд по определенному сектору. Какое управленческое решение наиболее оправданно? a) Увеличить вложения в сектор для поддержки цен b) Перевести инвестиции в более перспективные сегменты c) Оставить текущие позиции без	b	Дан верный ответ

	изменений d) Объявить выход из рынка до выяснения ситуации		
7.	Для повышения эффективности управленческих решений по использованию информационно-аналитических систем необходимо a) Постоянно обновлять программное обеспечение и обучать персонал b) Устранять автоматизированные системы и полагаться только на интуицию c) Использовать только внешние источники информации без аналитической системы d) Ограничиваться ручным анализом без цифровых инструментов	a	Дан верный ответ
ЗАДАНИЯ ОТКРЫТОГО ТИПА			
8.	Какой вид анализа используют для выявления долгосрочных тенденций на финансовых рынках, основываясь на исторических данных для принятия финансово обоснованных решений?	Тренд	Дан верный ответ
9.	Назовите ключевой показатель, используемый для оценки эффективности инвестиционного портфеля	ROI	Дан верный ответ
10.	Какое понятие обозначает автоматизированные системы для оценки риска инвестиционных проектов при принятии решения об инвестировании?	Модуль	Дан верный ответ
11.	Назовите метод, позволяющий прогнозировать будущие цены активов на основе текущих данных, что способствует принятию экономически и финансово обоснованного организационно- управленческого решения	Моделирование	Дан верный ответ
12.	Как называется программный продукт, применяемый для автоматизации аналитических процессов на финансовых рынках для оптимизации принятия управленческого решения?	Платформа	Дан верный ответ
13.	Как называется методика оценки для принятия экономически обоснованного решения о прибыльности и риска инвестиций?	Аналитика	Дан верный ответ
14.	Какое слово обозначает снижение риска при инвестиционных решениях, способствующее оптимизации процессу принятия обоснованного решения со стороны инвестора?	Хеджирование	Дан верный ответ
СИТУАЦИОННЫЕ ЗАДАЧИ И МИНИ-КЕЙСЫ			
15.	В результате анализа данных установлено, что определённые финансовые показатели ухудшаются. Какие организационные меры рекомендуете для стабилизации ситуации?	Корректировка управленческих стратегий и оптимизация внутренних процессов	Допускаются иные формулировки, не искажающие смысла
16.	Ситуация: Вы - трейдер, ищете платформу для автоматизированной торговли акциями. Есть две опции: платформа А (низкая комиссия, сложный API) и платформа В (высокая комиссия, простой API, встроенные	Платформу А, несмотря на сложность API, так как низкая комиссия и высокая скорость критичны для	Допускаются иные формулировки, не искажающие смысла

	инструменты анализа). Задание: Какую платформу выбрать, если ваша стратегия требует высокой скорости исполнения и частоты сделок?	высокочастотной торговли	
17.	Ситуация: Брокерская компания хочет внедрить CRM для улучшения обслуживания клиентов и увеличения продаж. Есть две системы: CRM X (дорогая, но с глубокой интеграцией с торговой платформой) и CRM Y (дешевле, но требует ручной синхронизации данных). Задание: Какую CRM выбрать, если приоритет - автоматизация и минимизация ошибок при передаче данных?	CRM X, несмотря на высокую стоимость, так как интеграция с торговой платформой снизит риски и повысит эффективность работы.	Допускаются иные формулировки, не искажающие смысла
18.	Ситуация: Финансовая организация рассматривает инвестиции в систему кибербезопасности. Система стоит дорого, но обещает значительно снизить риск утечки данных и финансовых потерь. Задание: Как оценить, стоит ли инвестировать в систему, если невозможно точно оценить вероятность кибератак?	Оценить потенциальные потери от утечки данных (штрафы, потеря репутации, судебные издержки) и сравнить с стоимостью системы кибербезопасности. Использовать анализ "что если" для разных сценариев атак.	Допускаются иные формулировки, не искажающие смысла
19.	Ситуация: Инвестиционный фонд хочет создать систему для прогнозирования финансовых кризисов и своевременного выхода из рискованных активов. Задание: Какие ключевые макроэкономические и рыночные индикаторы следует включить в систему?	Инфляция, процентные ставки, безработица, дефицит бюджета, индекс волатильности (VIX), спреды доходности облигаций.	Допускаются иные формулировки, не искажающие смысла
20.	Ситуация: Банк использует алгоритм для расчета кредитного рейтинга заемщиков. Необходимо повысить точность алгоритма и снизить количество "плохих" кредитов. Задание: Какие факторы, помимо кредитной истории, можно добавить в алгоритм?	Данные из социальных сетей, геолокация, информация о занятости и образовании, данные о транзакциях	Допускаются иные формулировки, не искажающие смысла
21.	Ситуация: Вам необходимо выбрать модель машинного обучения для прогнозирования цен акций. Доступны исторические данные о ценах акций, объеме торгов и финансовых показателях компаний. Задание: Какую модель выбрать: линейную регрессию или нейронную сеть?	Нейронную сеть, так как она лучше справляется с нелинейными зависимостями и может учитывать большее количество факторов.	Допускаются иные формулировки, не искажающие смысла

ПК-6 - Способен осуществлять мониторинг и анализ конъюнктуры рынка различных сегментов финансового рынка			
№ п/п	Задание	Ключ к заданию / Эталонный ответ	Критерии оценивания
Тестовые задания			
1.	Какой индикатор наиболее важен для оценки настроений инвесторов на фондовом рынке? а) Уровень безработицы б) Индекс волатильности VIX с) Ключевая ставка центрального банка д) Индекс потребительских цен	b	Дан верный ответ
2.	Что произойдет с ценами на облигации в контексте конъюнктуры, если	b	Дан верный ответ

	центральный банк неожиданно снизит ключевую ставку? a) Цены облигаций упадут b) Цены облигаций вырастут c) Цены облигаций останутся без изменений d) Влияние на цены облигаций будет зависеть от валютного курса		
3.	Какой фактор наиболее вероятно окажет негативное влияние на курс национальной валюты? a) Рост экспортных цен b) Увеличение золотовалютных резервов c) Политическая нестабильность в стране d) Снижение инфляции	c	Дан верный ответ
4.	Какой сегмент финансового рынка наиболее чувствителен к изменению процентных ставок? a) Рынок акций b) Рынок облигаций c) Рынок криптовалют d) Рынок commodities	b	Дан верный ответ
5.	Какие данные используются для анализа "кривой доходности" при изучении конъюнктуры рынка? a) Цены акций различных компаний b) Доходности государственных облигаций с разными сроками погашения c) Объемы торгов на валютном рынке d) Макроэкономические показатели стран	b	Дан верный ответ
6.	Что из перечисленного наиболее вероятно приведет к росту цен на нефть, анализируя конъюнктуру рынка? a) Увеличение добычи нефти странами ОПЕК b) Замедление экономического роста в Китае c) Геополитическая напряженность в регионе Ближнего Востока d) Укрепление доллара США	c	Дан верный ответ
7.	Какой из инструментов наиболее подходит для хеджирования валютных рисков при анализе фондового сегмента рынка? a) Акции b) Облигации c) Фьючерсы на валюту d) Инвестиции в недвижимость	c	Дан верный ответ
ЗАДАНИЯ ОТКРЫТОГО ТИПА			
8.	Как называется наблюдаемая при мониторинге ситуация, когда цены на активы необоснованно растут?	Финансовый пузырь	Дан верный ответ
9.	Какой рынок наиболее чувствителен к изменению процентных ставок на основании мониторинга и анализа?	Облигационный	Дан верный ответ
10.	Как называется выявленный при мониторинге риск потерь из-за неспособности заемщика вовремя выплатить долг?	Кредитный	Дан верный ответ
11.	Как называется финансовый инструмент, дающий право, но не обязанность купить или продать актив по фиксированной цене в будущем,	Опцион	Дан верный ответ

	приобретаемый инвестором при осуществлении тщательного анализа?		
12.	Какой финансовый инструмент можно проанализировать при помощи индекса S&P 500?	Акции	Дан верный ответ
13.	Какой индикатор показывает среднее изменение цен товаров и услуг при мониторинге экономики?	Инфляция	Дан верный ответ
14.	Как называется ситуация, когда инвесторы массово продают активы, опасаясь падения рынка после проведения анализа?	Паника	Дан верный ответ
СИТУАЦИОННЫЕ ЗАДАЧИ И МИНИ-КЕЙСЫ			
15.	Задача 1: Анализ влияния геополитических рисков на валютный рынок. Ситуация: В регионе X наблюдается эскалация политической напряженности. Ваша задача - оценить влияние этого фактора на курс национальной валюты страны Y. Задание: Какие факторы будут определять динамику валютного курса в этой ситуации?	Спрос на валюту как на безопасный актив (USD, CHF, JPY), отток капитала из страны Y, изменение ожиданий относительно будущей монетарной политики.	Допускаются иные формулировки, не искажающие смысла
16.	Задача 2 : Мониторинг ключевых индикаторов фондового рынка. Ситуация: Вы анализируете фондовый рынок страны Z. За последние две недели наблюдается рост индекса акций, но при этом снижается объем торгов. Задание: Что может означать такая динамика?	Рост рынка может быть неустойчивым и обусловлен ограниченным числом участников. Необходим анализ фундаментальных факторов и новостного фона.	Допускаются иные формулировки, не искажающие смысла
17.	Задача 3: Анализ влияния изменения ключевой ставки на рынок облигаций. Ситуация: Центральный банк страны А неожиданно повысил ключевую ставку на 0.5%. Задание: Как это повлияет на рынок облигаций?	Цены облигаций упадут, доходность облигаций вырастет, особенно краткосрочных. Возможна переоценка кредитных рисков.	Допускаются иные формулировки, не искажающие смысла
18.	Задача 4: Оценка перспектив рынка криптовалют после регуляторных изменений. Ситуация: В стране В принят закон, регулирующий деятельность криптовалютных бирж и операций с криптовалютами. Задание: Как это повлияет на рынок криптовалют в этой стране?	Повышение доверия к рынку, приток институциональных инвесторов, возможное снижение волатильности, усиление контроля за отмыванием денег.	Допускаются иные формулировки, не искажающие смысла
19.	Задача 5: Анализ влияния макроэкономических данных на рынок commodities. Ситуация: Вы анализируете рынок нефти. Опубликованы данные о росте ВВП Китая и увеличении запасов нефти в США. Задание: Как эти факторы повлияют на цену нефти?	Рост ВВП Китая - фактор роста цен, увеличение запасов в США - фактор снижения цен. Необходим анализ силы влияния каждого фактора.	Допускаются иные формулировки, не искажающие смысла
20.	Задача 6: Мониторинг рынка деривативов для выявления аномалий. Ситуация: Вы отслеживаете рынок опционов на акции компании С. Замечено резкое увеличение объема торгов опционами call с высокой ценой исполнения. Задание: Что это может означать?	Инсайдерская информация, ожидание позитивных новостей о компании, спекулятивная атака на акции компании.	Допускаются иные формулировки, не искажающие смысла
21.	Задача 7: Анализ влияния социальных	Снижение цены	Допускаются иные

	сетей на настроения инвесторов. Ситуация: В социальных сетях наблюдается резкий рост негативных отзывов о компании D, занимающейся финансовыми технологиями. Задание: Как это может повлиять на цену акций компании?	акций, отток инвесторов, повышение волатильности. Необходим анализ достоверности информации и масштаба негативных настроений.	формулировки, не искажающие смысла
--	--	--	------------------------------------

6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме экзамена

Раздел дисциплины	Вопросы
Организованные торговые системы: понятие, регулирование, параметры	Роль информации и требования, предъявляемые к ней у организаторов торгов (в контексте принятия решений) Специфика и классификация биржевых товаров в системе мировой организованной торговли (с точки зрения управления портфелем и рисками) Общественная структура и инфраструктура организатора торговли (на примере крупнейших мировых организаторов торговли) (в контексте повышения эффективности) Отличительные особенности сделок с форвардными и фьючерсными контрактами (с точки зрения хеджирования и спекуляции) Спрэдовые операции маркет-мейкеров в рамках организованных торгов (с точки зрения влияния на ликвидность и стабильность рынка) Три модуля торговой системы: метчинг, акцепт, отчетность (в контексте оптимизации процессов) Процедура фиксинга может быть оптимизирована для снижения риска манипулирования ценами и обеспечения справедливого ценообразования? Какие организационные и технологические решения могут быть внедрены для повышения прозрачности и контроля за процессом фиксинга Хеджирование и биржевая спекуляция (с точки зрения баланса интересов и управления рисками) История развития биржевой торговли, ее тенденции в мировой и отечественной практике (с точки зрения адаптации к изменениям) Современный биржевой рынок России: институты, специализация (в контексте развития и конкурентоспособности) Роль биржевой торговли в современной мировой экономике. Крупнейшие международные биржевые центры (с точки зрения влияния на экономику и управления рисками)
Виды организованных торговых систем по обращающимся активам	Ключевые области применения электронных торгов и их специфика в контексте мониторинга финансового рынка Клиринг и нейтинг: влияние на анализ ликвидности и рисков на финансовом рынке Метод установления единого курса валюты помогает в анализе конъюнктуры валютного рынка Концепция торговли фьючерсными и опционными контрактами, которые отражают динамику финансовых рынков и их конъюнктуру Технологические принципы международного организованного финансового рынка, которые необходимо учитывать при мониторинге брокерских, дилинговых и клиринговых операций Институциональные принципы международного финансового рынка и его доминирующие тенденции, влияющие на анализ конъюнктуры различных сегментов

	Информационное сопровождение организованной торговли, включая кредитные рейтинги и обзоры, влияющий на мониторинг и анализ состояния финансового рынка Принципы функционирования организованных торговых систем на рынке корпоративных ценных бумаг и их значение для анализа рыночной конъюнктуры Особенности аукционов по размещению федеральных и субфедеральных обязательств и их влияние на конъюнктуру рынка Особенности функционирования организованных торговых систем на срочном рынке и их влияние на рыночную конъюнктуру Особенности биржевого валютного дилинга с точки зрения национального и международного анализа
--	---

6.6. Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

Шкала и критерии оценивания

Оценка	Критерии оценивания для мероприятий контроля с применением 4-х балльной системы
«отлично»	Повышенный ОПКЭ-4.1, ОПКЭ-4.2, ОПКЭ-4.3, ПК-6.1, ПК-6.2, ПК-6.3
«хорошо»	Стандартный ОПКЭ-4.1, ОПКЭ-4.2, ОПКЭ-4.3, ПК-6.1, ПК-6.2, ПК-6.3
«удовлетворительно»	Пороговый ОПКЭ-4.1, ОПКЭ-4.2, ОПКЭ-4.3, ПК-6.1, ПК-6.2, ПК-6.3
«неудовлетворительно»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне