

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:

ФИО: Сидорова Людмила Ивановна

Должность: Проректор по учебной работе

Дата подписания: 08.08.2024 15:15:12

Уникальный программный ключ:

fa4c9031b92404a37070404040404040

рабочей программы учебной дисциплины "Б1.О.09 Финансовый анализ (продвинутый уровень)"

направления подготовки бакалавров "38.04.08 Финансы и кредит"

профиль подготовки "Искусственный интеллект в финансово-экономических системах"

программа подготовки "магистр"

Цели и задачи учебной дисциплины (модуля)

В современном мире наблюдается все более заметное проникновение новых технологических решений и формирование цифровой экономики. Одной из наиболее актуальных и значимых тенденций в финансах стало использование искусственного интеллекта. Данное направление открыло множество возможностей для автоматизации и оптимизации финансовых процессов. С помощью искусственного интеллекта у людей появилась возможность анализировать и прогнозировать рыночные тренды, а также персонализировать клиентский опыт и управлять рисками более эффективно.

Целями освоения дисциплины «Финансовый анализ (продвинутый уровень)» являются получение системного представления о методологии финансового анализа, об аналитических инструментах и методах обоснования управленческих решений по различным аспектам деятельности коммерческих организаций с помощью ИИ, овладение практическими навыками оценки эффективности использования ими ресурсов, а также ознакомление с проблемными вопросами, требующими проведения дополнительных самостоятельных научных исследований прикладного характера.

- Задачами курса являются: формирование у обучающихся понимания концепций, лежащих в основе методологии финансового анализа, природы и способов исследования инвестиционных рисков; выявление дискуссионных аспектов теории финансового анализа и основных направлений дальнейшего их исследования; развитие навыков адекватного выбора аналитических инструментов обоснования решений по основным объектам управления: стратегии развития компании; инвестиционной политике; операционной деятельности; финансированию коммерческой организации; ее деловым, инвестиционным и финансовым рискам; ознакомление с принципами и процедурами контроля эффективности деятельности коммерческой организации и обеспечение роста ее стоимости; развитие практических навыков финансового анализа в рамках взаимодействия предприятий с коммерческими банками и страховыми компаниями; получение знаний по формированию необходимой и достаточной информационной базы различных направлений финансового анализа.

Основные блоки и темы дисциплины

Раздел дисциплины
Содержание, информационная база, методика финансового анализа.
Использование искусственного интеллекта (ИИ) для автоматизации рутинных задач в области финансового анализа.
Искусственный интеллект в управлении рисками в финансовой сфере
Влияние ИИ на трансформацию финансовых инструментов
Анализ баланса и отчета о финансовых результатах с помощью искусственного интеллекта.

Место дисциплины в структуре ОП

Учебная дисциплина «Финансовый анализ (продвинутый уровень)» является дисциплиной направления подготовки «Искусственный интеллект в финансово-экономических системах». Программа дисциплины «Финансовый анализ» (продвинутый уровень) базируется на знаниях, полученных магистрантами в рамках изучения таких дисциплин, как «Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках», «Информационно-аналитические системы управления деятельностью организации», «Финансовые рынки»,



«Большие данные в финансовой сфере», "Прикладные системы искусственного интеллекта в области финансов".

Знания, полученные при изучении дисциплины, непосредственно используются при изучении курса: "Управление финансами в цифровой экономике", "Поведенческие финансы", "Актуальные проблемы финансов". Знания, навыки и умения, приобретенные в процессе изучения дисциплины в ходе лекций, семинарских занятий и самостоятельной работы, должны всесторонне использоваться магистрантами на завершающем этапе обучения, а также в процессе дальнейшей профессиональной деятельности при решении широкого класса прикладных задач финансово-экономического характера.

Сочетание знаний экономической теории и актуальности новых ее проявлений в применении ИИ в экономике должно помочь обучающимся правильно отвечать на вызовы современности и готовиться к карьерному росту в новых технологических условиях.

В результате изучения дисциплины бакалавр должен обладать следующими компетенциями:

УК-1: Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, выработать стратегию действий		
УК-1.1 Анализирует задачу, выделяя ее базовые составляющие, осуществляет декомпозицию задачи		
логические формы и процедуры, способствующие рефлексии по поводу собственной и мыслительной деятельности	аргументированно формировать собственное суждение и оценку информации	навыками сопоставления разных источников информации с целью выявления их противоречий и поиска достоверных суждений
ОПК-1: Способен решать практические и (или) научно-исследовательские задачи в области финансовых отношений на основе применения знаний фундаментальной экономической науки		
ОПК-1.1 Представляет (на продвинутом уровне) современные методы исследования фундаментальной экономической науки при решении практических и (или) исследовательских задач в области финансовых отношений		
методические подходы к анализу фундаментальных финансовых моделей при решении практических и (или) исследовательских задач	определять необходимый набор современных методов исследования фундаментальной экономической науки при решении практических и (или) исследовательских задач; осуществлять методический анализ фундаментальных экономических моделей при решении практических и (или) исследовательских задач в сфере финансов	современными методами исследования фундаментальной экономической науки при решении практических и (или) исследовательских задач в области финансовых отношений
ОПК-2: Способен применять продвинутые инструментальные методы экономического и финансового анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях в области финансовых отношений, в том числе с использованием интеллектуальных и информационно-аналитических систем		
ОПК-2.1 Владеет современными методами экономического и финансового анализа, математической статистики и эконометрики для решения теоретических и прикладных задач		
современные методы экономического и финансового анализа, математической статистики и эконометрики	работать с национальными и международными базами данных с целью поиска необходимой информации об экономических и финансовых явлениях и процессах; использовать современные методы экономического и финансового анализа, математической статистики и эконометрики для решения прикладных задач	современными методами экономического и финансового анализа, математической статистики и эконометрики для решения теоретических и прикладных задач
ОПК-2: Способен применять продвинутые инструментальные методы экономического и финансового анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях в области финансовых отношений, в том числе с использованием интеллектуальных и информационно-аналитических систем		
ОПК-2.2 Обработывает статистическую информацию и получает обоснованные выводы		
основные виды статистической информации и инструменты ее обработки	обработать статистическую информацию и представить наглядную визуализацию данных; составлять план и осуществлять статистические исследования реальной экономической ситуации с применением изученных методов; делать обоснованные выводы, оценивать силу альтернативных гипотез на основе полученных	современными методами обработки статистической информации и получения обоснованных выводов



	результатов	
ПКУВ-5: Способен применять методы и механизмы построения системы управления риском ликвидности и кредитным, операционным, валютным рисками		
ПКУВ-5.1 Владеет методами оценки риска ликвидности, кредитного, операционного, процентного, рыночного и валютного рисков, имеет понимание реализации механизмов построения эффективных систем управления ими		
теоретические основы оценки рыночных рисков и методы управления ими	использовать современные методики проведения анализа влияния рыночных рисков на деятельность финансовых структур и оценивать эффективность управления данными рисками	инструментами оценки и навыками определения способов минимизации риска ликвидности, кредитного, операционного, процентного, рыночного и валютного рисков

Дисциплина "Финансовый анализ (продвинутый уровень)" изучается посредством лекций, все разделы программы закрепляются практическими, лабораторными занятиями, выполнением контрольных работ, самостоятельной работы над учебной и научно-технической литературой и завершается экзаменом.

Общая трудоёмкость дисциплины составляет 215.65 часа, 6 зачетные единицы.

Вид промежуточной аттестации: Экзамен.

Разработчик:	Подписано простой ЭП 18.06.2025	Мамиек Людмила Алиевна
Зав. кафедрой:	Подписано простой ЭП 21.06.2025	Пригода Людмила Владимировна
Зав. выпускающей кафедрой:	Подписано простой ЭП 21.06.2025	Пригода Людмила Владимировна

