

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Задорожная Людмила Ивановна

Должность: Проректор по учебной работе

Дата подписания: 26.08.2022 12:24:04

Университет: Майкопский

faa404d1aeb2a023b5f4a331ee5ddc540496512d

Кафедра Финансов и кредита

МИНОБРНАУКИ РОССИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования

«Майкопский государственный технологический университет»

Факультет экономики и управления

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по учебной работе
_____ Л.И. Задорожная
« ____ » _____ 20__ г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

по дисциплине

**Б1.В.05 Фундаментальный и технический анализ
на финансовых рынках**

по направлению подготовки

38.04.08 Финансы и кредит

по профилю подготовки (специализации)

квалификация (степень) выпускника

магистр

форма обучения

Очная, Заочная,

год начала подготовки

2022

Майкоп



Рабочая программа составлена на основе ФГОС ВО и учебного плана МГТУ по направлению подготовки (специальности) 38.04.08 Финансы и кредит

Составитель рабочей программы:

доцент кафедры финансов и
кредита, доцент,
(должность, ученое звание, степень)

Подписано простой ЭП
25.08.2022
(подпись)

Хамирзова Саида Казбековна
(Ф.И.О.)

Рабочая программа утверждена на заседании кафедры:

Финансов и кредита
(название кафедры)

Заведующий кафедрой:
26.08.2022

Подписано простой ЭП
26.08.2022
(подпись)

Пригода Людмила
Владимировна
(Ф.И.О.)

Согласовано:

Руководитель ОПОП
заведующий выпускающей
кафедрой
по направлению подготовки
(специальности)
26.08.2022

Подписано простой ЭП
26.08.2022
(подпись)

Пригода Людмила
Владимировна
(Ф.И.О.)



1. Цели и задачи учебной дисциплины (модуля)

Изучение дисциплины «Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках» направлено на формирование целостного представления о применении фундаментального и технического анализа в принятии инвестиционных решений при управлении капиталом на финансовых рынках.

Цель изучения дисциплины «Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках» - привить магистрантам навыки по вопросам принятия инвестиционных решений как на основе анализа фундаментальных показателей макросреды, отраслевой динамики и специфических характеристик публичных компаний (ключевых финансовых коэффициентов, структуры собственного капитала, качества корпоративного управления), делающих их привлекательными в глазах рыночных инвесторов, так и на основе анализа графического поведения цен.

Реализация поставленной цели позволяет решить следующие **задачи**:

- Формирование навыков работы с финансовой информацией и обучение различным видам ее представления, необходимым для фундаментального и технического анализа.
- Приобретение навыков работы с информационно-торговыми системами.
- Определение границ применения технического анализа и его использования в сочетании с другими методами для проведения комплексного всестороннего анализа финансовых инструментов.



2. Место дисциплины (модуля) в структуре ОП по направлению подготовки (специальности)

Дисциплина «Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках» является дисциплиной вариативной части дисциплин направления подготовки «Финансы и кредит» по магистерской программе «Банковское дело».

Изучение дисциплины базируется на знаниях, полученных магистрантами при изучении дисциплин «Финансовые рынки и финансово-кредитные институты», «Финансовые и денежно-кредитные методы регулирования экономики».

В результате освоения дисциплины магистрант овладеет инструментарием фундаментального и технического анализа финансовых рынков.

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.



3. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы.

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующей(их) компетенции(й):

ПКУВ-1.2	Разрабатывает финансовый план для клиента, формирует целевой инвестиционный портфель
ПКУВ-6.1	Консультирует квалифицированных и неквалифицированных инвесторов по вопросам операций на биржевом и небиржевом финансовых рынках
УК-1.1	Анализирует задачу, выделяя ее базовые составляющие, осуществляет декомпозицию задачи
УК-1.2	Находит и критически анализирует информацию, необходимую для решения поставленной задачи



4. Объем дисциплины (модуля) и виды учебной работы. Общая трудоемкость дисциплины

Объем дисциплины и виды учебной работы по очной форме обучения.

		Формы контроля (количество)	Виды занятий					Итого часов	з.е.
			За	Лек	Лаб	Пр	СРП		
Курс 1	Сем. 2	1	15	15	15	0.25	62.75	108	3

Объем дисциплины и виды учебной работы по заочной форме обучения.

		Формы контроля (количество)	Виды занятий					Итого часов	з.е.	
			За	Лек	Лаб	Пр	КРАТ			Контроль
Курс 2	Сем. 3		4	4	6	0.25	3.75	90	108	3



5. Структура и содержание учебной и воспитательной деятельности при реализации дисциплины

5.1. Структура дисциплины для очной формы обучения.

Сем	Раздел дисциплины	Недел я семе стра	Виды учебной работы, включая самостоятельную работу и трудоёмкость (в часах)								Формы текущего/проме жуточного контроля успеваемости текущего (по неделям семестра), промежуточной аттестации (по семестрам)
			Лек	Лаб	ПР	СРП	КРАТ	Контро ль	СР	СЗ	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
2	Современные методы анализа на финансовых рынках. Основные понятия и предпосылки фундаментального анализа.		2	2	2				8		блиц-опрос
2	Особенности аналитической работы на финансовых рынках. Работа с информацией.		2	2	2				8		подготовка реферата
2	Два направления проведения фундаментального анализа: «сверху-вниз» и «снизу-вверх». Нахождение справедливой цены		2	2	2				8		тестирование
2	Сравнительный подход в фундаментальном анализе для сопоставления фондовых рынков и отдельных акций.		2	2	2				8		блиц-опрос
2	Основные постулаты и предпосылки технического анализа. Принципы графического анализа ценных бумаг.		2	2	2				8		подготовка реферата
2	Тенденции на рынке ценных бумаг и принципы их выявления.		2	2	2				8		тестирование
2	Графические модели перелома и продолжения тенденции. Индикаторы технического анализа: виды и применение для построения торговых стратегий		2	2	2				8		блиц-опрос
2	Специальные методы технического анализа ценных бумаг. Практические аспекты построения торговых стратегий на фондовом рынке		1	1	1				6,75		подготовка реферата
2	Промежуточная аттестация					0,25					экзамен
	ИТОГО:		15	15	15	0,25			62.75		

5.2. Структура дисциплины для заочной формы обучения.

Сем	Раздел дисциплины	Виды учебной работы, включая самостоятельную работу и трудоемкость (в часах)							
		Лек	Лаб	ПР	СРП	КРАТ	Контроль	СР	СЗ
1	2	4	5	6	7	8	9	10	11
3	Современные методы анализа на финансовых рынках. Основные понятия и предпосылки фундаментального анализа.	1	1	1				12	
3	Особенности аналитической работы на финансовых рынках. Работа с информацией.	1	1	1				12	
3	Два направления проведения фундаментального анализа: «сверху-вниз» и «снизу-вверх». Нахождение справедливой цены	1	1	1				12	
3	Сравнительный подход в фундаментальном анализе для сопоставления фондовых рынков и отдельных акций.	1	1	1				12	
3	Основные постулаты и предпосылки технического анализа. Принципы графического анализа ценных бумаг.			1				12	
3	Тенденции на рынке ценных бумаг и принципы их выявления.			1				12	
3	Графические модели перелома и продолжения тенденции. Индикаторы технического анализа: виды и применение для построения торговых стратегий							12	
3	Специальные методы технического анализа ценных бумаг. Практические аспекты построения торговых стратегий на фондовом рынке							6	
3	Промежуточная аттестация					0,25	3,75		
	ИТОГО:	4	4	6		0.25	3.75	90	

5.4. Содержание разделов дисциплины (модуля) «Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках», образовательные технологии

Лекционный курс

Сем	Наименование темы дисциплины	Трудоемкость (часы)			Содержание	Формируемые компетенции	Результаты освоения (знать, уметь, владеть)	Образовательные технологии
		ОФО	ЗФО	ОЗФО				
1	2	3	4	5	6	7	8	9
2,3	Современные методы анализа на финансовых рынках. Основные понятия и предпосылки фундаментального анализа.	2	1		Концепция «разумного инвестирования». Гипотеза рационального поведения инвестора. Понятия «совершенный рынок», «конкурентный финансовый рынок», «трения на рынке». Понятие справедливой рыночной стоимости и инвестиционные стратегии на фондовом рынке. Многообразие показателей в рамках рыночного видения публичной компании. Пассивное и активное инвестирование. Критика выгод активного инвестирования. Рыночная информационная эффективность. Гипотеза адаптированных рынков. Рыночные аномалии и инвестиционные стратегии. Факторные модели ценообразования акций: эффект размера, учет волатильности, эффект стоимости. Отбор акций в портфель на основе факторного инвестирования. Определение спекулятивного финансового пузыря, отличие от медвежьего тренда. Макро- и	ПКУВ-1.2;	Знать: основные принципы финансовой математики, принципы портфельного управления инвестированием. Уметь: оценивать затраты на поведение финансовых операций; рассчитывать величину портфеля, достаточную для покрытия финансовых целей; выявлять соответствие/несоответствие инвестиционного профиля клиента параметрам инвестиционного портфеля; рассчитывать размер инвестиций, необходимый для достижения целей клиентов; рассчитывать целевую доходность в зависимости от финансовых целей и начального капитала. Владеть: навыками составления инвестиционного портфеля; выявления качественных и количественных свойств рисков в предполагаемых к использованию финансовых продуктах.	Лекция-беседа

Сем	Наименование темы дисциплины	Трудоемкость (часы)			Содержание	Формируемые компетенции	Результаты освоения (знать, уметь, владеть)	Образовательные технологии
		ОФО	ЗФО	ОЗФО				
1	2	3	4	5	6	7	8	9
					<p>микропузыри. Понятие «рациональных пузырей». Теория влияния долгового финансирования на поведение экономической системы и финансовую нестабильность. Концепция ограниченного арбитража, диагностирование на рынке объективных, субъективных и институциональных факторов, ограничивающих короткие продажи. Концепция множественного равновесия на финансовых рынках.</p>			
2,3	<p>Особенности аналитической работы на финансовых рынках. Работа с информацией.</p>	2	1		<p>Понятия «финансовый аналитик», «аналитическое покрытие», «консенсус прогнозы». Виды финансовых аналитиков. Причины и последствия конфликта интересов в области финансовой аналитики. Источники получения данных о прогнозах аналитических команд. Рейтингование аналитиков - проблемы выявления качественных прогнозов. Типичное построение аналитических отчетов и рекомендаций российских команд аналитиков. Влияние аналитических рекомендаций на поведение цен финансовых активов.</p>	ПКУВ-1.2;	<p>Знать: основные принципы финансовой математики, принципы портфельного управления инвестированием. Уметь: оценивать затраты на проведение финансовых операций; рассчитывать величину портфеля, достаточную для покрытия финансовых целей; выявлять соответствие/несоответствие инвестиционного профиля клиента параметрам инвестиционного портфеля; рассчитывать размер инвестиций, необходимый для достижения целей клиентов; рассчитывать целевую доходность в зависимости от финансовых целей и начального капитала. Владеть: навыками составления инвестиционного</p>	Слайд-лекция

Сем	Наименование темы дисциплины	Трудоемкость (часы)			Содержание	Формируемые компетенции	Результаты освоения (знать, уметь, владеть)	Образовательные технологии
		ОФО	ЗФО	ОЗФО				
1	2	3	4	5	6	7	8	9
							портфеля; выявления качественных и количественных свойств рисков в предполагаемых к использованию финансовых продуктах.	
2,3	<p>Два направления проведения фундаментального анализа: «сверху-вниз» и «снизу- вверх».</p> <p>Нахождение справедливой цены</p>	2	1		<p>Концепция определения справедливой цены акции. Показатель FCF, оценка по отчетным показателям и принципы прогнозных построений. Методы анализа рыночных тенденций: ретроспективный анализ, прогнозирование будущих трендов. Традиционная значимость анализа макроэкономической динамики. Основные макроэкономические индикаторы, определяющие динамику фондовых индексов. Деловой цикл. Циклические экономические индикаторы. Инструменты прогнозирования. Роль опережающих индикаторов. Инфляционное влияние и группировка отраслей и компаний по инвестиционной привлекательности. Задачи отраслевого анализа. Ключевые отраслевые факторы. Конкурентный анализ Портера. Жизненный цикл отрасли. Данные для отраслевого анализа. Классификация отраслей. Растущие, защитные и циклические отрасли и инвестиционные стратегии. Процесс</p>	УК-1.1;	<p>Знать: методику анализа экономической информации объекта исследования. Уметь: определять суть проблемной ситуации и этапы ее разрешения с учетом вариативных контекстов; методами сбора, систематизации и анализа информации, необходимой для выработки стратегии действий по разрешению проблемной ситуации; оценивать достоверность информации, находить решение проблемной ситуации; осуществлять и аргументировать выбор стратегии по решению проблемной ситуации, разрабатывать план действий по решению проблемной ситуации. Владеть: навыками анализа проблемных ситуаций и выработки стратегии действия.</p>	Лекции-визуализации

Сем	Наименование темы дисциплины	Трудоемкость (часы)			Содержание	Формируемые компетенции	Результаты освоения (знать, уметь, владеть)	Образовательные технологии
		ОФО	ЗФО	ОЗФО				
1	2	3	4	5	6	7	8	9
					<p>выбора компаний. Получение информации о компаниях, проблемы работы со стандартной финансовой отчетностью. Традиционные и современные финансовые показатели анализа эффективности деятельности компаний. Значимость нефинансовых показателей в построении инвестиционных стратегий (оценка корпоративного управления компании). Концепция устойчивого развития и инвестиционные стратегии на развитом рынке.</p>			
2,3	Сравнительный подход в фундаментальном анализе для сопоставления фондовых рынков и отдельных акций.	2	1		<p>Методы и техники анализа переоцененности фондовых индексов (скользящее среднее, многофакторные регрессии, «технический индикатор») для сопоставления рынков и акций. Классические инвестиционные стратегии выбора рынков и отдельных компаний, строящиеся на анализе мультипликаторов. Популярные инвестиционные стратегии. Страновые и отраслевые финансовые мультипликаторы и отслеживание их динамики. Виды мультипликаторов, мультипликаторы на базе аналитических показателей. Обоснование выбора</p>	УК-1.1;	<p>Знать: методику анализа экономической информации объекта исследования. Уметь: определять суть проблемной ситуации и этапы ее разрешения с учетом вариативных контекстов; методами сбора, систематизации и анализа информации, необходимой для выработки стратегии действий по разрешению проблемной ситуации; оценивать достоверность информации, находить решение проблемной ситуации; осуществлять и аргументировать выбор стратегии по решению проблемной ситуации, разрабатывать план действий по решению проблемной ситуации. Владеть: навыками</p>	Слайд-лекция

Сем	Наименование темы дисциплины	Трудоемкость (часы)			Содержание	Формируемые компетенции	Результаты освоения (знать, уметь, владеть)	Образовательные технологии
		ОФО	ЗФО	ОЗФО				
1	2	3	4	5	6	7	8	9
					мультипликатора и требования к обработке финансовых данных. Коррекция мультипликаторов на отраслевую специфику, степень развития рынка капитала и специфические характеристики отдельных инвестиционных активов. Рекомендации по построению алгоритма выявления недооцененных и переоцененных акций по мультипликаторам.		анализа проблемных ситуаций и выработки стратегии действия.	
2,3	Основные постулаты и предпосылки технического анализа. Принципы графического анализа ценных бумаг.	2			Основные положения и предпосылки технического анализа. Методы технического анализа. Основные положения теории Доу. Параметры рынка ценных бумаг: цена и объём. Правила построения графиков и гистограмм.	ПКУВ-6.1;	Знать: особенности проведения фундаментального и технического анализа на финансовых рынках; инструменты финансового рынка и их характеристики; экономические и юридические аспекты проведения операций на финансовых рынках. Уметь: осуществлять анализ и оценку инструментов финансового рынка, оказывать качественные профессиональные информационные услуги в рамках проведения консультационных мероприятий. Владеть: навыками построения прогноза развития ситуации на финансовых рынках, навыками оказания консультационных услуг по вопросам осуществления операций	Лекция-беседа

Сем	Наименование темы дисциплины	Трудоемкость (часы)			Содержание	Формируемые компетенции	Результаты освоения (знать, уметь, владеть)	Образовательные технологии
		ОФО	ЗФО	ОЗФО				
1	2	3	4	5	6	7	8	9
2,3	Тенденции на рынке ценных бумаг и принципы их выявления.	2			Понятие и виды тенденций. Графическое отображение тенденций. Линии тенденции и методы их построения. Коридоры и каналы. Уровни и линии поддержки и сопротивления.	ПКУВ-6.1;	на финансовых рынках. Знать: особенности проведения фундаментального и технического анализа на финансовых рынках; инструменты финансового рынка и их характеристики; экономические и юридические аспекты проведения операций на финансовых рынках. Уметь: осуществлять анализ и оценку инструментов финансового рынка, оказывать качественные профессиональные информационные услуги в рамках проведения консультационных мероприятий. Владеть: навыками построения прогноза развития ситуации на финансовых рынках, навыками оказания консультационных услуг по вопросам осуществления операций на финансовых рынках.	Слайд-лекция
2,3	Графические модели перелома и продолжения тенденции. Индикаторы технического анализа: виды и применение для построения торговых стратегий	2			Понятие графической модели (графической фигуры). Применение графических моделей в анализе ценных бумаг. Фигуры продолжения тенденции. Фигуры разворота тенденции. Достоинства и недостатки методов графического анализа. Понятие индикатора. Основные предпосылки построения индикаторов. Скользящие средние значения как основной вид	УК-1.2;	Знать: методику анализа экономической информации объекта исследования. Уметь: определять суть проблемной ситуации и этапы ее разрешения с учетом вариативных контекстов; методами сбора, систематизации и анализа информации, необходимой для выработки стратегии действий по разрешению проблемной ситуации; оценивать достоверность	Лекции-визуализации

Сем	Наименование темы дисциплины	Трудоемкость (часы)			Содержание	Формируемые компетенции	Результаты освоения (знать, уметь, владеть)	Образовательные технологии
		ОФО	ЗФО	ОЗФО				
1	2	3	4	5	6	7	8	9
					индикаторов. Вспомогательные индикаторы: принцип построения и применение в техническом анализе. Достоинства и недостатки применения индикаторов.		информации, находить решение проблемной ситуации; осуществлять и аргументировать выбор стратегии по решению проблемной ситуации, разрабатывать план действий по решению проблемной ситуации. Владеть: навыками анализа проблемных ситуаций и выработки стратегии действия.	
2,3	Специальные методы технического анализа ценных бумаг. Практические аспекты построения торговых стратегий на фондовом рынке	1			Практические аспекты построения торговых стратегий на российском фондовом рынке. Построение графиков, работа с фигурами и комбинациями свечей. Поиск комбинаций на реальном рынке. Использование различных индикаторов для прогнозирования поведения цен, анализ эффективности технического индикатора. Построение и анализ различных математических индикаторов. Анализ временных рамок трейдинга и восприятия времени в трейдинге. Подход к совместному использованию различных торговых систем. Определение эффективности торговой деятельности.	УК-1.2;	Знать: методiku анализа экономической информации объекта исследования. Уметь: определять суть проблемной ситуации и этапы ее разрешения с учетом вариативных контекстов; методами сбора, систематизации и анализа информации, необходимой для выработки стратегии действий по разрешению проблемной ситуации; оценивать достоверность информации, находить решение проблемной ситуации; осуществлять и аргументировать выбор стратегии по решению проблемной ситуации, разрабатывать план действий по решению проблемной ситуации. Владеть: навыками анализа проблемных ситуаций и выработки стратегии действия.	Слайд-лекция
	ИТОГО:	15	4					

5.5. Практические занятия, их наименование, содержание и объем в часах

Сем	№ раздела дисциплины	Наименование практических занятий	Объем в часах		
			ОФО	ЗФО	ОЗФО
1	2	3	4	5	6
2,3	Современные методы анализа на финансовых рынках. Основные понятия и предпосылки фундаментального анализа.	Концепция «разумного инвестирования». Гипотеза рационального поведения инвестора. Понятия «совершенный рынок», «конкурентный финансовый рынок», «трения на рынке». Понятие справедливой рыночной стоимости и инвестиционные стратегии на фондовом рынке. Многообразие показателей в рамках рыночного видения публичной компании. Пассивное и активное инвестирование. Критика выгод активного инвестирования. Рыночная информационная эффективность. Гипотеза адаптированных рынков. Рыночные аномалии и инвестиционные стратегии. Факторные модели ценообразования акций: эффект размера, учет волатильности, эффект стоимости. Отбор акций в портфель на основе факторного инвестирования. Определение спекулятивного финансового пузыря, отличие от медвежьего тренда. Макро- и микропузыри. Понятие «рациональных пузырей». Теория влияния долгового финансирования на поведение экономической системы и финансовую нестабильность. Концепция ограниченного арбитража, диагностирование на рынке объективных, субъективных и институциональных факторов, ограничивающих короткие продажи. Концепция множественного равновесия на финансовых рынках	2	1	
2,3	Особенности аналитической работы на финансовых рынках. Работа с информацией.	Понятия «финансовый аналитик», «аналитическое покрытие», «консенсус прогнозы». Виды финансовых аналитиков. Причины и последствия конфликта интересов в области финансовой аналитики. Источники получения данных о прогнозах аналитических команд. Рейтингование аналитиков - проблемы выявления качественных прогнозов. Типичное построение аналитических отчетов и рекомендаций российских команд аналитиков. Влияние аналитических рекомендаций на поведение цен финансовых активов.	2	1	
2,3	Два направления проведения фундаментального анализа: «сверху-вниз» и «снизу-вверх». Нахождение справедливой цены	Концепция определения справедливой цены акции. Показатель FCF, оценка по отчетным показателям и принципы прогнозных построений. Методы анализа рыночных тенденций: ретроспективный анализ, прогнозирование будущих трендов. Традиционная значимость анализа макроэкономической динамики. Основные макроэкономические индикаторы, определяющие динамику фондовых индексов. Деловой цикл. Циклические экономические индикаторы. Инструменты прогнозирования. Роль опережающих индикаторов. Инфляционное влияние и группировка отраслей и компаний по инвестиционной привлекательности. Задачи отраслевого анализа. Ключевые отраслевые факторы. Конкурентный анализ Портера. Жизненный цикл отрасли. Данные для отраслевого анализа. Классификация отраслей. Растущие, защитные и циклические отрасли и инвестиционные стратегии. Процесс выбора компаний. Получение информации о компаниях, проблемы работы со стандартной финансовой отчетностью. Традиционные и современные финансовые показатели анализа эффективности деятельности компаний. Значимость нефинансовых показателей в построении инвестиционных стратегий (оценка корпоративного управления компании). Концепция устойчивого развития и инвестиционные стратегии на развитом рынке.	2	1	
2,3	Сравнительный подход в фундаментальном анализе для сопоставления фондовых рынков и отдельных акций.	Методы и техники анализа переоцененности фондовых индексов (скользящее среднее, многофакторные регрессии, «технический индикатор») для сопоставления рынков и акций. Классические инвестиционные стратегии выбора рынков и отдельных компаний, строящиеся на анализе мультипликаторов. Популярные инвестиционные стратегии. Страновые и отраслевые финансовые мультипликаторы и отслеживание их	2	1	

Сем	№ раздела дисциплины	Наименование практических занятий	Объем в часах		
			ОФО	ЗФО	ОЗФО
1	2	3	4	5	6
		динамики. Виды мультипликаторов, мультипликаторы на базе аналитических показателей. Обоснование выбора мультипликатора и требования к обработке финансовых данных. Коррекция мультипликаторов на отраслевую специфику, степень развития рынка капитала и специфические характеристики отдельных инвестиционных активов. Рекомендации по построению алгоритма выявления недооцененных и переоцененных акций по мультипликаторам.			
2,3	Основные постулаты и предпосылки технического анализа. Принципы графического анализа ценных бумаг.	Основные положения и предпосылки технического анализа. Методы технического анализа. Основные положения теории Доу. Параметры рынка ценных бумаг: цена и объём. Правила построения графиков и гистограмм.	2	1	
2,3	Тенденции на рынке ценных бумаг и принципы их выявления.	Понятие и виды тенденций. Графическое отображение тенденций. Линии тенденции и методы их построения. Коридоры и каналы. Уровни и линии поддержки и сопротивления.	2	1	
2,3	Графические модели перелома и продолжения тенденции. Индикаторы технического анализа: виды и применение для построения торговых стратегий	Понятие графической модели (графической фигуры). Применение графических моделей в анализе ценных бумаг. Фигуры продолжения тенденции. Фигуры разворота тенденции. Достоинства и недостатки методов графического анализа. Понятие индикатора. Основные предпосылки построения индикаторов. Скользящие средние значения как основной вид индикаторов. Вспомогательные индикаторы: принцип построения и применение в техническом анализе. Достоинства и недостатки применения индикаторов.	2		
2,3	Специальные методы технического анализа ценных бумаг. Практические аспекты построения торговых стратегий на фондовом рынке	Практические аспекты построения торговых стратегий на российском фондовом рынке. Построение графиков, работа с фигурами и комбинациями свечей. Поиск комбинаций на реальном рынке. Использование различных индикаторов для прогнозирования поведения цен, анализ эффективности технического индикатора. Построение и анализ различных математических индикаторов. Анализ временных рамок трейдинга и восприятия времени в трейдинге. Подход к совместному использованию различных торговых систем. Определение эффективности торговой деятельности.	1		
	ИТОГО:		15	6	

Симуляционные занятия, их наименование, содержание и объем в часах

Учебным планом не предусмотрено

5.6. Лабораторные занятия, их наименование и объем в часах

Сем	№ раздела дисциплины	Наименование лабораторных работ	Объем в часах		
			ОФО	ЗФО	ОЗФО
1	2	3	4	5	6
2,3	Современные методы анализа на финансовых рынках. Основные понятия и	Ознакомление с процессами, протекающими на биржевых рынках. Сопоставление компаний по дивидендной политике, по инвестиционной привлекательности на базе	2	1	

Сем	№ раздела дисциплины	Наименование лабораторных работ	Объем в часах		
			ОФО	ЗФО	ОЗФО
1	2	3	4	5	6
	предпосылки фундаментального анализа.	дивидендов. Изучение возможности прогноза финансовых показателей на будущее - трендовые построения и альтернативные методы обоснования.			
2,3	Особенности аналитической работы на финансовых рынках. Работа с информацией.	Построение графиков, работа с фигурами и комбинациями свечей. Поиск комбинаций на реальном рынке. Сравнение фондовых индексов, сопоставление рынков по привлекательности.	2	1	
2,3	Два направления проведения фундаментального анализа: «сверху-вниз» и «снизу- вверх». Нахождение справедливой цены	Использование различных индикаторов для прогнозирования поведения цен, анализ эффективности технического индикатора. Построение и анализ различных математических индикаторов. Обсуждение дискуссионных, проблемных вопросов, связанных с учетом финансовых инструментов.	2	1	
2,3	Сравнительный подход в фундаментальном анализе для сопоставления фондовых рынков и отдельных акций.	Анализ влияния новостей на ценовые движения. Оценка ликвидности акций двух компаний. По компании с развивающегося рынка введение премии за низкую ликвидность.	2	1	
2,3	Основные постулаты и предпосылки технического анализа. Принципы графического анализа ценных бумаг.	Построение механической торговой системы на основе индикатора.	2		
2,3	Тенденции на рынке ценных бумаг и принципы их выявления.	Обсуждение процесса разработки торговой системы, рисков, связанных с торговлей и специфики механических торговых систем. Поиск ценовых паттернов, построение системы на основе их использования.	2		
2,3	Графические модели перелома и продолжения тенденции. Индикаторы технического анализа: виды и применение для построения торговых стратегий	Построение механической торговой системы на основе осциллятора.	2		
2,3	Специальные методы технического анализа ценных бумаг. Практические аспекты построения торговых стратегий на фондовом рынке	Анализ временных рамок трейдинга и восприятия времени в трейдинге. Подход к совместному использованию различных торговых систем. Определение эффективности торговой деятельности	1		
	ИТОГО:		15	4	

5.7. Примерная тематика курсовых проектов (работ)

Учебным планом не предусмотрено

5.8. Самостоятельная работа студентов

Содержание и объем самостоятельной работы студентов

Сем	Разделы и темы рабочей программы самостоятельного изучения	Перечень домашних заданий и других вопросов для самостоятельного изучения	Сроки выполнения	Объем в часах		
				ОФО	ЗФО	ОЗФО
1	2	3	4	5	6	7
2,3	Современные методы анализа на финансовых рынках. Основные понятия и предпосылки фундаментального анализа.	Изучение основной и дополнительной литературыИзучение основных источников информации. Изучение руководства по работе в системе Quik.Составление плана-конспекта	в течение семестра	8	12	
2,3	Особенности аналитической работы на финансовых рынках. Работа с информацией.	Изучение основной и дополнительной литературы Полный графический анализ нескольких эмитентов. Начало ведения торгового дневника. Написание реферата	в течение семестра	8	12	
2,3	Два направления проведения фундаментального анализа: «сверху-вниз» и «снизу- вверх». Нахождение справедливой цены	Изучение основной и дополнительной литературы Детальный анализ одного технического индикатора. Перечень индикаторов для анализа предлагается преподавателем. Ведение торгового дневника. Проведение анализа рынка конкретного товара	в течение семестра	8	12	
2,3	Сравнительный подход в фундаментальном анализе для сопоставления фондовых рынков и отдельных акций.	Изучение основной и дополнительной литературы Ведение торгового дневника. Анализ записей в торговом дневнике с точки зрения теории поведенческих финансов.	в течение семестра	8	12	
2,3	Основные постулаты и предпосылки технического анализа. Принципы графического анализа ценных бумаг.	Изучение основной и дополнительной литературыВедение торгового дневника. Анализ взаимосвязей между а) двумя бумагами одной отрасли, б) бумагой и производными финансовыми инструментами для которых она является базовым активом.Составление плана-конспекта	в течение семестра	8	12	
2,3	Тенденции на рынке ценных бумаг и принципы их выявления.	Изучение основной и дополнительной литературыВедение торгового дневника. Выявление повторяющихся ситуаций на рынке. Применение паттернов в торговле. Разработка индивидуальной системы торговли. Подготовка к контрольной работе. Составление плана-конспекта	в течение семестра	8	12	
2,3	Графические модели перелома и продолжения тенденции. Индикаторы технического анализа: виды и применение для построения торговых стратегий	Изучение основной и дополнительной литературыВедение торгового дневника.Корректировка индивидуальной системы торговли. Расчет эффективности проведения торговых операций, формирование выводов и коррекция стратегий. Составление плана-конспекта	в течение семестра	8	12	
2,3	Специальные методы технического анализа ценных бумаг. Практические аспекты построения торговых стратегий на фондовом рынке	Изучение основной и дополнительной литературы. Ведение торгового дневника. Сайты бирж развивающихся рынков. Составление плана-конспекта	в течение семестра	7	6	
ИТОГО:				63	90	

5.9. Календарный график воспитательной работы по дисциплине

Учебным планом не предусмотрено

6. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю).

6.1. Методические указания (собственные разработки)

Название	Ссылка
Реунова, Л.В. Финансовые рынки (финансово-экономические расчеты) [Элек-тронный ресурс]: учебно-методическое пособие / Л.В. Реунова, М.Н. Соколова, Н.И. Кабанова. - Майкоп: МГТУ, 2013. - 80 с.	http://mark.nbmgtu.ru/libdata.php?id=2000022688

6.2. Литература для самостоятельной работ

Название	Ссылка
Сребник, Б.В. Финансовые рынки: профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг : учебное пособие / Б.В. Сребник, Т.Б. Вилкова. - Москва : ИНФРА-М, 2022. - 366 с. -	http://lib.mkgtu.ru:8004/catalog/fo12?SHOW_ONE_BOOK+0BBCC7
Чижик, В.П. Финансовые рынки и институты : учебное пособие / Чижик В.П. - Москва : ФОРУМ : ИНФРА-М, 2020. - 384 с.	http://lib.mkgtu.ru:8004/catalog/fo12?SHOW_ONE_BOOK+0BBCCB
Гришина, О.А. Регулирование мирового финансового рынка : Теория, практика, инструменты : монография / Российский экономический университет им. Г.В. Плеханова. - Москва : ИНФРА-М, 2021. - 410 с.	http://lib.mkgtu.ru:8004/catalog/fo12?SHOW_ONE_BOOK+0A1A1F
Галанов, В.А. Рынок ценных бумаг : учебник / Галанов В.А. - 2-е изд., перераб. и доп. - Москва : ИНФРА-М, 2022. - 414 с.	http://lib.mkgtu.ru:8004/catalog/fo12?SHOW_ONE_BOOK+0BBC0E
Кириянов, И.В. Рынок ценных бумаг и биржевое дело [Электронный ресурс]: учебное пособие / И.В. Кириянов. - М.: Инфра-М, 2016. - 264 с.	http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=456352

Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся из числа инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья (ОВЗ) предоставляются в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

Для лиц с нарушениями зрения:

- в печатной форме увеличенным шрифтом,
- в форме электронного документа,
- в форме аудиофайла,
- в печатной форме на языке Брайля.

Для лиц с нарушениями слуха:

- в печатной форме,
- в форме электронного документа.

Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

- в печатной форме,
- в форме электронного документа,
- в форме аудиофайла.



7. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине (модулю)

7.1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

Этапы формирования компетенции (номер семестр согласно учебному плану)			Наименование учебных дисциплин, формирующие компетенции в процессе освоения образовательной программы
ОФО	ЗФО	ОЗФО	
ПКУВ-1.2 Разрабатывает финансовый план для клиента, формирует целевой инвестиционный портфель			
2	3		Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках
3	4		Управление инвестиционным портфелем
2	2		Научно-исследовательская работа
4	45		Практика по профилю профессиональной деятельности
2	2		Инвестиции в финансовые активы
1	1		Ознакомительная практика
4	5		Преддипломная практика для выполнения выпускной квалификационной работы
ПКУВ-6.1 Консультирует квалифицированных и неквалифицированных инвесторов по вопросам операций на биржевом и небиржевом финансовых рынках			
1	2		Математическое обеспечение финансовых решений
2	3		Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках
3	3		Производные финансовые инструменты
3	3		Мировые фондовые рынки
3	4		Управление инвестиционным портфелем
2	2		Научно-исследовательская работа
4	45		Практика по профилю профессиональной деятельности
1	1		Ознакомительная практика
4	5		Преддипломная практика для выполнения выпускной квалификационной работы
УК-1.1 Анализирует задачу, выделяя ее базовые составляющие, осуществляет декомпозицию задачи			
1	1		Финансовые и денежно-кредитные методы регулирования экономики
2	2		Финансовый анализ (продвинутый уровень)
3	3		Цифровые технологии в науке, экономике и управлении
2	3		Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках
1	2		Международные операции банка
2	3		Маркетинг и кредитная политика банков
2	3		Финансовое право
3	4		Оценка финансовой устойчивости коммерческих банков



Этапы формирования компетенции (номер семестр согласно учебному плану)			Наименование учебных дисциплин, формирующие компетенции в процессе освоения образовательной программы
ОФО	ЗФО	ОЗФО	
2	2		Научно-исследовательская работа
4	45		Практика по профилю профессиональной деятельности
1	3		Банковский розничный рынок
2	2		Инвестиции в финансовые активы
1	1		Ознакомительная практика
4	5		Преддипломная практика для выполнения выпускной квалификационной работы
УК-1.2 Находит и критически анализирует информацию, необходимую для решения поставленной задачи			
1	1		Методология научного исследования
2	3		Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках
2	3		Маркетинг и кредитная политика банков
1	1		Ознакомительная практика
2	2		Научно-исследовательская работа
4	45		Практика по профилю профессиональной деятельности
1	3		Банковский розничный рынок
2	2		Инвестиции в финансовые активы
4	5		Преддипломная практика для выполнения выпускной квалификационной работы

7.2. Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкалы оценивания

Планируемые результаты освоения компетенции	Критерии оценивания результатов обучения				Наименование оценочного средства
	неудовлетворительно	удовлетворительно	хорошо	отлично	
1	2	3	4	5	6
УК-1: Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий					
УК-1.1 Анализирует задачу, выделяя ее базовые составляющие, осуществляет декомпозицию задачи					
Знать: логические формы и процедуры, способствующие рефлексии по поводу собственной и мыслительной деятельности	Фрагментарные знания	Неполные знания	Сформированные, но содержащие отдельные пробелы знания	Сформированные систематические знания	тесты, рефераты, экзамен
Уметь: аргументированно формировать собственное суждение и оценку информации	Частичные умения	Неполные умения	Умения полные, допускаются небольшие ошибки	Сформированные умения	
Владеть: навыками сопоставления разных источников	Частичное владение навыками	Несистематическое применение навыков	В систематическом применении навыков допускаются	Успешное и систематическое применение навыков	



Планируемые результаты освоения компетенции	Критерии оценивания результатов обучения				Наименование оценочного средства
	неудовлетворительно	удовлетворительно	хорошо	отлично	
1	2	3	4	5	6
информации с целью выявления их противоречий и поиска достоверных суждений			пробелы		
УК-1: Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий					
УК-1.2 Находит и критически анализирует информацию, необходимую для решения поставленной задачи					
Знать: - особенности системного и критического мышления и демонстрировать готовность к нему;- логические формы и процедуры, демонстрировать способность к рефлексии по поводу собственной и мыслительной деятельности.	Фрагментарные знания	Неполные знания	Сформированные, но содержащие отдельные пробелы знания	Сформированные систематические знания	тесты, рефераты, экзамен
Уметь: анализировать источники информации с точки зрения временных и пространственных условий их возникновения.	Частичные умения	Неполные умения	Умения полные, допускаются небольшие ошибки	Сформированные умения	
Владеть: навыками определения практических последствий изложенного решения задачи.	Частичное владение навыками	Несистематическое применение навыков	В систематическом применении навыков допускаются пробелы	Успешное и систематическое применение навыков	
ПКУВ-1: Демонстрирует комплексные знания и системное понимание базовых основ методов, приемов и технологий в проектировании изделий и технологических процессов производства одежды					
ПКУВ-1.2 Разрабатывает финансовый план для клиента, формирует целевой инвестиционный портфель					
Знать: основные принципы финансовой математики, принципы портфельного управления инвестированием.	Фрагментарные знания	Неполные знания	Сформированные, но содержащие отдельные пробелы знания	Сформированные систематические знания	тесты, рефераты, экзамен
Уметь: оценивать затраты на поведение финансовых операций; рассчитывать величину портфеля, достаточную для покрытия финансовых целей; выявлять с оответствие/несоответствие инвестиционного профиля клиента параметрам	Частичные умения	Неполные умения	Умения полные, допускаются небольшие ошибки	Сформированные умения	



Планируемые результаты освоения компетенции	Критерии оценивания результатов обучения				Наименование оценочного средства
	неудовлетворительно	удовлетворительно	хорошо	отлично	
1	2	3	4	5	6
инвестиционного портфеля; рассчитывать размер инвестиций, необходимый для достижения целей клиентов; рассчитывать целевую доходность в зависимости от финансовых целей и начального капитала.					
Владеть: навыками составления инвестиционного портфеля; выявления качественных и количественных свойств рисков в предполагаемых к использованию финансовых продуктах.	Частичное владение навыками	Несистематическое применение навыков	В систематическом применении навыков допускаются пробелы	Успешное и систематическое применение навыков	
ПКУВ-6: Способность организовывать производство строительно-монтажных работ в сфере промышленного гражданского строительства					
ПКУВ-6.1 Консультирует квалифицированных и неквалифицированных инвесторов по вопросам операций на биржевом и небиржевом финансовых рынках					
Знать: особенности проведения фундаментального и технического анализа на финансовых рынках; инструменты финансового рынка и их характеристики; экономические и юридические аспекты проведения операций на финансовых рынках.	Фрагментарные знания	Неполные знания	Сформированные, но содержащие отдельные пробелы знания	Сформированные систематические знания	тесты, рефераты, экзамен
Уметь: осуществлять анализ и оценку инструментов финансового рынка, оказывать качественные профессиональные информационные услуги в рамках проведения консультационных мероприятий.	Частичные умения	Неполные умения	Умения полные, допускаются небольшие ошибки	Сформированные умения	
Владеть: навыками построения прогноза развития	Частичное владение навыками	Несистематическое применение навыков	В систематическом применении навыков допускаются	Успешное и систематическое применение навыков	



Планируемые результаты освоения компетенции	Критерии оценивания результатов обучения				Наименование оценочного средства
	неудовлетворительно	удовлетворительно	хорошо	отлично	
1	2	3	4	5	6
ситуации на финансовых рынках, навыками оказания консультационных услуг по вопросам осуществления операций на финансовых рынках.			пробелы		

7.3. Типовые контрольные задания и иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы

Тестовые задания для проведения текущего контроля знаний:

1. Чем определяется «качество» эмитента облигаций?

- A) Доходностью облигаций эмитента
- B) Информационной прозрачностью эмитента
- C) Чувствительностью цены облигаций к изменению процентной ставки на рынке
- D) Риском невыплаты процентов и/или основной суммы долга.

2. Что отражает разрыв в доходности государственных облигаций и облигаций частной компании?

- A) Риск изменения рыночных процентных ставок
- B) Риск реинвестирования купона
- C) Кредитный риск

3. На каких исходных положениях базируется фундаментальный анализ?

I Анализируемая компания в будущем будет действующим предприятием

II Предприятие имеет внутреннюю стоимость, которую можно определить путем анализа данных о компании

III В каждый момент внутренняя стоимость предприятия совпадает с его рыночной



стоимостью

IV Внутренняя стоимость предприятия будет признана рынком в долгосрочной перспективе

A) Только I, II и III

B) Только I, II и IV

C) Только I и III

D) Только II и IV

4. Какое из нижеперечисленных утверждений соответствует одному из постулатов технического анализа?

A) Цены на финансовых рынках изменяются случайным образом

B) Колебание цен на финансовых рынках имеет циклический характер

C) В динамике цен на финансовых рынках проявляются устойчивые тенденции

D) Изменение цен на финансовых рынках обусловлено только экономическими факторами.

5. Для какой из перечисленных ниже целей применяется технический анализ?

A) Отбор ценных бумаг при формировании портфеля

B) Выбор времени покупки и продажи ценных бумаг

C) Прогнозирование значения рыночной цены на следующий день

D) Анализ рисков на фондовом рынке

6. Что соединяет на ценовом графике линия повышательного тренда?

A) Несколько последовательных максимумов цен

B) Несколько последовательных минимумов цен

C) Цены закрытия торгов



Д) Несколько зон консолидации цен

7. В каком из нижеперечисленных случаев понижательный ценовой тренд будет считаться прерванным?

А) Если после пересечения линии тренда цена возрастает более чем на 3%

В) Если после пересечения линии тренда цены идут вверх в течение двух дней

С) Ни в одном из перечисленных случаев

Д) В обоих случаях

8. Что обычно происходит на рынке после образования формации "голова и плечи"?

А) Перелом повышательной тенденции

В) Консолидация цен

С) Образование временной паузы в ходе роста цен

Д) Усиление повышательной тенденции

9. Что из нижеперечисленного позволяют определить индикаторы тренда?

А) Вероятные моменты перелома ценового тренда

В) Вероятные моменты ослабления ценового тренда

С) Наличие ценового тренда и его направление

Д) Все вышеперечисленное

10. В каком из нижеперечисленных случаев скользящая средняя подает сигнал на покупку?

А) Цены находятся над скользящей средней

В) Цены находятся под скользящей средней

С) Цены пересекают скользящую среднюю сверху вниз



Д) Цены пересекают скользящую среднюю снизу вверх

11. Каким кредитным рейтингом должны обладать облигации «инвестиционного качества»?

А) Не ниже А

В) ВВВ и выше

С) Не ниже ВВ

Д) ССС и выше

12. Что является предметом изучения в техническом анализе?

А) Конфиденциальная информация о деятельности компаний

В) Временные ряды цен сделок и объемов торгов

С) Показатели доходности финансовых инструментов

Д) Психология участников рынка

13. Какая из перечисленных ниже фигур не относится к формациям продолжения?

А) Треугольник

В) Флаг

С) Блюдце

Д) Клин

14. Скользящие средние расположены выше графика цен в следующем порядке сверху вниз: 18-дневная, 9-дневная, 4-дневная. Эта комбинация дает сигнал....

А) На покупку

В) На продажу



15. В каком случае следует ожидать снижение цены акций компании в долгосрочном периоде?

- А) Темп роста прибыли от реализации продукции превышает темп роста объема продаж
- В) Темп роста дивидендов превышает темп роста балансовой прибыли
- С) Темп роста дебиторской задолженности ниже темпа роста объема продаж
- Д) Темп роста собственного капитала превышает темп роста долгосрочных обязательств

16. Из ниже перечисленных укажите признак, наиболее характерный для недооцененных акций

- А) Устойчивое снижение цен акций
- В) Устойчивый рост цен акций
- С) Небольшое количество заявок на покупку акций
- Д) Внутренняя стоимость акций меньше их рыночной цены

17. Для каких компаний наиболее характерно низкое значение коэффициента P/E?

- А) Для компаний, находящихся в фазе циклического спада
- В) Для стабильных крупных компаний, регулярно выплачивающих дивиденды
- С) Для новых компаний, имеющих высокие темпы роста

18. Как рассчитывается показатель «финансового рычага»?

- А) Как отношение всех обязательств к собственному капиталу
- В) Как отношение долгосрочных обязательств к сумме активов
- С) Как отношение долгосрочных обязательств к собственному капиталу
- Д) Как отношение чистой прибыли к сумме активов

19. Что из нижеперечисленного будет типично для недооцененной компании при сравнении ее текущих показателей с соответствующими значениями в прошлом?



A) Относительно более высокая дивидендная доходность акций

B) Относительно меньший темп роста дивиденда

C) Относительно более высокое значение коэффициента P/E

O) Относительно меньшая рентабельность собственного капитала

20. Что можно приблизительно оценить с помощью показателя дюрации?

A) Изменение цены облигации при изменении рыночных процентных ставок

B) Изменение цены облигации при приближении срока погашения

C) Изменение доходности облигации при изменении ставки купонного дохода

D) Изменение доходности облигации при приближении срока погашения

21. На каких исходных положениях базируется технический анализ?

I Повторяемость моделей изменения цен

II Инертность показателей состояния рынка

III Наличие всей информации, необходимой для принятия решений, в рыночной цене

IV Существование объективных цен на финансовые инструменты

A) Только I, II и III

B) Только I, III и IV

C) Только II, III и IV

D) На всех приведенных

22. При каком из приведенных ниже сигналов индекса относительной силы можно ожидать возможное падение цен в ходе развития повышательного тренда?

A) Индекс образует "бычью" дивергенцию с графиком цен



В) Индекс поднялся выше 70%-ной отметки

С) Индекс опустился ниже 30%-ной отметки

Д) Индекс достиг уровня сопротивления на уровне 50%.

Темы рефератов

1. Системы принятия решений (системы биржевой игры): основные принципы построения и оптимизации
2. Основные виды временных интервалов и особенности работы на каждом из них.
3. Основные виды графиков и их особенности.
4. Постулаты технического анализа. Технический анализ в сравнении с другими видами анализа.
5. Теория Доу.
6. Графический анализ. Достоинства и недостатки
7. Виды трендов, порядок определения трендов.
8. Основные виды участников на рынке. Применение ими технического анализа.
9. Особенности применения технического анализа на срочных рынках
10. Особенности применения технического анализа на валютных рынках
11. Особенности применения технического анализа на рынках акций и облигаций
12. Психологические аспекты технического анализа.
13. Порядок тестирования нового технического индикатора.
14. Контроль за рисками в торговых стратегиях.
15. Механические торговые системы и их особенности.
16. Индикаторы настроения.
17. Разработка индивидуальной торговой системы.
18. Определение технического анализа, его отличительные особенности, преимущества.
19. Сопоставление технического и фундаментального анализа. Возможности совместного использования
20. Основные виды информации, используемые в техническом анализе. Первичные и второстепенные индикаторы рынка.

Примерный перечень вопросов к экзамену по дисциплине «Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках»

1. Понятие справедливой рыночной стоимости и инвестиционные стратегии на фондовом



рынке.

2. Основоположники фундаментального анализа. Принципы проведения фундаментального анализа и выставления рекомендаций заинтересованным лицам
3. Специфика разработки аналитических отчетов аналитиками инвестиционных компаний. Конфликты интересов. Ренкинги аналитиков
4. Многообразие показателей в рамках рыночного видения публичной компании.
5. Методы анализа рыночных тенденций: ретроспективный анализ, прогнозирование будущих трендов.
6. Основные макроэкономические индикаторы, определяющие динамику фондовых индексов.
7. Влияние делового цикла на поведение цен финансовых активов. Циклические экономические индикаторы.
8. Инструменты прогнозирования на фондовом рынке. Роль опережающих индикаторов.
9. Инфляционное влияние на цены акций (теория «перетекания») и группировка отраслей и компаний по инвестиционной привлекательности.
10. Задачи отраслевого анализа в рамках фундаментального анализа акций и облигаций. Ключевые отраслевые индикаторы.
11. Конкурентный анализ Портера. Жизненный цикл отрасли и рекомендации фундаментального анализа.
12. Данные для отраслевого анализа. Классификация отраслей. Растущие, защитные и циклические отрасли и инвестиционные стратегии.
13. Повышение значимости отраслевого прогнозирования и третье направление в фундаментальном анализе.
14. Процесс выбора акции (компании) для инвестирования. Получение информации о компаниях, проблемы работы со стандартной финансовой отчетностью.
15. Значимость анализа нефинансовой информации в рамках фундаментального анализа (структура владельцев капитала, концентрация собственного капитала, роль институциональных и иностранных инвесторов)
16. Традиционные и современные финансовые показатели анализа эффективности деятельности компаний.
17. Значимость нефинансовых показателей в построении инвестиционных стратегий. Социально-ответственные инвестиции
18. Классические инвестиционные стратегии, строящиеся на анализе мультипликаторов.
19. Страновые и отраслевые финансовые мультипликаторы и отслеживание их динамики.20. Обоснование выбора мультипликатора и требования к обработке данных.
21. Коррекция мультипликаторов на отраслевую специфику, степень развития рынка капитала и специфические характеристики отдельных инвестиционных активов.
22. Моделирование положения инвестора и ценообразование финансовых активов.
23. Конструкция портфельных моделей и модификации с учетом возможностей формирования параметров и недиверсифицированной позиции инвесторов.



24. Реализованная рыночная доходность и гипотетическая, методы вычисления.
25. Модели фундаментальных факторов в рамках гипотетического метода.
26. Динамика волатильности рынков акций и облигаций и модификация конструкции CAPM.
27. Фундаментальные факторы прогнозирования.
28. Переход к многофакторным моделям: конструирование ключевых факторов для развитых и развивающихся рынков.
29. Модели одностороннего риска в прогнозировании цен финансовых активов.
30. Основные характеристики развивающихся рынков капитала.
31. Информационные эффекты на развивающихся рынках капитала. Влияние поведения цен на финансовые активы на российском рынке.
32. Многофакторные модели для российского рынка, выявление факторов влияния. Значимость специфических рисков.
33. Значимость эффекта «восприятия» информации (модель Чена, 2001).
34. Учет фондовым рынком новостной информации по компаниям-эмитентам ценных бумаг.
35. Значимость качества корпоративного управления и оптимизации структуры собственности для инвестиционных стратегий на развивающихся рынках.
36. Основные постулаты технического анализа.
37. Основные положения теории Доу.
38. Параметры рынка ценных бумаг: цена и объём.
39. Принципы построения графиков и гистограмм в рамках технического анализа.
40. Понятие, виды и основные характеристики тенденций.
41. Графическое отображение тенденции.
42. Коридоры и каналы. Уровни и линии поддержки и сопротивления.
43. Ценовые пробелы.
44. Понятие графической фигуры, основные правила построения фигур.
45. Основные модели перелома тенденции: «голова и плечи», двойные и тройные вершины и основания, «блюдец», «шип».
46. Основные модели продолжения тенденции: треугольник, прямоугольник, флаг и вымпел.
47. Понятие индикатора. Основные предпосылки построения индикаторов.
48. Скользящие средние значения как основной вид индикаторов.
49. Достоинства, недостатки и область применения индикаторов.
50. Понятие осциллятора. Основные предпосылки построения осцилляторов.
51. Сопоставление технического и фундаментального анализа. Возможности совместного



использования

52. Основные виды информации, используемые в техническом анализе. Первичные и второстепенные индикаторы рынка.

53. Аксиомы технического анализа

54. Основные виды ценовых графиков.

55. Уровни поддержки и сопротивления: их экономическое и техническое значение

56. Линии поддержки и сопротивления, оценка силы поддержки/сопротивления.

57. Линия тренда, ее характеристики. Линия канала.

58. Основные фигуры разворота тренда

59. Фигуры продолжения

60. Условия достоверности графической модели.

61. Классификация методов индикаторного технического анализа, особенности и границы применения

62. Скользящие средние как основные индикаторы тренда, виды скользящих средних.

7.4. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений и навыков, и опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций

Требования к написанию реферата

Результат самостоятельной работы магистранта, представляющий собой краткое изложение в письменном виде полученных результатов (учебно-исследовательской) темы, где автор раскрывает суть исследуемой проблемы, приводит различные точки зрения, а также собственные взгляды на нее.

Реферат должен быть структурирован (по главам, разделам, параграфам) и включать разделы: введение, основная часть, заключение, список использованных источников. В зависимости от тематики реферата к нему могут быть оформлены приложения, содержащие документы, иллюстрации, таблицы, схемы и т.д. Объем реферата – 15-20 страниц печатного текста, включая титульный лист, введение, заключение и список литературы.

Его задачами являются:

1. Формирование умений самостоятельной работы с источниками литературы, их систематизация;
2. Развитие навыков логического мышления;
3. Углубление теоретических знаний по проблеме исследования.

При оценке реферата используются следующие критерии:

- новизна текста;



- обоснованность выбора источника;
- степень раскрытия сущности вопроса;
- соблюдения требований к оформлению.

Критерии оценивания реферата:

Отметка «отлично» - выполнены все требования к написанию и защите реферата: обозначена проблема и обоснована её актуальность, сделан краткий анализ различных точек зрения на рассматриваемую проблему и логично изложена собственная позиция, сформулированы выводы, тема раскрыта полностью, выдержан объём, соблюдены требования к внешнему оформлению, даны правильные ответы на дополнительные вопросы.

Отметка «хорошо» - основные требования к реферату и его защите выполнены, но при этом допущены недочёты. В частности, имеются неточности в изложении материала; отсутствует логическая последовательность в суждениях; невыдержан объём реферата; имеются упущения в оформлении; на дополнительные вопросы при защите даны неполные ответы.

Отметка «удовлетворительно» - имеются существенные отступления от требований к реферированию. В частности: тема освещена лишь частично; допущены фактические ошибки в содержании реферата или при ответе на дополнительные вопросы; во время защиты отсутствуют выводы и рекомендации.

Отметка «неудовлетворительно» - тема реферата не раскрыта, обнаруживается существенное непонимание проблемы.

Тематика рефератов выдается преподавателем в конце семинарского занятия.

Требования к выполнению тестового задания

Тестирование является одним из основных средств формального контроля качества обучения. Это метод, основанный на стандартизированных заданиях, которые позволяют измерить психофизиологические и личностные характеристики, а также знания, умения и навыки испытуемого.

Основные принципы тестирования:

- связь с целями обучения - цели тестирования должны отвечать критериям социальной полезности и значимости, научной корректности и общественной поддержки;
- объективность - использование в педагогических измерениях этого принципа призвано не допустить субъективизма и предвзятости в процессе этих измерений;
- справедливость и гласность - одинаково доброжелательное отношение ко всем обучающимся, открытость всех этапов процесса измерений, своевременность ознакомления обучающихся с результатами измерений;
- систематичность - систематичность тестирований и самопроверок каждого учебного модуля, раздела и каждой темы; важным аспектом данного принципа является требование репрезентативного представления содержания учебного курса в содержании теста.

Важнейшим является принцип, в соответствии с которым тесты должны быть построены по методике, обеспечивающей выполнение требований соответствующего федерального государственного образовательного стандарта.

В тестовых заданиях используются четыре типа вопросов:

- закрытая форма - является наиболее распространенной и предлагает несколько



альтернативных ответов на поставленный вопрос. Например, обучающемуся задается вопрос, требующий альтернативного ответа «да» или «нет», «является» или «не является», «относится» или «не относится» и т.п. Тестовое задание, содержащее вопрос в закрытой форме, включает в себя один или несколько правильных ответов и иногда называется выборочным заданием. Закрытая форма вопросов используется также в тестах-задачах с выборочными ответами. В тестовом задании в этом случае сформулированы условие задачи и все необходимые исходные данные, а в ответах представлены несколько вариантов результата решения в числовом или буквенном виде. Обучающийся должен решить задачу и показать, какой из представленных ответов он получил.

– открытая форма - вопрос в открытой форме представляет собой утверждение, которое необходимо дополнить. Данная форма может быть представлена в тестовом задании, например, в виде словесного текста, формулы (уравнения), графика, в которых пропущены существенные составляющие - части слова или буквы, условные обозначения, линии или изображения элементов схемы и графика. Обучающийся должен по памяти вставить соответствующие элементы в указанные места («пропуски»).

– установление соответствия - в данном случае обучающемуся предлагают два списка, между элементами которых следует установить соответствие;

– установление последовательности - предполагает необходимость установить правильную последовательность предлагаемого списка слов или фраз.

Критерии оценки знаний при проведении тестирования

Отметка «отлично» выставляется при условии правильного ответа не менее чем 85% тестовых заданий;

Отметка «хорошо» выставляется при условии правильного ответа не менее чем 70 % тестовых заданий;

Отметка «удовлетворительно» выставляется при условии правильного ответа не менее 50 %;

Отметка «неудовлетворительно» выставляется при условии правильного ответа менее чем на 50 % тестовых заданий.

Результаты текущего контроля используются при проведении промежуточной аттестации.

Критерии оценки знаний на экзамене

Отметка «неудовлетворительно» - магистрант не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки, с большими затруднениями выполняет практические задания.

Отметка «удовлетворительно» - магистрант усвоил только основной материал, но не знает отдельных деталей, допускает неточности, недостаточно правильные формулировки, нарушает последовательность в изложении программного материала и испытывает затруднения в выполнении практических заданий.

Отметка «хорошо» - магистрант твердо знает программный материал, грамотно и по существу излагает его, не допускает существенных неточностей в ответе на вопрос, может правильно применять теоретические положения и владеет необходимыми навыками при выполнении практических заданий.

Отметка «отлично» - магистрант глубоко и прочно усвоил весь программный материал, исчерпывающе, последовательно, грамотно и логически стройно его излагает, тесно увязывает теорию с практикой. Магистрант не затрудняется с ответом при видоизменении



задания, свободно справляется с задачами, заданиями и другими видами применения знаний, показывает знания законодательного и нормативно-технического материалов, правильно обосновывает принятые решения, владеет разносторонними навыками и приемами выполнения практических работ, обнаруживает умение самостоятельно обобщать и излагать материал, не допуская ошибок.

Экзаменатор может проставить экзамен без опроса или собеседования тем магистрантам, которые активно участвовали в семинарских занятиях.

Экзаменационные билеты (вопросы) утверждаются на заседании кафедры и подписываются заведующим кафедрой. В билете должно содержаться не более трех вопросов. Комплект экзаменационных билетов по дисциплине должен содержать 15–20 билетов.

Экзамен может проводиться в форме устного опроса по билетам (вопросам) или без билетов, с предварительной подготовкой или без подготовки, по усмотрению преподавателя. Экзаменатор вправе задавать вопросы сверх билета, а также, помимо теоретических вопросов, давать задачи по программе данного курса.



8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины (модуля)

8.1. Основная литература

Название	Ссылка
Реунова, Л.В. Финансовые рынки (финансово-экономические расчеты) [Элек-тронный ресурс]: учебно-методическое пособие / Л.В. Реунова, М.Н. Соколова, Н.И. Кабанова. - Майкоп: МГТУ, 2013. - 80 с.	http://mark.nbmgtu.ru/libdata.php?id=2000022688
Сребник, Б.В. Финансовые рынки: профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг : учебное пособие / Б.В. Сребник, Т.Б. Вилкова. - Москва : ИНФРА-М, 2022. - 366 с. -	http://lib.mkgtu.ru:8004/catalog/fo12?SHOW_ONE_BOOK+0BBCC7
Чижик, В.П. Финансовые рынки и институты : учебное пособие / Чижик В.П. - Москва : ФОРУМ : ИНФРА-М, 2020. - 384 с.	http://lib.mkgtu.ru:8004/catalog/fo12?SHOW_ONE_BOOK+0BBCCB
Гришина, О.А. Регулирование мирового финансового рынка : Теория, практика, инструменты : монография / Российский экономический университет им. Г.В. Плеханова. - Москва : ИНФРА-М, 2021. - 410 с.	http://lib.mkgtu.ru:8004/catalog/fo12?SHOW_ONE_BOOK+0A1A1F

8.2. Дополнительная литература

Название	Ссылка
Галанов, В.А. Рынок ценных бумаг : учебник / Галанов В.А. - 2-е изд., перераб. и доп. - Москва : ИНФРА-М, 2022. - 414 с.	http://lib.mkgtu.ru:8004/catalog/fo12?SHOW_ONE_BOOK+0BBC0E
Кирьянов, И.В. Рынок ценных бумаг и биржевое дело [Электронный ресурс]: учебное пособие / И.В. Кирьянов. - М.: Инфра-М, 2016. - 264 с.	http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=456352

8.3. Информационно-телекоммуникационные ресурсы сети «Интернет»

- Образовательный портал ФГБОУ ВО «МГТУ» [Электронный ресурс]: Режим доступа: <https://mkgtu.ru/> - Официальный сайт Правительства Российской Федерации. [Электронный ресурс]: Режим доступа: <http://www.government.ru> - Информационно-правовой портал «Гарант» [Электронный ресурс]: Режим доступа: <http://www.garant.ru/> - Научная электронная библиотека www.eLIBRARY.RU - Режим доступа: <http://elibrary.ru/> - Электронный каталог библиотеки - Режим доступа: // <http://lib.mkgtu.ru:8004/catalog/fo12>; [Znanium.com](http://znanium.com). Базовая коллекция : электронно-библиотечная система : сайт / ООО "Научно-издательский центр Инфра-М". - Москва, 2011 - - URL: <http://znanium.com/catalog> (дата обновления: 06.06.2019). - Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. - Текст: электронный. Фонд ЭБС формируется с учетом всех изменений образовательных стандартов и включает учебники, учебные пособия, УМК, монографии, авторефераты, диссертации, энциклопедии, словари и справочники, законодательно-нормативные документы, специальные периодические издания и издания, выпускаемые издательствами вузов. <http://znanium.com/catalog/IPRBooks>. Базовая коллекция : электронно-библиотечная система : сайт / Общество с ограниченной ответственностью Компания "Ай Пи Ар Медиа". - Саратов, 2010 - . - URL: <http://www.iprbookshop.ru/586.html> - Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. - Текст электронный. Является распространенным образовательным электронным ресурсом для высших и средних специальных учебных заведений, научно-исследовательских институтов, публичных библиотек, приобретающих корпоративный доступ для своих обучающихся, преподавателей и т.д. ЭБС включает учебную и научную литературу по направлениям подготовки высшего и среднего профессионального образования. <http://www.iprbookshop.ru/586.html> Национальная электронная библиотека (НЭБ) : федеральная государственная информационная система : сайт / Министерство культуры Российской Федерации, Российская государственная библиотека. - Москва, 2004 - - URL: <https://нэб.рф/>. - Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. - Текст: электронный. НЭБ -



проект Российской государственной библиотеки. Начиная с 2004 г. Проект Национальная электронная библиотека (НЭБ) разрабатывается ведущими российскими библиотеками при поддержке Министерства культуры Российской Федерации. Основная цель НЭБ - обеспечить свободный доступ гражданам Российской Федерации ко всем изданным, издаваемым и хранящимся в фондах российских библиотек изданиям и научным работам, – от книжных памятников истории и культуры, до новейших авторских произведений. В настоящее время проект НЭБ включает более 1.660.000 электронных книг, более 33.000.000 записей каталогов. РОССИЙСКАЯ НАЦИОНАЛЬНАЯ БИБЛИОТЕКА (РНБ) : сайт / Российская национальная библиотека. - Москва : РНБ, 1998. - URL: <http://nlr.ru/>. – Режим доступа: для зарегистрированных пользователей. – Текст: электронный. "... одна из крупнейших в мире и вторая по величине фондов в Российской Федерации – служит российской культуре и науке, хранит национальную память, способствует просвещению населяющих Россию народов и распространению идей гуманизма. ... В фондах Библиотеки хранится более 38,6 млн экз. произведений печати и иных информационных ресурсов, в том числе и на электронных носителях, доступных широкому кругу пользователей. Ежегодно РНБ посещает около 850 тыс. читателей, которым выдается до 5 млн изданий, к ее электронным ресурсам обращаются за год свыше 10 млн удаленных пользователей. ... Сохраняя культурную и историческую преемственность, верность библиотечным традициям, заложенным еще в Императорской Публичной библиотеке, РНБ сегодня — современное информационное учреждение, оснащенное новейшим оборудованием и своевременно отвечающее на насущные вызовы времени." (цитата с сайта РНБ: http://nlr.ru/nlr_visit/RA1162/rnb-today) <https://нэб.рф/>
Финансы.RU : [сайт]. - Москва, 1999. - . - URL: <http://www.finansy.ru/> (Дата обращения). - Текст: электронный. На сайте вы найдете экономические новости и сможете проследить тенденции в экономике, прочесть актуальные публикации по экономике и финансам. Студентам, аспирантам и научным работникам могут пригодиться размещаемые на сайте методические пособия, лекции, конспекты, переводы, тексты книг дипломы и диссертации.
<http://www.finansy.ru/>



9. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

Учебно-методические материалы по лекциям дисциплины Б1.В.05 Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках

Раздел/Тема с указанием основных учебных элементов (дидактических единиц)	Методы обучения	Способы (формы) обучения	Средства обучения	Формируемые компетенции
<p>Тема 1. Современные методы анализа на финансовых рынках.</p> <p>Основные понятия и предпосылки фундаментального анализа.</p>	<p>по источнику знаний: лекция, чтение, конспектирование</p> <p>по назначению: приобретение знаний, анализ, закрепление, проверка знаний</p> <p>по типу познавательной деятельности: объяснительно-иллюстративный, репродуктивный</p>	<p>Изучение нового учебного материала, контроль знаний, самостоятельная работа</p>	<p>Устная речь, учебники, учебные пособия, книги, тестовые задания</p>	<p>ПКУВ-1.2 - Разрабатывает финансовый план для клиента, формирует целевой инвестиционный портфель</p>
<p>Тема 2. Особенности аналитической работы на финансовых рынках. Работа с информацией.</p>	<p>по источнику знаний: лекция, чтение, конспектирование</p> <p>по назначению: приобретение знаний, анализ, закрепление, проверка знаний</p> <p>по типу познавательной деятельности: объяснительно-иллюстративный, репродуктивный</p>	<p>Изучение нового учебного материала, контроль знаний, самостоятельная работа</p>	<p>Устная речь, учебники, учебные пособия, книги, тестовые задания</p>	<p>ПКУВ-1.2 - Разрабатывает финансовый план для клиента, формирует целевой инвестиционный портфель</p>
<p>Тема 3. Два направления проведения фундаментального анализа: «сверху-вниз» и «снизу-вверх». Нахождение справедливой цены</p>	<p>по источнику знаний: лекция, чтение, конспектирование</p> <p>по назначению: приобретение знаний, анализ, закрепление, проверка знаний</p> <p>по типу познавательной деятельности: объяснительно-иллюстративный, репродуктивный</p>	<p>Изучение нового учебного материала, контроль знаний, самостоятельная работа</p>	<p>Устная речь, учебники, справочники, слайды, учебные пособия, книги, тестовые задания</p>	<p>УК-1.1 - Анализирует проблемную ситуацию как целостную систему, выявляя ее составляющие и связи между ними</p>
<p>Тема 4. Сравнительный подход в</p>	<p>по источнику знаний: лекция, чтение,</p>	<p>Изучение нового</p>	<p>Устная речь, учебники,</p>	<p>УК-1.1 - Анализирует проблемную ситуацию как</p>

фундаментальном анализе для сопоставления фондовых рынков и отдельных акций.	<p>конспектирование</p> <p>по назначению: приобретение знаний, анализ, закрепление, проверка знаний</p> <p>по типу познавательной деятельности: объяснительно-иллюстративный, репродуктивный</p>	учебного материала, контроль знаний, самостоятельная работа	учебные пособия, книги, тестовые задания	целостную систему, выявляя ее составляющие и связи между ними
Тема 5.Основные постулаты и предпосылки технического анализа. Принципы графического анализа ценных бумаг.	<p>по источнику знаний: лекция, чтение, конспектирование</p> <p>по назначению: приобретение знаний, анализ, закрепление, проверка знаний</p> <p>по типу познавательной деятельности: объяснительно-иллюстративный, репродуктивный</p>	Изучение нового учебного материала, контроль знаний, самостоятельная работа	Устная речь, учебники, учебные пособия, книги, тестовые задания	ПКУВ-6.1 - Консультирует квалифицированных и неквалифицированных инвесторов по вопросам операций на биржевом и небиржевом финансовых рынках.
Тема 6.Тенденции на рынке ценных бумаг и принципы их выявления.	<p>по источнику знаний: лекция, чтение, конспектирование</p> <p>по назначению: приобретение знаний, анализ, закрепление, проверка знаний</p> <p>по типу познавательной деятельности: объяснительно-иллюстративный, репродуктивный</p>	Изучение нового учебного материала, контроль знаний, самостоятельная работа	Устная речь, учебники, учебные пособия, книги, тестовые задания	ПКУВ-6.1 Консультирует квалифицированных и неквалифицированных инвесторов по вопросам операций на биржевом и небиржевом финансовых рынках.
Тема 7. Графические модели перелома и продолжения тенденции. Индикаторы технического анализа: виды и применение для построения торговых стратегий	<p>по источнику знаний: лекция, чтение, конспектирование</p> <p>по назначению: приобретение знаний, анализ, закрепление, проверка знаний</p> <p>по типу познавательной деятельности: объяснительно-иллюстративный, репродуктивный</p>	Изучение нового учебного материала, контроль знаний, самостоятельная работа	Устная речь, учебники, учебные пособия, книги, тестовые задания	УК-1.2 - Разрабатывает варианты решения проблемной ситуации на основе критического анализа доступных источников информации
Тема 8.Специальные методы технического анализа ценных бумаг. Практические аспекты построения торговых стратегий на фондовом рынке	<p>по источнику знаний: лекция, чтение, конспектирование</p> <p>по назначению: приобретение знаний, анализ, закрепление, проверка знаний</p> <p>по типу познавательной деятельности: объяснительно-</p>	Изучение нового учебного материала, контроль знаний, самостоятельная работа	Устная речь, учебники, учебные пособия, книги, тестовые задания	УК-1.2 - Разрабатывает варианты решения проблемной ситуации на основе критического анализа доступных источников информации

Учебно-методические материалы по практическим (семинарским) занятиям дисциплины Б1.В.05 Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках

№ раздела дисциплины	Наименование практических занятий	Методы обучения	Способы (формы) обучения	Средства обучения
Тема 1.	Современные методы анализа на финансовых рынках.	<p>по источнику знаний: лекция, чтение, конспектирование</p> <p>по назначению: приобретение знаний, анализ, закрепление, проверка знаний</p> <p>по типу познавательной деятельности: объяснительно-иллюстративный, репродуктивный</p>	Изучение нового учебного материала, контроль знаний, самостоятельная работа	тесты, реферат
Тема 2.	Особенности аналитической работы на финансовых рынках.	<p>по источнику знаний: лекция, чтение, конспектирование</p> <p>по назначению: приобретение знаний, анализ, закрепление, проверка знаний</p> <p>по типу познавательной деятельности: объяснительно-иллюстративный, репродуктивный</p>	Изучение нового учебного материала, контроль знаний, самостоятельная работа	тесты, реферат
Тема 3.	Два направления проведения фундаментального анализа: «сверху-вниз» и «снизу- вверх».	<p>по источнику знаний: лекция, чтение, конспектирование</p> <p>по назначению: приобретение знаний, анализ, закрепление, проверка знаний</p> <p>по типу познавательной деятельности: объяснительно-иллюстративный, репродуктивный</p>	Изучение нового учебного материала, контроль знаний, самостоятельная работа	тесты, реферат
Тема 4.	Сравнительный подход в фундаментальном анализе для сопоставления фондовых рынков и отдельных акций.	<p>по источнику знаний: лекция, чтение, конспектирование</p> <p>по назначению: приобретение знаний, анализ, закрепление, проверка знаний</p>	Изучение нового учебного материала, контроль знаний, самостоятельная работа	тесты, реферат

		по типу познавательной деятельности: объяснительно-иллюстративный, репродуктивный		
Тема 5.	Основные постулаты и предпосылки технического анализа.	по источнику знаний: лекция, чтение, конспектирование по назначению: приобретение знаний, анализ, закрепление, проверка знаний по типу познавательной деятельности: объяснительно-иллюстративный, репродуктивный	Изучение нового учебного материала, контроль знаний, самостоятельная работа	тесты, реферат
Тема 6.	Тенденции на рынке ценных бумаг и принципы их выявления.	по источнику знаний: лекция, чтение, конспектирование по назначению: приобретение знаний, анализ, закрепление, проверка знаний по типу познавательной деятельности: объяснительно-иллюстративный, репродуктивный	Изучение нового учебного материала, контроль знаний, самостоятельная работа	тесты, реферат
Тема 7.	Графические модели перелома и продолжения тенденции.	по источнику знаний: лекция, чтение, конспектирование по назначению: приобретение знаний, анализ, закрепление, проверка знаний по типу познавательной деятельности: объяснительно-иллюстративный, репродуктивный	Изучение нового учебного материала, контроль знаний, самостоятельная работа	тесты, реферат
Тема 8.	Специальные методы технического анализа ценных бумаг.	по источнику знаний: лекция, чтение, конспектирование по назначению: приобретение знаний, анализ, закрепление, проверка знаний по типу познавательной деятельности: объяснительно-иллюстративный, репродуктивный	Изучение нового учебного материала, контроль знаний, самостоятельная работа	тесты, реферат

10. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости)

10.1. Перечень необходимого программного обеспечения

Название
7-Zip Свободная лицензия
1С Предприятие 8.3 - учебная версия Свободная лицензия
Adobe Reader DC Свободная лицензия
Microsoft Office Word 2010 Номер продукта 14.0.6024.1000 SP1 MSO 02260-018-0000106-48095
Антивирус kaspersky endpoint security Лицензионный договор от 17.02.2021 № 203-20122401

10.2. Перечень необходимых информационных справочных систем:

Каждый обучающийся в течение всего периода обучения обеспечен индивидуальным неограниченным доступом к электронно-библиотечным системам:

Название
Znaniy.com. Базовая коллекция : электронно-библиотечная система : сайт / ООО 'Научно-издательский центр Инфра-М'. - Москва, 2011 - - URL: http://znaniy.com/catalog (дата обновления: 06.06.2019). - Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. - Текст: электронный. Фонд ЭБС формируется с учетом всех изменений образовательных стандартов и включает учебники, учебные пособия, УМК, монографии, авторефераты, диссертации, энциклопедии, словари и справочники, законодательно-нормативные документы, специальные периодические издания и издания, выпускаемые издательствами вузов. http://znaniy.com/catalog/
IPRBooks. Базовая коллекция : электронно-библиотечная система : сайт / Общество с ограниченной ответственностью Компания 'Ай Пи Ар Медиа'. - Саратов, 2010 - . - URL: http://www.iprbookshop.ru/586.html - Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. - Текст электронный. Является распространенным образовательным электронным ресурсом для высших и средних специальных учебных заведений, научно-исследовательских институтов, публичных библиотек, приобретающих корпоративный доступ для своих обучающихся, преподавателей и т.д. ЭБС включает учебную и научную литературу по направлениям подготовки высшего и среднего профессионального образования. http://www.iprbookshop.ru/586.html
Национальная электронная библиотека (НЭБ) : федеральная государственная информационная система : сайт / Министерство культуры Российской Федерации, Российская государственная библиотека. - Москва, 2004 - - URL: https://нэб.рф/ . - Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. - Текст: электронный. НЭБ - проект Российской государственной библиотеки. Начиная с 2004 г. Проект Национальная электронная библиотека (НЭБ) разрабатывается ведущими российскими библиотеками при поддержке Министерства культуры Российской Федерации. Основная цель НЭБ - обеспечить свободный доступ гражданам Российской Федерации ко всем изданным, издаваемым и хранящимся в фондах российских библиотек изданиям и научным работам, - от книжных памятников истории и культуры, до новейших авторских произведений. В настоящее время проект НЭБ включает более 1.660.000 электронных книг, более 33.000.000 записей каталогов.РОССИЙСКАЯ НАЦИОНАЛЬНАЯ БИБЛИОТЕКА (РНБ) : сайт / Российская национальная библиотека. - Москва : РНБ, 1998. - URL: http://nlr.ru/ . - Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. - Текст: электронный. '... одна из крупнейших в мире и вторая по величине фондов в Российской Федерации - служит российской культуре и науке, хранит национальную память, способствует просвещению населения России народов и распространению идей гуманизма. ... В фондах Библиотеки хранится более 38,6 млн экз. произведений печати и иных информационных ресурсов, в том числе и на электронных носителях, доступных широкому кругу пользователей. Ежегодно РНБ посещает около 850 тыс. читателей, которым выдается до 5 млн изданий, к ее электронным ресурсам обращаются за год свыше 10 млн удаленных пользователей. ... Сохраняя культурную и историческую преемственность, верность библиотечным традициям, заложенным еще в Императорской Публичной библиотеке, РНБ сегодня — современное информационное учреждение, оснащенное новейшим оборудованием и своевременно отвечающее на насущные вызовы времени.' (цитата с сайта РНБ: http://nlr.ru/nlr_visit/RA1162/rnb-today) https://нэб.рф/
Финансы.RU : [сайт]. - Москва, 1999. - . - URL: http://www.finansy.ru/ (Дата обращения). - Текст: электронный. На сайте вы найдете экономические новости и сможете проследить тенденции в экономике, прочесть актуальные публикации по экономике и финансам. Студентам, аспирантам и научным работникам могут пригодиться размещаемые на сайте методические пособия, лекции, конспекты, переводы, тексты книг дипломы и диссертации. http://www.finansy.ru/

Для обучающихся обеспечен доступ (удаленный доступ) к следующим современным профессиональным базам данных, информационным справочным и поисковым системам:

Название



Znanium.com. Базовая коллекция : электронно-библиотечная система : сайт / ООО 'Научно-издательский центр Инфра-М'. - Москва, 2011 - - URL: <http://znanium.com/catalog> (дата обновления: 06.06.2019). - Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. - Текст: электронный. Фонд ЭБС формируется с учетом всех изменений образовательных стандартов и включает учебники, учебные пособия, УМК, монографии, авторефераты, диссертации, энциклопедии, словари и справочники, законодательно-нормативные документы, специальные периодические издания и издания, выпускаемые издательствами вузов. <http://znanium.com/catalog/>

IPRBooks. Базовая коллекция : электронно-библиотечная система : сайт / Общество с ограниченной ответственностью Компания 'Ай Пи Ар Медиа'. - Саратов, 2010 - . - URL: <http://www.iprbookshop.ru/586.html> - Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. - Текст электронный. Является распространенным образовательным электронным ресурсом для высших и средних специальных учебных заведений, научно-исследовательских институтов, публичных библиотек, приобретающих корпоративный доступ для своих обучающихся, преподавателей и т.д. ЭБС включает учебную и научную литературу по направлениям подготовки высшего и среднего профессионального образования. <http://www.iprbookshop.ru/586.html>

Национальная электронная библиотека (НЭБ) : федеральная государственная информационная система : сайт / Министерство культуры Российской Федерации, Российская государственная библиотека. - Москва, 2004 - - URL: <https://нэб.рф/>. - Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. - Текст: электронный. НЭБ - проект Российской государственной библиотеки. Начиная с 2004 г. Проект Национальная электронная библиотека (НЭБ) разрабатывается ведущими российскими библиотеками при поддержке Министерства культуры Российской Федерации. Основная цель НЭБ - обеспечить свободный доступ гражданам Российской Федерации ко всем изданным, издаваемым и хранящимся в фондах российских библиотек изданиям и научным работам, - от книжных памятников истории и культуры, до новейших авторских произведений. В настоящее время проект НЭБ включает более 1.660.000 электронных книг, более 33.000.000 записей каталогов.РОССИЙСКАЯ НАЦИОНАЛЬНАЯ БИБЛИОТЕКА (РНБ) : сайт / Российская национальная библиотека. - Москва : РНБ, 1998. - URL: <http://nlr.ru/>. - Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. - Текст: электронный. '... одна из крупнейших в мире и вторая по величине фондов в Российской Федерации - служит российской культуре и науке, хранит национальную память, способствует просвещению населяющих Россию народов и распространению идей гуманизма. ... В фондах Библиотеки хранится более 38,6 млн экз. произведений печати и иных информационных ресурсов, в том числе и на электронных носителях, доступных широкому кругу пользователей. Ежегодно РНБ посещает около 850 тыс. читателей, которым выдается до 5 млн изданий, к ее электронным ресурсам обращаются за год свыше 10 млн удаленных пользователей. ... Сохраняя культурную и историческую преемственность, верность библиотечным традициям, заложенным еще в Императорской Публичной библиотеке, РНБ сегодня — современное информационное учреждение, оснащенное новейшим оборудованием и своевременно отвечающее на насущные вызовы времени.' (цитата с сайта РНБ: http://nlr.ru/nlr_visit/RA1162/rnb-today) <https://нэб.рф/>

Финансы.RU : [сайт]. - Москва, 1999. - . - URL: <http://www.finansy.ru/> (Дата обращения). - Текст: электронный. На сайте вы найдете экономические новости и сможете проследить тенденции в экономике, прочесть актуальные публикации по экономике и финансам. Студентам, аспирантам и научным работникам могут пригодиться размещаемые на сайте методические пособия, лекции, конспекты, переводы, тексты книг дипломы и диссертации. <http://www.finansy.ru/>



11. Описание материально-технической базы необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)

Наименования специальных помещений и помещений для самостоятельной работы	Оснащенность специальных помещений и помещений для самостоятельной работы	Перечень лицензионного программного обеспечения. Реквизиты подтверждающего документа
Лекционные аудитории: 5-11, 5-16, 5-19, 3-19 Аудитории для занятий семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации: 5-14, 5-22, 5-23	Оснащена: специализированная мебель, 26 посадочных мест, LCD экран, компьютер, мультимедиа проектор.	Microsoft .NET Framework 4.7 Свободная лицензия Операционная система Windows Договор от 26.05.2020 № 32009117096 Договор от 17.01.2019 № 31908696765 Офисный пакет Microsoft office 2016 Договор от 26.05.2020 № 32009117096 Договор от 17.01.2019 № 31908696765
Читальный зал ФГБОУ ВО «МГТУ»: ул. Первомайская, 191, 3 этаж.	Читальный зал имеет 150 посадочных мест, компьютерное оснащение с выходом в Интернет на 30 посадочных мест; оснащён специализированной мебелью (столы, стулья, шкафы, шкафы выставочные), стационарное мультимедийное оборудование, оргтехника (принтеры, сканеры, ксероксы)	Свободно распространяемое (бесплатное не требующее лицензирования) программное обеспечение: 1. Операционная система на базе Linux; 2. Офисный пакет Open Office; 3. Графический пакет Gimp; 4. Векторный редактор Inkscape; Антивирусные программы: Kaspersky Endpoint Security - № лицензии 17E016012813174640772. Количество: 400 рабочих мест. Срок действия 1 год. обслуживания
Помещение для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования (1-318)	Информационно-технический отдел: технические средства обучения, служащие для предоставления учебной информации большой аудитории	

