

МИНИСТЕРСТВО СЕЛЬСКОГО ХОЗЯЙСТВА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное образовательное учреждение
высшего образования
«КУБАНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АГРАРНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИМЕНИ И. Т. ТРУБИЛИНА»

ФАКУЛЬТЕТ «ФИНАНСЫ И КРЕДИТ»



27.04. 2020 г.

Рабочая программа дисциплины

ФУНДАМЕНТАЛЬНЫЙ И ТЕХНИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ
НА ФИНАНСОВЫХ РЫНКАХ

(Адаптированная рабочая программа для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов, обучающихся по адаптированным основным профессиональным образовательным программам высшего образования)

Направление подготовки
38.04.08 Финансы и кредит
(программа академической магистратуры)

Направленность подготовки
«Финансы и кредит»

Уровень высшего образования
Магистратура

Форма обучения
Очная, заочная

Краснодар
2020

Рабочая программа дисциплины «Фундаментальный и технический анализ финансовых рынков» разработана на основе ФГОС ВО 38.04.08 «Финансы и кредит» (уровень магистратуры) утвержденного приказом Министерства образования и науки РФ от 30.03.2015г. №325 с изменениями и дополнениями от 13.07.2017 г.

Автор:

канд. экон. наук, доцент
кафедры денежного обращения и кредита



А.Ю.Аджиева

Рабочая программа обсуждена и рекомендована к утверждению решением кафедры денежного обращения и кредита от 20.04.2020г., протокол № 8.

Заведующий кафедрой
д-р экон. наук, профессор



Л.Ю. Питерская

Рабочая программа одобрена на заседании методической комиссии факультета «Финансы и кредит» от 24.04.2020 г. протокол № 8.

Председатель
методической комиссии
канд. экон. наук, профессор



О.А. Герасименко

Руководитель
основной профессиональной
образовательной программы
д-р экон. наук, профессор



Н.В. Липчиу

1 Цель и задачи освоения дисциплины

Целью освоения дисциплины «Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках» является формирование комплекса знаний об организационных, научных и методических основах в области технического анализа. В результате изучения дисциплины должны быть сформированы теоретические знания и практические навыки анализа и прогнозирования на основе фундаментального и технического анализа.

Задачи

- сформировать практические основы владения методами анализа инвестиционной привлекательности ценных бумаг, инструментарием, применяемом в процессе проведения фундаментального анализа.
- сформировать практические основы владения теоретическими и практическими навыками прогнозирования будущей стоимости с помощью графиков и индикаторов;
- сформировать практические основы владения основами прогнозирования цен с помощью финансовых показателей;
- сформировать практические основы владения базовыми навыками анализа рыночной ситуации.

2 Перечень планируемых результатов по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения ОПОП В

В результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции:

ПК-2 – владеть способностью анализировать и использовать различные источники информации для проведения финансово-экономических расчетов;

ПК-4 – владеть анализом и дать оценку существующих финансово-экономических рисков, составить и обосновать прогноз динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро- и мезоуровне.

3 Место дисциплины в структуре ОПОП ВО

«Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках» является дисциплиной вариативной части ОПОП ВО (Б1.В.08) подготовки обучающихся по направлению 38.04.08 Финансы и кредит, направленность «Финансы и кредит».

4 Объем дисциплины (72 часа, 2 зачетных единицы)

Виды учебной работы	Объем, часов	
	Очная	Заочная
Контактная работа	21	9
в том числе:		
— аудиторная по видам учебных занятий	20	8
— лекции	10	4
— практические (лабораторные)	10	4
— внеаудиторная	1	1
— зачет	1	1
— экзамен		
— защита контрольной работы		
Самостоятельная работа	51	63
Итого по дисциплине	72/2	72/2

5 Содержание дисциплины

По итогам изучаемого курса обучающиеся сдают зачет.

Дисциплина изучается на 1 курсе, во 2 семестре очной формы обучения, на 1 курсе, во 2 семестре заочной формы обучения.

Содержание и структура дисциплины по очной форме обучения

№ п/п	Тема. Основные вопросы	Формируемые компетенции	Семестр	Виды учебной работы, включая самостоятельную работу и трудоемкость (в часах)		
				Лекции	Практические занятия	Самостоятельная работа
1	Тема 1 Теоретические Основы фундаментального технического анализа на финансовых рынках 1 Современные тенденции развития всемирного хозяйства и их влияние на международные валютные отношения. 2 Взаимодействие процессов глобализации, регионализации, интеграции и транснационализации экономики, их влияние на структурные сдвиги в экономике, на состояние международных валютно-кредитных отношений.	ПК-2; ПК-4;	2	2	2	12
2	Тема 2 Аксиомы фундаментального и технического анализа, методология технического анализа 1. Теория 'оптимального валютного пространства Р. Манделла. Изменение валютного курса и способы его фиксации при определенном объеме спроса и предложения на иностранную валюту. 2. Оптимальный валютный курс, варианты его расчета, их преимущества и недостатки. 3. Состояние платежного баланса. Воздействие на валютный курс разницы процентных ставок в разных странах. 4. Влияние на валютный курс состояния валютного рынка и масштабов спекулятивных валютных операций на этих рынках. 5. Валютный курс как индикатор эффективности национальных издержек производства в системе мировой торговли. 6. Теоретические основы фундаментального и технического анализа 7. Методология технического анализа	ПК-2; ПК-4;	2	2	2	12
3	Тема 3. Линии тренда (Trendlines): выбор TD- точек и построение TD- линий, совершенствование метода отбора TD- точек. Ценовые проекции. Выбор точек и коэффициентов коррекции (retracement ratios).	ПК-2; ПК-4;				

	<p>Квалификаторы коррекции (RetracementQualifiers), коэффициенты тенденции (TrendFactors). Квалификаторы коррекции (RetracementQualifiers), коэффициенты тенденции (TrendFactors) Линии тренда(Trendlines):выбор TD-точек и построение TD-линий,совершенствование метода отбора TD- точекДисконтная (учетная) политика. Девизная политика. Валютные интервенции. Диверсификация валютных резервов. Валютные ограничения. "Курсовые еперекосы". 1. Ценовые проекции. Показатели платежного баланса и методы классификации его статей. Квалификаторыкоррекции(Retracement Qualifiers), коэффициенты тенденции™ (TrendFactors™) 3. Индекс расширения диапазона(Range Expransion Index — REI) и индикатор Демарка (DeMarkerIndicator) Концепция баланса официальных расчетов. Возврат к измерению сальдо платежного баланса лишь по текущимоперациям. Методы балансирования платежных балансов.</p>						2	2	2	12		
4	<p>Тема 4 Программное обеспечение технического анализа. 1. Основыпрогнозирования 2. Основыинструментария технического анализа Omega Tradestation, Radar Screen, AmiBroker</p>	; ПК-2; ПК-4;					2	4	4	15		
Итого										10	10	51

Содержание и структура дисциплины по заочной форме обучения

№ п/п	Тема. Основные вопросы	Формируемые компетенции	Семестр	Виды учебной работы, включая самостоятельную работу и трудоемкость (в часах)		
				Лекции	Практические занятия	Самостоятельная работа
1	<p>Тема 1 Теоретические основы фундаментального технического анализа на финансовых рынках</p> <p>1. Современные тенденции развития всемирного хозяйства и их влияние на международные валютные отношения.</p> <p>2. Взаимодействие процессов глобализации, регионализации, интеграции и транснационализации экономики, их влияние на структурные сдвиги в экономике, на состояние международных валютно-кредитных отношений.</p>	ПК-2; ПК-4;	2	2	2	21
2	<p>Тема 2 Аксиомы фундаментального и технического анализа, методология технического анализа</p> <p>7. Теория 'оптимального валютного пространства Р. Манделла. Изменение валютного курса и способы его фиксации при определенном объеме спроса и предложения на иностранную валюту.</p> <p>8. Оптимальный валютный курс, варианты его расчета, их преимущества и недостатки.</p> <p>9. Состояние платежного баланса. Воздействие на валютный курс разницы процентных ставок в разных странах.</p> <p>10. Влияние на валютный курс состояния валютного рынка и масштабов спекулятивных валютных операций на этих рынках.</p> <p>11. Валютный курс как индикатор эффективности национальных издержек производства в системе мировой торговли.</p> <p>12. Теоретические основы фундаментального и технического анализа</p> <p>13. Методология технического анализа</p>	ПК-2; ПК-4;	2	1	1	21

3	<p>Тема 3. Линии тренда (Trendlines): выбор TD-точек и построение TD- линий, совершенствование метода отбора TD-точек. Ценовые проекции. Выбор точек и коэффициентов коррекции (retracementratios). Квалификаторы коррекции (RetracementQualifiers), коэффициенты тенденции (TrendFactors). Квалификаторы коррекции (RetracementQualifiers), коэффициенты тенденции (TrendFactors) Линии тренда (Trendlines):выбор TD-точек и построение TD-линий, совершенствование метода отбора TD-точекДисконтная (учетная) политика. Девизная политика. Валютные интервенции. Диверсификация валютных резервов. Валютные ограничения. "Курсовые перекосы". 1. Ценовые проекции.Показатели платежного баланса и методы классификации его статей. 2. Квалификаторы коррекции (Retracement Qualifiers),коэффициенты тенденции™ (Trend Factors™) 3. Индекс расширения диапазона(Range Expansion Index — REI) ииндикатор Демарка (DeMarkerIndicator) Концепция баланса официальных расчетов. Возврат к измерению сальдо платежного баланса лишь по текущим операциям. Методы балансирования платежных балансов.</p>	ПК-2; ПК-4;	2	1	1	21
Итого				4	4	63

6 Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся подисциплине

Методические указания для самостоятельной работы

1. Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках: метод. рекомендации/ сост. А.Ю. Аджиева, И.А. Дикарева– Краснодар : КубГАУ, 2020. – 57 с. – Режим доступа:

https://edu.kubsau.ru/file.php/121/FTA_praktika_571090_v1_.PDF

2. Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках: метод. рекомендации / сост. А.Ю. Аджиева, И.А. Дикарева– Краснодар : КубГАУ, 2020. – 40 с. – Режим доступа:

https://edu.kubsau.ru/file.php/121/FTA_sam_rabota_571091_v1_.PDF

7. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации

7.1 Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения ОПОП ВО

Номер семестра*	Этапы формирования и проверки уровня сформированности компетенций по дисциплинам, практикам в процессе освоения ОПОП ВО
	ПК-2 - способностью анализировать и использовать различные источники информации для проведения финансово-экономических расчетов

1	Микроэкономика (продвинутый уровень)
1	Актуальные проблемы финансов
1	Практика по получению первичных профессиональных умений и навыков
2	Математическое обеспечение финансовых решений
2	Финансовая математика и финансовые решения
2	<i>Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках</i>
2	Производственная практика по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности (в том числе технологическая практика)
3	Финансовый анализ (продвинутый уровень)
3	Компьютерные технологии в науке, экономике и управлении
4	Оценка инвестиционных решений
4	Маркетинг и кредитная политика банков
4	Мировые фондовые рынки
4	Оценка финансовых активов
4	Налоговое планирование в корпорациях
4	Управление инвестиционным портфелем
4	Преддипломная практика
4	Защита выпускной квалификационной работы, включая подготовку к защите и процедуру защиты
ПК-4 - способностью провести анализ и дать оценку существующих финансово-экономических рисков, составить и обосновать прогноз динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро- и мезоуровне	
1	Микроэкономика (продвинутый уровень)
2	Макроэкономика (продвинутый уровень)
2	Финансовые рынки и финансово-кредитные институты
2	<i>Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках</i>
2	Производственная практика по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности (в том числе технологическая практика)
3	Управление банковскими и кредитными рисками
3	Производные финансовые инструменты
4	Мировые фондовые рынки
4	Маркетинг и кредитная политика банков
4	Преддипломная практика
4	Защита выпускной квалификационной работы, включая подготовку к защите и процедуру защиты

*Номер семестра соответствует этапу формирования компетенции

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

Планируемые результаты освоения компетенции (индикаторы достижения компетенции)	Уровень освоения				Оценочное средство
	незачтено	зачтено			
		неудовлетворительно (минимальный не достигнут)	удовлетворительно (минимальный, пороговый)	хорошо (средний)	
ПК-2 - способностью анализировать и использовать различные источники информации для проведения финансово-					

экономических расчетов;					
<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> -Принципы дисконтирования денежного потока -Принципы начисления сложных процентов -Принципы расчета приведенной и будущей стоимости -Принципы расчета доходности активов -Методы дисконтирования денежных потоков, методы многовариантных расчетов, методы математического моделирования и количественной оптимизации - Отечественные и международные стандарты в области финансового планирования -Методика финансового анализа состояния клиента -Принципы портфельного управления инвестированием -Основы стратегического менеджмента и маркетинга 	<p>Уровень знаний ниже минимальных требований, имели место грубые ошибки</p>	<p>Минимально допустимый уровень знаний, допущено много негрубых ошибок</p>	<p>Уровень знаний в объеме, соответствующем программе подготовки, допущено несколько негрубых ошибок</p>	<p>Уровень знаний в объеме, соответствующем программе подготовки, без ошибок</p>	<p>Тесты</p>
<p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> -Проводить структурированное интервью и анкетирование клиента на предмет инвестиционного профиля -Рассчитывать величину портфеля, достаточную для покрытия финансовых целей -Выявлять соответствие/несоответствие инвестиционного профиля клиента параметрам инвестиционного портфеля -Оценивать ресурсные затраты на внедрение и функционирование аппаратно-информационной составляющей процесса финансового консультирования - Оценивать полезность внедрения затрат на внедрение автоматизированных информационных систем по финансовому консультированию 	<p>При решении стандартных задач не продемонстрированы основные умения, имели место грубые ошибки</p>	<p>Продемонстрированы основные умения, решены типовые задачи с негрубыми ошибками, выполнены все задания, но не в полном объеме</p>	<p>Продемонстрированы все основные умения, решены все основные задачи с негрубыми ошибками, выполнены все задания в полном объеме, но некоторые с недочетами</p>	<p>Продемонстрированы все основные умения, решены все основные задачи с отдельными несущественными недочетами, выполнены все задания в полном объеме</p>	<p>Контр. работы</p>
<p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> -Составлением перечня рекомендаций по управлению инвестиционным риском -Расчетом целевой доходности в зависимости от финансовых целей и начального капитала -Анализом финансового положения клиента -Выявлением несоответствий текущего финансового состояния клиента его финансовым целям -Формированием финансового плана и критериев мониторинга его выполнения 	<p>При решении стандартных задач не продемонстрированы базовые навыки, имели место грубые ошибки</p>	<p>Имеется минимальный набор навыков для решения стандартных задач с некоторыми недочетами</p>	<p>Продемонстрированы базовые навыки при решении стандартных задач с некоторыми недочетами</p>	<p>Продемонстрированы навыки при решении нестандартных задач без ошибок и недочетов</p>	<p>компетентностно-ориентированные задания</p>
<p>ПК-4 - способностью провести анализ и дать оценку существующих финансово-экономических рисков, составить и обосновать прогноз динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро- и мезо-уровне;</p>					
<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Принципы формирования стоимости денег во времени - Методику финансового анализа состояния клиента - Принципы дисконтирования денежного потока - Принципы начисления сложных процентов -Принципы расчета приведенной и будущей 	<p>Уровень знаний ниже минимальных требований, имели место грубые ошибки</p>	<p>Минимально допустимый уровень знаний, допущено много негрубых ошибок</p>	<p>Уровень знаний в объеме, соответствующем программе подготовки, допущено несколько негрубых ошибок</p>	<p>Уровень знаний в объеме, соответствующем программе подготовки, без ошибок</p>	<p>тесты, рефераты</p>

<p>стоимости</p> <ul style="list-style-type: none"> – Принципы расчета доходности активов – Методы дисконтирования денежных потоков, методы многовариантности расчетов, методы математического моделирования и количественной оптимизации – Принципы соотношения риска и доходности – Отечественные и международные стандарты области финансового планирования 					
<p>Уметь:</p> <p>Проводить структурированное интервью и анкетирование клиента на предмет инвестиционного профиля</p> <ul style="list-style-type: none"> – Получать, интерпретировать и документировать результаты исследований – Использовать расчетные таблицы и калькуляторы – 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 клиента – Рассчитывать целевую доходность в зависимости от финансовых целей и начального капитала 	<p>Уровень знаний ниже минимальных требований, имели место грубые ошибки</p>	<p>Минимально допустимый уровень знаний, допущено много негрубых ошибок</p>	<p>Уровень знаний в объеме, соответствующем программе подготовки, допущено несколько негрубых ошибок</p>	<p>Уровень знаний в объеме, соответствующем программе подготовки, без ошибок</p>	<p>Контр. раб</p>
<p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> – Проведением расчетов величины портфеля, достаточной для покрытия финансовых целей – Расчетом целевой доходности в зависимости от финансовых целей и начального капитала – Анализом финансового положения клиента – Выявлением несоответствий текущего финансового состояния клиента его финансовым целям – Подборкой классов активов и финансовых продуктов в соответствии с потребностями клиента – Проведением стресс-тестов и сценарного анализа – Моделированием целевого портфеля клиента – Формированием финансового плана и критериев мониторинга его выполнения – Составлением прогноза денежного потока – Оптимизация финансового плана – Анализом использования заемных средств (кредитные продукты) 	<p>При решении стандартных задач не продемонстрированы базовые навыки, имели место грубые ошибки</p>	<p>Имеется минимальный набор навыков для решения стандартных задач с некоторыми недочетами</p>	<p>Продемонстрированы базовые навыки при решении стандартных задач с некоторыми недочетами</p>	<p>Продемонстрированы навыки при решении нестандартных задач без ошибок и недочетов</p>	<p>компетентно-ориентированные задания</p>

7.3 Контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения ОПОП ВО

Для текущего контроля по компетенции ПК-2 - способностью анализировать и использовать различные источники информации для проведения финансово-экономических расчетов;

Тесты

Тема 1 Теоретические основы фундаментального технического анализа на финансовых рынках

1 Наличие финансовых рынков, или рынков финансовых инвестиций, как одного из главных элементов инвестиционной среды является существенным признаком современных развитых экономик.

- a) да
- b) нет

2 Реальные инвестиции — это вложения денег в такие материально осязаемые активы, как земля, недвижимость, товары, оборудование, заводы и пр.

- a) да
- b) нет

3 Финансовыми инвестициями называются инвестиции в материальные активы, или любые инструменты, которые, как правило, представляют собой документы, удостоверяющие имущественные права инвестора (кредиты, депозиты, акции, облигации, производные ценные бумаги и пр.).

- a) да
- b) нет

4 К финансовым инструментам относят валюты — деньги других государств.

- a) да
- b) нет

5 Если в примитивных экономиках основная часть инвестиций представлена реальными инвестициями, то в развитых экономиках большая часть инвестиций являются финансовыми.

- a) да
- b) нет

Тема 2 Аксиомы фундаментального и технического анализа, методология технического анализа

6 Финансовые инструменты не обращаются, т.е. не продаются и не покупаются, на финансовых рынках.

- a) Верно
- b) Неверно

7 Финансовый инструмент имеет свой финансовый рынок обращения — валютный и денежный, фондовый, рынок облигаций и т.п.

- a) Верно
- b) Неверно

Тема 3. Линии тренда(Trendlines)

8 Выбрать варианты ответов: Прежде чем инвестировать средства в финансовые инструменты, будь то валюта, акции, облигации или производные ценные бумаги (фьючерсы, опционы и пр.), необходимо получить ответы на следующие вопросы:

а) Какова ожидаемая доходность планируемых финансовых вложений?

б) Насколько велика неопределенность в получении доходов, т.е. насколько рискованны рассматриваемые инвестиции?

с) Каково влияние на финансовые рынки экономических, политических и иных факторов?

д) Являются ли изменения цен финансовых инструментов случайными или существуют закономерности, которым эти изменения подчиняются?

е) Каким образом принимать решения по выбору финансовых активов, определению моментов их приобретения и продажи, объёмов и сроков вложений?

ф) Следует ли управлять финансовыми активами, совершая операции (покупки или продажи) в зависимости от изменения рыночной конъюнктуры или стратегия «купи и держи» является оптимальной для рынков финансовых инструментов? Если управление активами обосновано, то каким образом оно должно осуществляться?

9 Предпосылками к возникновению технического анализа были....

а) наблюдения изменений цен на финансовых рынках

б) наблюдения изменений объемов на финансовых рынках

10. В теории Доу впервые были сформулированы постулаты технического анализа, которые признаются и в настоящее время:

а) индексы учитывают все;

б) рынки изменяются трендами;

с) основной тренд имеет четыре фазы;

д) индексы должны дублировать друг друга;

е) объём торговли не должен увеличиваться в направлении основного тренда;

11. Основные положения теории Доу:

а) Индексы учитывают все.

б) Рынки изменяются трендами.

12. Фаза «Накопление»-

а) Фаза накопления — период, когда на рынке уже преобладает оптимизм

б) Фаза накопления — период, когда на рынке все еще преобладает пессимизм, характерный для предшествующего длительного периода падающего, или «медвежьего», рынка.

13. Фаза «Накопление»-

а) Акции стоят дешево, но никто не хочет их покупать.

б) Акции растут

14. Фаза «Восходящий тренд»-

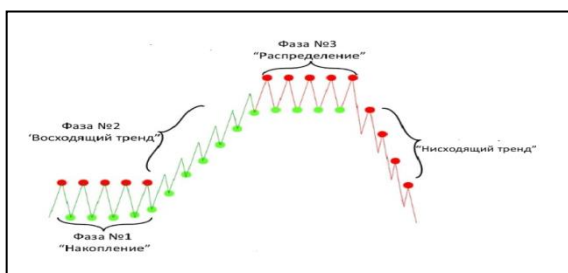
а) Это наиболее длительная фаза

б) Это наиболее короткая фаза

15. Аксиома Уолл-Стрита

- a) «рынок достигает пика, когда начинают покупать таксисты»
- b) «рынок достигает пика, когда начинают покупать домохозяйки»

16.



- a) Фазы тренда по Доу
- b) Фазы тренда по теории циклов

Контрольные задания

Тема 2 Аксиомы фундаментального и технического анализа, методология технического анализа

Варианты:

№1

1. Теория Фибоначчи.
2. Гэп и технический анализ. Стохастический осциллятор (Stochastic).
3. Фундаментальный анализ и работа с новостями на рынке ценных бумаг.

Задача.

Пересечения и дивергенции. Пересечение ADX подтверждаеттренда. Дивергенция – еще одно популярное условие у многих осцилляторов, когда направление индикатора и цены....., что свидетельствует о тренда. Продолжите описание графика



№2

1. Схождение-расхождение скользящих средних (MACD — moving average convergence/divergence)
2. Модели разворота: Двойные вершины и впадины, Голова и плечи, Алмазные формации
3. Анализ финансовой отчетности компаний и фундаментальный анализ.

Задача. Охарактеризуйте ситуацию на рынке.



№3

1. Анализ свечей
2. Теория Доу
3. Индекс потребительских цен и фундаментальный анализ.

Задача

Какую информацию о цене несет индикатор MACD?

1. *Направление тренда* – если линия или гистограмма MACD находится выше нулевой линии (она расположена посередине), то тренд....., если наоборот – Это соответствует пересечению- и-периодной ЕМА на самом графике.

2. *Сила момента* – определяется по MACD гистограмме. Ярко зеленые столбцы говорят о том, что моментум постоянно....., то есть покупателисвои позиции. Как только появляется столбец немножко меньший, чем предыдущий, то он окрашивается вцвет и говорит, что моментум, а с ней и покупательная способность быков,..... То же верно длястолбцов.

Торговые сигналы от индикатора MACD

1. *По пересечению нулевой линии.* Когда скользящие средние перекрещиваются между собой и направляются вверх, то это соответствует переходустолбцов вчерезлинию. Такой сигнал соответствует..... Если наоборот –..... Этот тип сигналов от индикатора MACD появляется немножко быстрее, чем от пересечения- и-периодной ЕМА на самом графике. Но все равно достаточно существенно, что вы можете сами увидеть на примере:



№4

1. Анализ трендов: Поддержка и сопротивление тренда. Линия канала
2. Графические модели: Модели продолжения тенденции (Треугольники, Флаги и вымпелы, Клинья)
3. Валовой внутренний продукт (ВВП) и фундаментальный анализ.

Тема 3. Линии тренда (Trendlines)

Задача

Сигнал на покупку:



1) Зеленая линия GOILER находится над белой, что говорит(росте/падении) прогнозе индикатора.2) Когда белая линия была пересечена снизу вверх, происходит вход в позицию на(покупку/продажу). При установке стоп приказа мы рассматривали два варианта, а именно перенос стопа на уровень желтой линии или красной. Если выбран ориентир для стопа на уровне красной линии, то профит должен находится у Если вы выбрали ориентир для стоп приказа у желтой

линии, то профит должен быть на уровнелинии.

Сигнал на продажу:



1) Зеленая линия GOILER находится под белой, что говорит опрогнозе индикатора.

2) Когда белая линия была пересечена сверху вниз, происходит вход в позицию на.....

Как и с покупками, мы устанавливаем наш стоп приказ либо у красной, либо у желтой линии. Следовательно, если установили стоп у красной линии, профит должен находиться у..... , а если установили стоп у желтой линии, то профит должен находиться у линии.

Опишите динамику тренда.

Для текущего контроля по компетенции ПК-4 - способностью провести анализ и дать оценку существующих финансово-экономических рисков, составить и обосновать прогноз динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро- и мезо-уровне;

Темы рефератов

Тема 3. Линии тренда (Trendlines)

1. Перспективы развития рынка экзотических финансовых производных инструментов в России
2. Основные положения Модели Марковица. Определения структуры и местоположения эффективного множества финансовых активов.
3. Основные положения Модели Шарпа, взаимосвязь уровня риска доходности.
4. Основные положения Модели Миллера-Модельяни оптимизация структуры капитала корпорации.
5. Основные положения Модели Блека-Скоулза, методы ценообразования на производные финансовые инструменты.
6. Основные положения количественной теории денег.

Тема 4 Программное обеспечение технического анализа.

1. Системы принятия решений (системы биржевой игры): основные принципы построения и оптимизации
2. Понятие фундаментального анализа. Этапы фундаментального анализа.
3. Характеристика основных осцилляторов: Индикатора темпа движения цен
4. (Momentum), Индикатора скорости изменения цены (PriceRateofChange),
5. R Ларри Уильямса, Индекса относительной силы (RelativeStrengthIndex).
6. Индикаторы объема: Индикатор сбалансированного объема (On-BalanceVolume).
7. Индикатор накопления/распределения (Accumulation/Distribution)
8. Правила применения осцилляторов при исследовании без трендовых рынков.
9. Приведите структурирование взносов участников биржевых торгов с опционами и фьючерсами.
10. Биномиальная модель цены опциона. Построение формул, факторы-аргументы, учитываемые в формулах. Условия применения модели

Тесты

Тема 4 Программное обеспечение технического анализа.

1. Индекс CPI (ConsumerPriceIndex) - является одним из основных индикаторов.....
 - a. Инфляции
 - b. Рынка ценных бумаг
 - c. Денежного обращения
2. Индекс потребительских цен (ConsumerPriceIndex) рассчитывается на основе выбранной корзины товаров и услуг
 - на основе изменение цен
 - на основе валютной корзины
3. CPI публикуется.....
 - a. ежемесячно, обычно в десятый рабочий день месяца

b.ежемесячно

c. ежедневно

4. Отклонения CPI на ... от ожидавшегося значения бывает достаточно, чтобы вызвать заметную реакцию валютного рынка.

a. 0,1

b. 0,2

5. PPI индекс (Индекс цен производителей)-.....

a. является одним из основных индикаторов рынка капитала

b. фундаментальный показатель, отслеживающий изменения в ценах, по которым продают свои товары национальные производители на оптовом уровне реализации

c. цен иностранных производителей

6. Типичные свойства PPI в экономическом цикле:

a. менее волатилен, чем CPI (food&energy составляют в нем около 36%, а в CPI примерно 23%);

b. не имеет собственный цикл, запаздывающий относительно общего экономического

c. цикла, аналогичный циклу CPI;

d. пиковые значения PPI (выраженного в процентах годовых) обычно запаздывают на 3 - 6 месяцев от общих пиков экономической активности, а минимумы его запаздывают от минимумов экономической активности

на 9 месяцев;

e. чаще всего, экстремумы PPI и CPI достигаются в одном квартале

7. По мере того, как валюта продолжает торговаться в диапазоне, модель....., формируя полный треугольник.

a. расширяется

b. сужается

c. соединяется

8. Существует три основных типа треугольников:

a. симметричные, восходящие и нисходящие

b. равносторонние

c. равнобедренные

9. Восходящие треугольники могут быть опознаны по плоской верхней линии и нижней линии восходящего тренда, касающейся все более..... минимумов.

a. Низких

b. Высоких

c. Высоких и низких

Восходящие треугольники сигнализируют о прорыве всторону.

d. Верхнюю

- e. Низкую
 - f. Боковую
10. В случае симметричного треугольника при существующем восходящем тренде, идеальной точкой входа была быверхней трендовой линии, чтобы поймать, последующее после прорыва, движение вверх.
- a. Высшая плоскость
 - b. Низшая плоскость
- c. Граница
11. Принцип торговли на Скользящих средних заключается:
- a. В прогнозировании решения делать покупку или продажу
 - b. Страхования риска
12. Сила отрицания. Простое правило, лежащее в основе понимания силы отрицания: если рынок не пошел в направлении, которое прогнозируется из вычисления силы света и силы тени, то он обязательно пойдет в противоположном.
- a) Верно
 - b) Неверно
13. Осциллятор скорости рынка является опережающим индикатором — он перестает расти (падать), когда цены все еще растут при повышательной тенденции (падают при понижательной), и меняет свое направление, когда тенденция начинает замедляться.
- a) Верно
 - b) Неверно
14. Формула осциллятора скорости рынка выглядит следующим образом: $M = C - C_n$ где C — последняя цена закрытия; C_n — цена закрытия n временных периодов тому назад.
- a) Верно
 - b) Неверно
15. Поскольку осциллятор скорости рынка графически иллюстрирует приращение цены за несколько торговых периодов, то что если в течение определенного времени значение осциллятора скорости рынка является положительным, то в это время рыночная цена понижается и на рынке наблюдается снижающийся тренд
- a) Верно
 - b) Неверно
16. В случае, когда осциллятор принимает то положительные, то отрицательные значения, постоянно меняя свой знак, для рынка характерен «боковой» тренд, т.е. бестрендовое состояние.
- a) Верно
 - b) Неверно

Компетентностно-ориентированные задания
Тема 2 Аксиомы фундаментального и технического анализа,
методология
технического анализа

Задание № 1: Анализ линии тренда в среднесрочном периоде при условии изменения инвестиционной тактики

Постановка задачи: Представлен график по которому необходимо определить поведение трейдера:

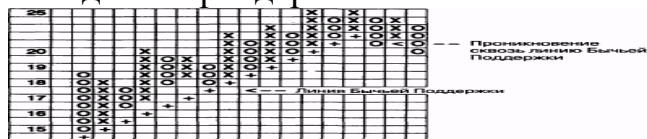


Рисунок 1-Линия Бычьей Поддержки Задание:

1. Определите динамику роста или падения акций при закрытии, если закрытие происходит близко к линии БычьейПоддержки.
2. Если акция значительно поднимается над своим трендом и дает больше сигналов к покупке можно ли идти к самому нижнему "О" этой новой точки перераспределения сил.

Задание № 2:

Для чего необходимы Линии краткосрочного тренда трейдеру?

Линия БычьегоСопротивления

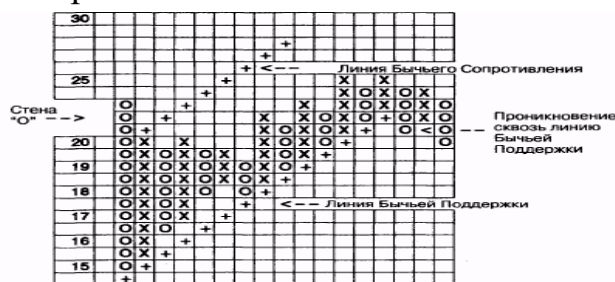


Рисунок 2- Линия Бычьего Сопротивления

Задание:

1. Определите в каком диапазоне акция поддерживала тренд на путинаверх.
2. Проанализируйте ситуацию на рынке

Задание № 3:

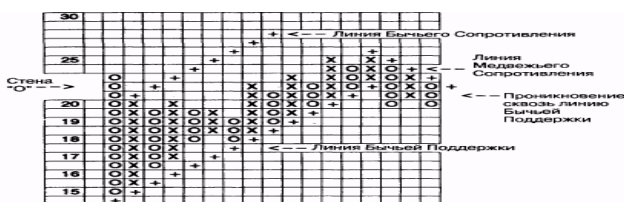


Рисунок 3-Линия Медвежьего Сопротивления Задание:

- 1 Проанализируйте ситуацию нарынке
- 2 Если акция медвежья и она дает сигнал к продаже и находится под линией Медвжьего Сопротивления, следует ли использовать сигнал к покупке, исходящими из под линии сопротивления.

Вопросы и задания для проведения промежуточного контроля (зачета)

Компетенция: ПК-2 - способностью анализировать и использовать различные источники информации для проведения финансово-экономических расчетов

Вопросы к зачету

1. «Сделки на разность»
2. Принципы ценообразования во фьючерсной торговле.
3. Принципы ценообразования в торговле опционами.
4. Правила определения величины первоначальной маржи во фьючерсной торговле.
5. Международный опыт торговли «погодными» производными.
6. Перспективы организации торговли «погодными» производными на российских срочных биржах.
7. Система гарантирования сделок на фьючерсной бирже.
8. Перспективы развития рынка экзотических финансовых производных инструментов в России.
9. Определение границ цены американских и европейских опционов на акции.
10. Определение границ цены американских и европейских опционов
11. Использование фьючерсов для увеличения доходности инвестиций.
12. Арбитражные сделки при торговле фьючерсами на фондовый индекс.
13. Принцип паритета европейских и американских опционов на покупку и на продажу.
14. Возможности использования многофакторных опционов.
15. Подходы к оценке стоимости нестандартных опционов.
16. Инструменты и технологии рынка FORTS .
17. Инструменты и технологии срочного рынка ММВБ.
18. Подходы к использованию опционов и фьючерсов при формировании консервативного инвестиционного портфеля.
19. Основные положения Модели Марковица. Определения структуры и местоположения эффективного множества финансовых активов.
20. Основные положения Модели Шарпа, взаимосвязь уровня риска и доходности.
21. Основные положения Модели Миллера-Модельяни, оптимизация структуры капитала корпорации.
22. Основные положения Модели Блека-Скоулза, методы ценообразования на производные финансовые инструменты.
23. Индикаторы объема: Индикатор сбалансированного объема (On-BalanceVolume).
Индикатор накопления/распределения (Accumulation/Distribution)
24. Правила применения осцилляторов при исследовании бестрендовых рынков.
25. Индекс расширения диапазона (REI), индикатор Де Марка

26. Системы принятия решений (системы биржевой игры): основные принципы построения и оптимизации
Практические задания для зачета

№1

1. Популярные индикаторы: Accumulation/Distribution (A/D), Average Directional Index (ADX), Aroon, MACD, RSI
2. Анализ бинарных опционы.
3. Валютный курс по паритету покупательной способности в фундаментальном анализе
Задача. Опишите ситуацию на рынке (графики).



Рисунок 1- Уровни Фибоначчи на графике цены акций компании "Яндекс Н.В."



Рисунок 2- Скользящие средние на графике цены акций компании "Яндекс Н.В."



Рисунок 3- Уровни сопротивления и поддержки на графике цены акций

компании "Яндекс Н.В."

№2

Графический анализ с использованием чисел Фибоначчи, Уровни коррекции Фибоначчи, Веер Фибоначчи (Fans) Канал Фибоначчи (FibonacciChannel), Дуги Фибоначчи

1. Графики Крестики-нолики (PointandFigurecharts), Графики Ренко (RenkoCharts) Графики Каги (KagiCharts), Графики линейного прорыва (LineBreakCharts)

2. Уровень реальных процентных ставок в фундаментальном анализе.

Задача.



Таким образом, технические индикаторы указывают на....., Вывод: акции подошли к уровню сопротивления....., от этого уровня возможно техническая В дальнейшем –..... Прогноз: краткосрочно –.....; среднесрочно –..... Точками входа являются уровни –.....,, руб.

Компетенция: ПК-4 Способностью осуществлять сбор, обработку, анализ и систематизацию информации по теме исследования, выбор методов и средств решения задач исследования

Вопросы к зачету

1. . Регулирование срочной биржевой деятельности в Великобритании.
2. Общее и особенное в организации торговли на Лондонской международной финансовой фьючерсной и опционной бирже (LIFFE).
3. Общее и особенное в организации торговли производными инструментами на Токийской фондовой бирже (TSE).
4. Общее и особенное в организации торговли на Немецкой срочной

- бирже (ДТВ).
5. Принципы выбора элементарных и комбинированных стратегий при торговле опционами.
 6. Применение коэффициентов чувствительности цены опционов (букв «греческого алфавита») при торговле опционами.
 7. Формирование опционной позиции с заданными величинами коэффициентов чувствительности цены.
 8. Определение границ цены американских и европейских опционов на акции.
 9. Определение границ цены американских и европейских опционов
 10. Использование фьючерсов для увеличения доходности инвестиций.
 11. Арбитражные сделки при торговле фьючерсами на фондовый индекс.
 12. Принцип паритета европейских и американских опционов на покупку и на продажу.
 13. Возможности использования многофакторных опционов.
 14. Подходы к оценке стоимости нестандартных опционов.
 15. Инструменты и технологии рынка FORTS .
 16. Инструменты и технологии срочного рынка ММВБ.
 17. Подходы к использованию опционов и фьючерсов при формировании консервативного инвестиционного портфеля.
 18. Подходы к использованию опционов и фьючерсов при формировании агрессивного инвестиционного портфеля.
 19. Деньги и процентные ставки. Процентные ставки финансовых рынков. Процентные ставки центральных банков.
 20. Основные положения количественной теории денег. Процентный дифференциал и денежный мультипликатор.
 21. Экономический цикл. Показатели роста экономики, валовой внутреннего продукта.
 22. Глобальный анализ национальной экономики.
 23. Операционно-стоимостной анализ корпораций и выбор инструментов инвестирования.
 24. Методологические основы инвестиционного проектирования: вариационный цикл разработки инвестиционного проекта (реальные и финансовые инвестиции (IRR, NPV, EVA).
 25. Методологические приемы оценки инвестиционного цикла и инвестиционного анализа на финансовом рынке.
 26. Основные положения Модели Марковица. Определения структуры и местоположения эффективного множества финансовых активов.
 27. Основные положения Модели Шарпа, взаимосвязь уровня риска и доходности.
 28. Основные положения Модели Миллера-Модельяни, оптимизация структуры капитала корпорации.
 29. Основные положения Модели Блека-Скоулза, методы ценообразования на производные финансовые инструменты.
 30. Разработка стратегии роста и стратегии повышения стоимости финансовых активов.

31. Первичные и второстепенные индикаторы рынка.
32. Инструменты анализа рынка: трендовые индикаторы; индикаторы волатильности: индикаторы интенсивности тенденции; открытые позиции; индикатор относительной силы (RSI).
33. Определения крупных ценовых колебаний и идентификации ключевых факторов ценообразования.
34. Построение моделей поведения цен.
35. Аксиомы технического анализа.
36. Основные виды ценовых графиков.
37. Характеристика основных осцилляторов: Индикатора темпа движения цен (Momentum), Индикатора скорости изменения цены (Price Rate of Change), %R Ларри Уильямса, Индекса относительной силы (Relative Strength Index).
38. Индикаторы объема: Индикатор сбалансированного объема (On-Balance Volume). Индикатор накопления/распределения (Accumulation/Distribution)
39. Правила применения осцилляторов при исследовании бестрендовых рынков.
40. Индекс расширения диапазона (REI), индикатор Де Марка
41. Системы принятия решений (системы биржевой игры): основные принципы построения и оптимизации
42. Понятие фундаментального анализа. Этапы фундаментального анализа.

Практические задания для зачета

Задача. Опишите ситуацию на рынке никеля.

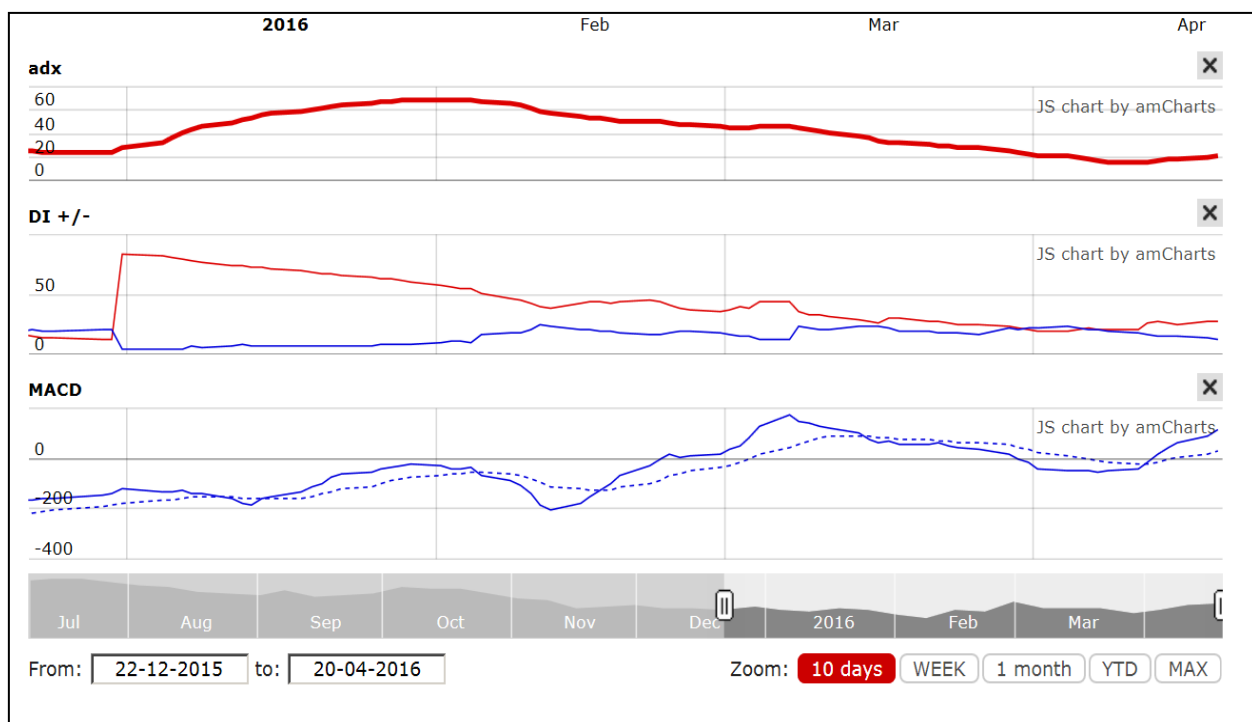


Рисунок 1- Осцилляторы технического анализа цены сырья никеля



Рисунок 2- График акций «ГМК Норникель» с полосами Болинджера

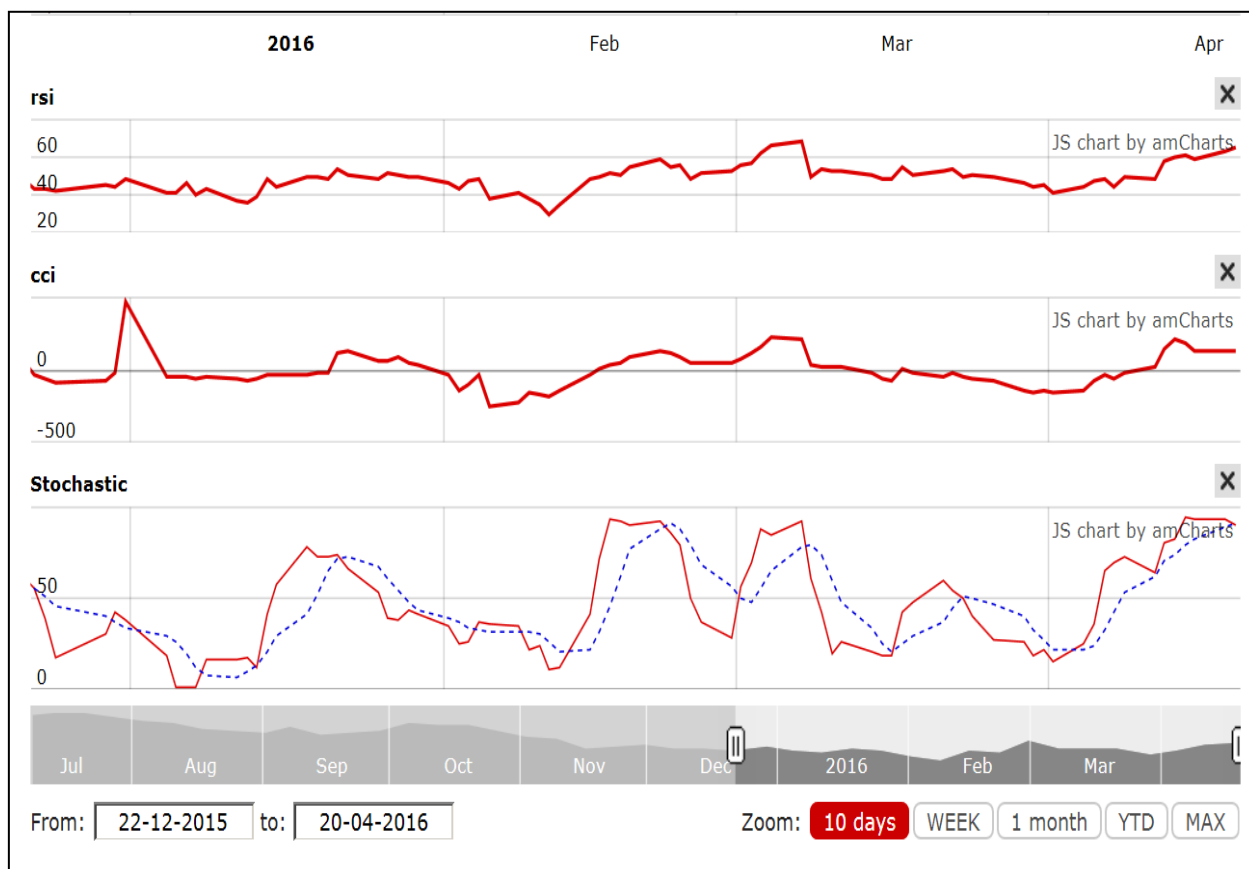


Рисунок 3- Индикаторы технического анализа цены сырья никеля

Задача. Опишите ситуацию ПАО «РусГидро»

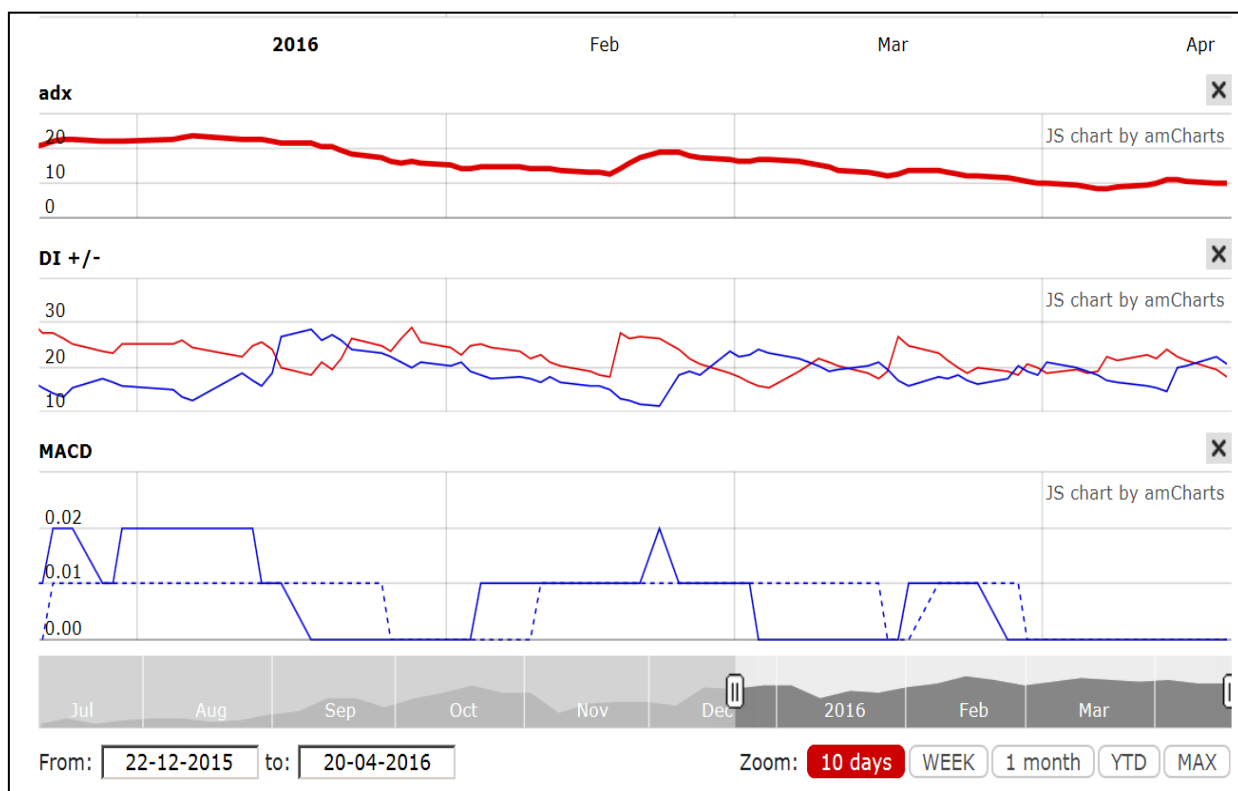


Рисунок 12- Индикаторы технического анализа акций ПАО «РусГидро» в 2016 году

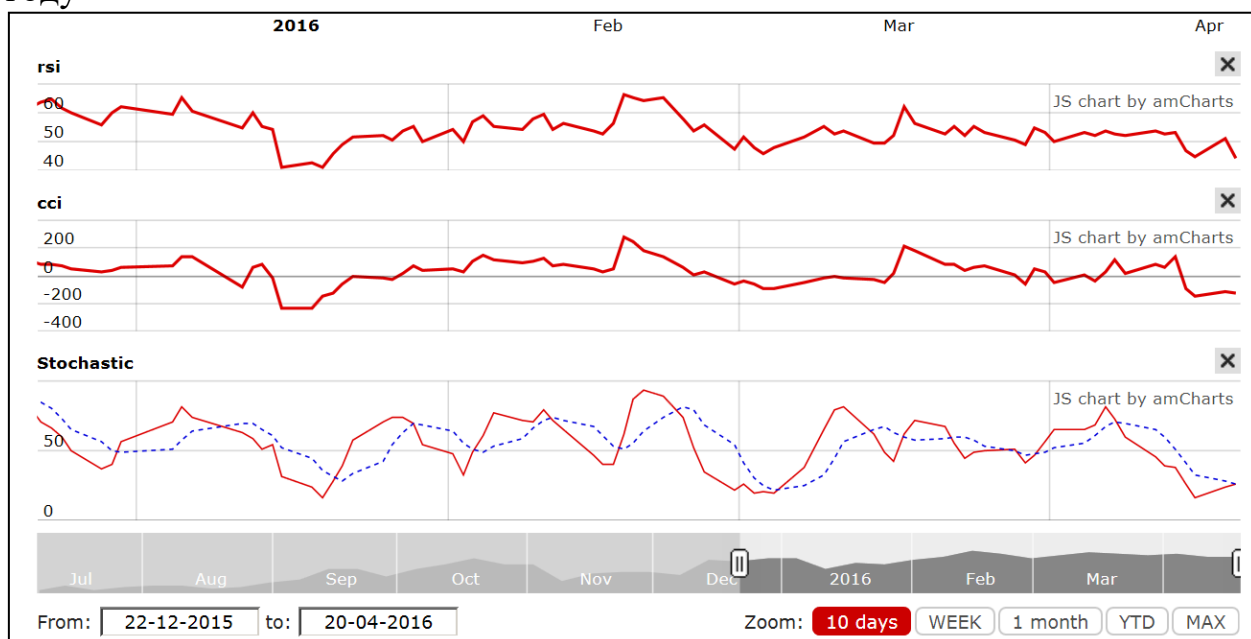


Рисунок 23- Осцилляторы технического анализа акций ПАО «РусГидро» в 2016 году



Рисунок 34- Уровни Фибоначчи на графика цены акций ПАО «РусГидро»

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

Компетентностно-ориентированные задания является одним из способов эффективного применения теории в реальной жизни через решение учебно-конкретных ситуаций. метод предусматривает письменно представленное описание определенных условий из жизни хозяйствующего субъекта, ориентирующее студентов на формулирование проблемы и поиск вариантов ее решения.

Результат выполнения задания оценивается с учетом следующих критериев:

- полнота проработки ситуации;
- полнота выполнения задания;
- новизна и неординарность представленного материала и решений;
- перспективность и универсальность решений;
- умение аргументировано обосновать выбранный вариант решения.

Критерии оценивания выполнения заданий. Если результат выполнения задания соответствует обозначенному критерию обучающемуся присваивается один балл (за каждый критерий по 1 баллу).

Критерии оценивания выполнения задания.

Оценка «отлично» – при наборе в 5 баллов.

Оценка «хорошо» – при наборе в 4 балла.

Оценка «удовлетворительно» – при наборе в 3 балла. Оценка «неудовлетворительно» – при наборе в 2 балла

Критерии оценки контрольных работ

Оценка «отлично» — выставляется обучающемуся, показавшему всесторонние, систематизированные, глубокие знания вопросов контрольной работы и умение уверенно применять их на практике при решении конкретных задач, свободное и правильное обоснование принятых решений.

Оценка «хорошо» — выставляется обучающемуся, если он твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, умеет применять полученные знания на практике, но допускает в ответе или в решении задач некоторые неточности, которые может устранить с помощью дополнительных вопросов преподавателя.

Оценка «удовлетворительно» — выставляется обучающемуся,

показавшему фрагментарный, разрозненный характер знаний, недостаточно правильные формулировки базовых понятий, нарушения логической последовательности в изложении программного материала, но при этом он владеет основными понятиями выносимых на контрольную работу тем, необходимыми для дальнейшего обучения и может применять полученные знания по образцу в стандартной ситуации.

Оценка «неудовлетворительно» — выставляется обучающемуся, который не знает большей части основного содержания выносимых на контрольную работу вопросов тем дисциплины, допускает грубые ошибки в формулировках основных понятий и не умеет использовать полученные знания при решении типовых практических задач.

Критерии оценки знаний студентов при проведении тестирования.

Тест – это инструмент оценивания уровня знаний обучающихся, состоящий из системы тестовых заданий, стандартизированной процедуры проведения, обработки и анализа результатов.

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

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

Оценка «удовлетворительно» выставляется при условии правильного ответа студента не менее 51 %;

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

Критерии оценки реферата.

Критериями оценки реферата являются: новизна текста, обоснованность выбора источников литературы, степень раскрытия сущности вопроса, соблюдения требований к оформлению.

Оценка «отлично» выполнены все требования к написанию реферата: обозначена проблема и обоснована её актуальность; сделан анализ различных точек зрения на рассматриваемую проблему и логично изложена собственная позиция; сформулированы выводы, тема раскрыта полностью, выдержан объём; соблюдены требования к внешнему оформлению.

Оценка «хорошо» основные требования к реферату выполнены, но при этом допущены недочёты. В частности, имеются неточности в изложении материала; отсутствует логическая последовательность в суждениях; не выдержан объём реферата; имеются упущения в оформлении.

Оценка «удовлетворительно» имеются существенные отступления от требований к реферированию. В частности: тема освещена лишь частично; допущены фактические ошибки в содержании реферата; отсутствуют выводы.

Оценка «неудовлетворительно» тема реферата не раскрыта, обнаруживается существенное непонимание проблемы или реферат не представлен вовсе.

Зачет - форма проверки успешного выполнения обучающемуся работ, усвоения учебного материала дисциплины в ходе занятий, самостоятельной работы. Вопросы, выносимые на зачет, доводятся до сведения магистров за месяц до сдачи зачета. Контрольные требования и задания соответствуют

требуемому уровню усвоения дисциплины и отражают ее основное содержание.

Критерии оценки знаний при проведении зачета.

Оценка «зачтено» должна соответствовать параметрам любой из положительных оценок («отлично», «хорошо», «удовлетворительно»), «незачтено» - параметрам оценки «неудовлетворительно».

Оценка «отлично» выставляется обучающемуся, который обладает всесторонними, систематизированными и глубокими знаниями материала учебной программы, умеет свободно выполнять задания, предусмотренные учебной программой, усвоил основную и ознакомился с дополнительной литературой. Оценка «хорошо» выставляется обучающемуся, обнаружившему полное знание материала учебной программы, успешно выполняющему предусмотренные учебной программой задания, усвоившему материал основной литературы, рекомендованной учебной программой.

Оценка «удовлетворительно» выставляется обучающемуся, который показал знание основного материала учебной программы в объеме, достаточном и необходимым для дальнейшей учебы и предстоящей работы, справился с выполнением заданий, предусмотренных учебной программой, знаком с основной литературой, рекомендованной учебной программой.

Оценка «неудовлетворительно» выставляется обучающемуся, не знающему основной части материала учебной программы, допускающему принципиальные ошибки в выполнении предусмотренных учебной программой заданий, неуверенно с большими затруднениями выполняющему практически работы.

8. Перечень основной и дополнительной учебной литературы

Основная учебная литература:

1. Белова, Е. В. Технический анализ финансовых рынков: / Е.В. Белова, Д.К. Окорочков; МГУ им. М.В. Ломоносова. - Москва : ИНФРА-М, 2006. - 398 с. (Учебники экон. факультета МГУ им. М.В. Ломоносова). ISBN 5-16-002034-9. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/110932>

2. Джек, Швагер Технический анализ : полный курс / Швагер Джек ; перевод А. Куницын, Б. Зуев ; под редакцией А. Дзюры. — 13-е изд. — Москва : Альпина Паблишер, 2020. — 808 с. — ISBN 978-5-9614-6342-2. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/93060.html>

3. Михайлов, А. Ю. Технический анализ и трейдинг на финансовом рынке : / А.Ю. Михайлов. — Москва : ИНФРА-М, 2020. — 101 с. — (Высшее образование: Магистратура). — DOI 10.12737/996461. - ISBN 978-5-16-014669-0. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/996461>
<https://znanium.com/read?id=352574>

4. Элдер, Александр Самый сильный сигнал в техническом анализе: Расхождения и развороты трендов [Электронный ресурс] / Александр Элдер ; пер. Е. Калугин. — Электрон. текстовые данные. — М. : Альпина Паблишер, 2019. — 96 с. — 978-5-9614-2254-2. — Режим доступа:

<http://www.iprbookshop.ru/82480.html>

Дополнительная учебная литература:

1. Джон, Мэрфи Межрыночный анализ: принципы взаимодействия финансовых рынков / Мэрфи Джон ; под редакцией В. Ионова. — Москва : Альпина Паблишер, 2020. — 304 с. — ISBN 978-5-9614-1707-4. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/93039.html>

2. Островский, Г. М. Технические системы в условиях неопределенности. Анализ гибкости и оптимизация : учебное пособие / Г. М. Островский, Ю. М. Волин. — 4-е изд. — Москва : Лаборатория знаний, 2020. — 320 с. — ISBN 978-5-00101-811-7. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/6510.html>

3. Технический анализ: курс для начинающих / перевод Д. Глоба. — 4-е изд. — Москва : Альпина Паблишер, 2020. — 192 с. — ISBN 978-5-9614-4801-6. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/96857.html>

4. Швагер, Д. Д. Технический анализ: Полный курс: Справочное пособие / Швагер Д.Д. - М.: Альпина Паблишер, 2017. - 804 с.: ISBN 978-5-9614-6342-2. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1003105>

Цибулькинова, В. Ю. Фундаментальный анализ рынка ценных бумаг : учебное пособие / В. Ю. Цибулькинова. — Томск : Томский государственный университет систем управления и радиоэлектроники, Эль Контент, 2013. — 226 с. — ISBN 978-5-4332-0097-5. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/72215.html>

9. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

Перечень ЭБС

№	Наименование	Тематика	Ссылка
1	Znanium.com	Универсальная	https://znanium.com/
2	IPRbook	Универсальная	http://www.iprbookshop.ru/
3	Образовательный портал КубГАУ	Универсальная	https://edu.kubsau.ru/

11. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

1. Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках: метод. рекомендации / сост. А.Ю. Аджиева, И.А. Дикарева— Краснодар : КубГАУ, 2020. — 57 с. — Режим доступа:

https://edu.kubsau.ru/file.php/121/FTA_praktika_571090_v1_PDF

2. Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках: метод. рекомендации / сост. А.Ю. Аджиева, И.А. Дикарева— Краснодар : КубГАУ,

11 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем

Информационные технологии, используемые при осуществлении образовательного процесса по дисциплине позволяют: обеспечить взаимодействие между участниками образовательного процесса, в том числе синхронное и (или) асинхронное взаимодействие посредством сети "Интернет"; фиксировать ход образовательного процесса, результатов промежуточной аттестации по дисциплине и результатов освоения образовательной программы; организовать процесс образования путем визуализации изучаемой информации посредством использования презентационных технологий; контролировать результаты обучения на основе компьютерного тестирования.

11.1 Перечень лицензионного программного обеспечения

Наименование	Краткое описание
Microsoft Windows	Операционная система
Microsoft Office (включает Word, Excel, PowerPoint)	Пакет офисных приложений
Система тестирования INDIGO	Тестирование

11.2 Перечень профессиональных баз данных и информационных справочных систем

№	Наименование	Тематика	Электронный адрес
1	Научная электронная библиотека eLibrary	Универсальная	https://elibrary.ru/
2	КонсультантПлюс	Правовая	https://www.consultant.ru/

11.3 Доступ к сети Интернет

Доступ к сети Интернет, доступ в электронную информационно-образовательную среду университета.

12 Материально-техническое обеспечение для обучения по дисциплине

Входная группа в главный учебный корпус и корпус зооинженерного факультета оборудован пандусом, кнопкой вызова, тактильными табличками, опорными поручнями, предупреждающими знаками, доступным расширенным входом, в корпусе есть специально оборудованная санитарная комната. Для перемещения инвалидов и ЛОВЗ в помещении имеется передвижной гусеничный ступенькоход. Корпуса оснащены противопожарной звуковой и визуальной сигнализацией.

Планируемые помещения для проведения всех видов учебной деятельности

№ п/п	Наименование учебных предметов, курсов, дисциплин (модулей), практики, иных видов учебной деятельности, предусмотренных учебным планом образовательной программы	Наименование помещений для проведения всех видов учебной деятельности, предусмотренной учебным планом, в том числе помещения для самостоятельной работы, с указанием перечня основного оборудования, учебно-наглядных пособий и используемого программного обеспечения	Адрес (местоположение) помещений для проведения всех видов учебной деятельности, предусмотренной учебным планом (в случае реализации образовательной программы в сетевой форме дополнительно указывается наименование организации, с которой заключен договор)
1	2	3	4
1	Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках	<p>Помещение №221 ГУК, площадь — 101 м²; посадочных мест 95, учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, в том числе для обучающихся с инвалидностью и ОВЗ</p> <p>специализированная мебель (учебная доска, учебная мебель) , в том числе для обучающихся с инвалидностью и ОВЗ; технические средства обучения, наборы демонстрационного оборудования и учебно-наглядных пособий (ноутбук, проектор, экран), в том числе для обучающихся с инвалидностью и ОВЗ, помещение для самостоятельной работы</p>	350044, г. Краснодар, ул. им. Калинина, 13
2	Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках	<p>Помещение №114 ЗОО, посадочных мест — 25; площадь — 43м²; учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, в том числе для обучающихся с инвалидностью и ОВЗ</p> <p>специализированная мебель(учебная доска, учебная мебель), в том числе для обучающихся с инвалидностью и ОВЗ,помещение для самостоятельной работы</p>	350044, г. Краснодар, ул. им. Калинина, 13

13. Особенности организации обучения лиц с ОВЗ и инвалидов

Для инвалидов и лиц с ОВЗ может изменяться объём дисциплины (модуля) в часах, выделенных на контактную работу обучающегося с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающегося (при этом не увеличивается количество зачётных единиц, выделенных на освоение

дисциплины).

Фонды оценочных средств адаптируются к ограничениям здоровья и восприятия информации обучающимися.

Основные формы представления оценочных средств – в печатной форме или в форме электронного документа

Формы контроля и оценки результатов обучения инвалидов и лиц с ОВЗ

Категории студентов с ОВЗ и инвалидностью	Форма контроля и оценки результатов обучения
<i>С нарушением зрения</i>	– устная проверка: дискуссии, тренинги, круглые столы, собеседования, устные коллоквиумы и др.; – с использованием компьютера и специального ПО: работа с электронными образовательными ресурсами, тестирование, рефераты, курсовые проекты, дистанционные формы, если позволяет острота зрения - графические работы и др.; при возможности письменная проверка с использованием рельефно-точечной системы Брайля, увеличенного шрифта, использование специальных технических средств (тифлотехнических средств): контрольные, графические работы, тестирование, домашние задания, эссе, отчеты и др.
<i>С нарушением слуха</i>	– письменная проверка: контрольные, графические работы, тестирование, домашние задания, эссе, письменные коллоквиумы, отчеты и др.; – с использованием компьютера: работа с электронными образовательными ресурсами, тестирование, рефераты, курсовые проекты, графические работы, дистанционные формы и др.; при возможности устная проверка с использованием специальных технических средств (аудиосредств, средств коммуникации, звукоусиливающей аппаратуры и др.): дискуссии, тренинги, круглые столы, собеседования, устные коллоквиумы и др.
<i>С нарушением опорно-двигательного аппарата</i>	– письменная проверка с использованием специальных технических средств (альтернативных средств ввода, управления компьютером и др.): контрольные, графические работы, тестирование, домашние задания, эссе, письменные коллоквиумы, отчеты и др.; – устная проверка, с использованием специальных технических средств (средств коммуникаций): дискуссии, тренинги, круглые столы, собеседования, устные коллоквиумы и др.; с использованием компьютера и специального ПО (альтернативных средств ввода и управления компьютером и др.): работа с электронными образовательными ресурсами, тестирование, рефераты, курсовые проекты, графические работы, дистанционные формы предпочтительнее обучающимся, ограниченным в передвижении и др.

Адаптация процедуры проведения промежуточной аттестации для инвалидов и лиц с ОВЗ:

В ходе проведения промежуточной аттестации предусмотрено:

– предъявление обучающимся печатных и (или) электронных материалов в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья;

- возможность пользоваться индивидуальными устройствами и средствами, позволяющими адаптировать материалы, осуществлять приём и передачу информации с учетом их индивидуальных особенностей;
- увеличение продолжительности проведения аттестации;
- возможность присутствия ассистента и оказания им необходимой помощи (занять рабочее место, передвигаться, прочесть и оформить задание, общаться с преподавателем).

Формы промежуточной аттестации для инвалидов и лиц с ОВЗ должны учитывать индивидуальные и психофизические особенности обучающегося/обучающихся по АОПОП ВО (устно, письменно на бумаге, письменно на компьютере, в форме тестирования и т.п.).

Специальные условия, обеспечиваемые в процессе преподавания дисциплины

Студенты с нарушениями зрения

- предоставление образовательного контента в текстовом электронном формате, позволяющем переводить плоскочечатную информацию в аудиальную или тактильную форму;
- возможность использовать индивидуальные устройства и средства, позволяющие адаптировать материалы, осуществлять приём и передачу информации с учетом индивидуальных особенностей и состояния здоровья студента;
- предоставление возможности предкурсового ознакомления с содержанием учебной дисциплины и материалом по курсу за счёт размещения информации на корпоративном образовательном портале;
- использование чёткого и увеличенного по размеру шрифта и графических объектов в мультимедийных презентациях;
- использование инструментов «лупа», «прожектор» при работе с интерактивной доской;
- озвучивание визуальной информации, представленной обучающимся в ходе занятий;
- обеспечение раздаточным материалом, дублирующим информацию, выводимую на экран;
- наличие подписей и описания у всех используемых в процессе обучения рисунков и иных графических объектов, что даёт возможность перевести письменный текст в аудиальный,
- обеспечение особого речевого режима преподавания: лекции читаются громко, разборчиво, отчётливо, с паузами между смысловыми блоками информации, обеспечивается интонирование, повторение, акцентирование, профилактика рассеивания внимания;
- минимизация внешнего шума и обеспечение спокойной аудиальной обстановки;
- возможность вести запись учебной информации студентами в удобной для них форме (аудиально, аудиовизуально, на ноутбуке, в виде пометок в заранее подготовленном тексте);
- увеличение доли методов социальной стимуляции (обращение

внимания, апелляция к ограничениям по времени, контактные виды работ, групповые задания и др.) на практических и лабораторных занятиях;

- минимизирование заданий, требующих активного использования зрительной памяти и зрительного внимания;
- применение поэтапной системы контроля, более частый контроль выполнения заданий для самостоятельной работы.

Студенты с нарушениями опорно-двигательного аппарата (маломобильные студенты, студенты, имеющие трудности передвижения и патологию верхних конечностей)

- возможность использовать специальное программное обеспечение и специальное оборудование и позволяющее компенсировать двигательное нарушение (коляски, ходунки, трости и др.);
- предоставление возможности предкурсового ознакомления с содержанием учебной дисциплины и материалом по курсу за счёт размещения информации на корпоративном образовательном портале;
- применение дополнительных средств активизации процессов запоминания и повторения;
- опора на определенные и точные понятия;
- использование для иллюстрации конкретных примеров;
- применение вопросов для мониторинга понимания;
- разделение изучаемого материала на небольшие логические блоки;
- увеличение доли конкретного материала и соблюдение принципа от простого к сложному при объяснении материала;
- наличие чёткой системы и алгоритма организации самостоятельных работ и проверки заданий с обязательной корректировкой и комментариями;
- увеличение доли методов социальной стимуляции (обращение внимания, апелляция к ограничениям по времени, контактные виды работ, групповые задания др.);
- обеспечение беспрепятственного доступа в помещения, а также пребывания них;
- наличие возможности использовать индивидуальные устройства и средства, позволяющие обеспечить реализацию эргономических принципов и комфортное пребывание на месте в течение всего периода учёбы (подставки, специальные подушки и др.).

Студенты с нарушениями слуха (глухие, слабослышащие, позднооглохшие)

- предоставление образовательного контента в текстовом электронном формате, позволяющем переводить аудиальную форму лекции в плоскочечатную информацию;
- наличие возможности использовать индивидуальные звукоусиливающие устройства и сурдотехнические средства, позволяющие осуществлять приём и передачу информации; осуществлять взаимобратный перевод текстовых и аудиофайлов (блокнот для речевого ввода), а также запись и воспроизведение зрительной информации.
- наличие системы заданий, обеспечивающих систематизацию вербального материала, его схематизацию, перевод в таблицы, схемы, опорные

тексты, глоссарий;

- наличие наглядного сопровождения изучаемого материала (структурно-логические схемы, таблицы, графики, концентрирующие и обобщающие информацию, опорные конспекты, раздаточный материал);

- наличие чёткой системы и алгоритма организации самостоятельных работ и проверки заданий с обязательной корректировкой и комментариями;

- обеспечение практики опережающего чтения, когда студенты заранее знакомятся с материалом и выделяют незнакомые и непонятные слова и фрагменты;

- особый речевой режим работы (отказ от длинных фраз и сложных предложений, хорошая артикуляция; четкость изложения, отсутствие лишних слов; повторение фраз без изменения слов и порядка их следования; обеспечение зрительного контакта во время говорения и чуть более медленного темпа речи, использование естественных жестов и мимики);

- чёткое соблюдение алгоритма занятия и заданий для самостоятельной работы (называние темы, постановка цели, сообщение и запись плана, выделение основных понятий и методов их изучения, указание видов деятельности студентов и способов проверки усвоения материала, словарная работа);

- соблюдение требований к предъявляемым учебным текстам (разбивка текста на части; выделение опорных смысловых пунктов; использование наглядных средств);

- минимизация внешних шумов;

- предоставление возможности соотносить вербальный и графический материал; комплексное использование письменных и устных средств коммуникации при работе в группе;

- сочетание на занятиях всех видов речевой деятельности

(говорения, слушания, чтения, письма, зрительного восприятия с лица говорящего).

Студенты с прочими видами нарушений

(ДЦП с нарушениями речи, заболевания эндокринной, центральной нервной и сердечно-сосудистой систем, онкологические заболевания)

- наличие возможности использовать индивидуальные устройства и средства, позволяющие осуществлять приём и передачу информации;

- наличие системы заданий, обеспечивающих систематизацию вербального материала, его схематизацию, перевод в таблицы, схемы, опорные тексты, глоссарий;

- наличие наглядного сопровождения изучаемого материала;

- наличие чёткой системы и алгоритма организации самостоятельных работ и проверки заданий с обязательной корректировкой и комментариями;

- обеспечение практики опережающего чтения, когда студенты заранее знакомятся с материалом и выделяют незнакомые и непонятные слова и фрагменты;

- предоставление возможности соотносить вербальный и графический материал; комплексное использование письменных и устных средств коммуникации при работе в группе;
- сочетание на занятиях всех видов речевой деятельности (говорения, слушания, чтения, письма, зрительного восприятия с лица говорящего);
- предоставление образовательного контента в текстовом электронном формате;
- предоставление возможности предкурсового ознакомления с содержанием учебной дисциплины и материалом по курсу за счёт размещения информации на корпоративном образовательном портале;
- возможность вести запись учебной информации студентами в удобной для них форме (аудиально, аудиовизуально, в виде пометок в заранее подготовленном тексте).
- применение поэтапной системы контроля, более частый контроль выполнения заданий для самостоятельной работы,
- стимулирование выработки у студентов навыков самоорганизации и самоконтроля;
- наличие пауз для отдыха и смены видов деятельности по ходу занятия.