

**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«Воронежский государственный технический университет»

УТВЕРЖДАЮ

Декан факультета экономики,
менеджмента и

информационных технологий

технического факультета

С.А.Баркалов/

И.О. Фамилия

31 августа 2021г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины

«Технический анализ финансовых рынков»

Направление подготовки 38.03.01 ЭКОНОМИКА

Профиль Финансы, кредит, страхование

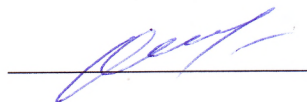
Квалификация выпускника Бакалавр

Нормативный период обучения 4 года / 5 лет / 4 года и 11 м.

Форма обучения Очная / Очно – заочная / Заочная

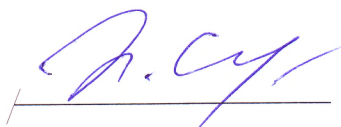
Год начала подготовки 2021

Автор программы



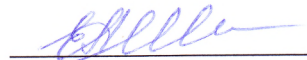
/Околелова Э.Ю./

Заведующий кафедрой
цифровой и отраслевой
экономики



/ Сироткина Н.В./

Руководитель ОПОП



/Шарапова Е.А./

Воронеж 2021

1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1. Цели дисциплины

Целью дисциплины является изучение основных механизмов функционирования финансовых рынков, обучение технике анализа и прогнозирования рыночных трендов, обучение биржевой торговле финансовыми активами на рынке ценных бумаг.

1.2. Задачи освоения дисциплины

- изучение методов биржевой торговли;
- изучение банковских торговых операций на фондовом рынке;
- анализа фондового рынка;
- построение прогнозных моделей рынка;
- изучение инструментов прогнозирования рынка;
- построение торговых стратегий.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП

Дисциплина «Технический анализ финансовых рынков» относится к дисциплинам части, формируемой участниками образовательных отношений блока Б1.

3. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Процесс изучения дисциплины «Технический анализ финансовых рынков» направлен на формирование следующих компетенций:

ПК-4 - Способен осуществлять проведение банковских операций на денежном рынке, включая рынок межбанковских кредитов и депозитов; управление средствами клиентов на денежном рынке; брокерское обслуживание клиентов на денежном рынке

ПК-5 - Способен осуществлять проведение банковских торговых операций на фондовом рынке, включая проведение операций банка по управлению торговым портфелем, а также по доверительному управлению средствами клиентов на фондовом рынке

Компетенция	Результаты обучения, характеризующие сформированность компетенции
ПК-4	Знать – виды ценных бумаг, находящихся в обращении на территории РФ и за рубежом, включая производные инструменты (деривативы), виды и особенности торговли; – механизмы валютного обращения. – законодательство Российской Федерации в области банковской деятельности и рынка ценных бумаг; – методы и инструменты технического и фундаментального анализа фондовых рынков; – виды специализированных торговых терминалов, используемых в биржевой торговле.
	Уметь – использовать производные финансовые инструменты для заключения

ПК-5	срочных контрактов; – прогнозировать динамику валютного рынка и использовать валютные свопы; – осуществлять брокерское обслуживание в соответствии с законодательством РФ; – использовать программное обеспечение и виды специализированных торговых терминалов, используемых в биржевой торговле.
	Владеть – методами технического анализа финансовых рынков; – методами заключения форвардных контрактов на покупку (продажу) валюты по фиксированному курсу на определенную дату в будущем; – инструментами технического анализа фондовых рынков; навыками работы со специализированными торговыми терминалами, используемыми в биржевой торговле.
	Знать – методы прогнозирования основных рыночных трендов; – методы оценки рисков финансовых активов; – механизмы хеджирования рисков с применением различных финансовых инструментов; – правила биржевой торговли и внебиржевого рынка ценных бумаг; – специализированные информационные системы и приложения для технического анализа и построения графиков. Уметь – применять инструменты фундаментального и технического анализа для выработки инвестиционных стратегий на фондовом и валютном рынках; – осуществлять операции купли-продажи ценных бумаг в соответствии с выбранной стратегией; – пользоваться специализированными информационными системами и приложениями для технического анализа рынка; – использовать программное обеспечение для совершения сделок. Владеть – методами разработки стратегий эффективного управления средствами клиентов на денежном рынке, включая Форекс, срочный и спотовый рынки; – методами хеджирования рисков; – навыками биржевой торговли; – навыками работы с информационными системами, приложениями для технического анализа рынков.

4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ

Общая трудоемкость дисциплины «Технический анализ финансовых рынков» составляет 5 з.е.

Распределение трудоемкости дисциплины по видам занятий
очная форма обучения

Виды учебной работы	Всего часов	Семестры
		7
Аудиторные занятия (всего)	72	72
В том числе:		
Лекции	36	36

Практические занятия (ПЗ)	36	36
Самостоятельная работа	81	81
Курсовая работа	+	+
Часы на контроль	27	27
Виды промежуточной аттестации - экзамен	+	+
Общая трудоемкость:		
академические часы	180	180
зач.ед.	5	5

очно-заочная форма обучения

Виды учебной работы	Всего часов	Семестры
		10
Аудиторные занятия (всего)	54	54
В том числе:		
Лекции	18	18
Практические занятия (ПЗ)	36	36
Самостоятельная работа	99	99
Курсовая работа	+	+
Часы на контроль	27	27
Виды промежуточной аттестации - экзамен	+	+
Общая трудоемкость:		
академические часы	180	180
зач.ед.	5	5

заочная форма обучения

Виды учебной работы	Всего часов	Семестры
		7
Аудиторные занятия (всего)	6	6
В том числе:		
Лекции	2	2
Практические занятия (ПЗ)	4	4
Самостоятельная работа	165	165
Курсовая работа	+	+
Часы на контроль	9	9
Виды промежуточной аттестации - экзамен	+	+
Общая трудоемкость:		
академические часы	180	180
зач.ед.	5	5

5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

5.1 Содержание разделов дисциплины и распределение трудоемкости по видам занятий

очная форма обучения

№ п/п	Наименование темы	Содержание раздела	Лекц	Прак зан.	СР С	Всего, час
1	Мировые рынки и	Фондовые и срочные рынки. То-	6	6	12	24

	биржи.	варные и сырьевые биржи. Ценообразование на бирже. Организация и работа биржи. Основные участники биржи. График торгов.				
2	Модели рыночного цикла. Теория Доу. Волновой принцип Эллиотта	Основные тренды. Первичный, промежуточный, краткосрочные тренды. Последовательность и разворот трендов. Уровни поддержки и сопротивления. Действительный и ложный прорыв линии поддержки (сопротивления). Основные положения теории Доу. Основные положения теории Эллиотта. Уровни Фибоначчи.	6	6	14	26
3	Численные методы технического анализа. Индикаторы рынка.	Трендовые индикаторы. Сигналы индикаторов. Индикатор МА (Moving Average). Скользящие средние. Простая, взвешенная, экспоненциальная, смещенная скользящие средние. Применение скользящих средних. Определение, подтверждение тренда. Выбор длины для скользящей средней. Ценовые фильтры. Полосы Боллинджера. Индикатор Чайкина. Индикатор накопления/распределения.	6	6	14	26
4	Численные методы технического анализа. Индикаторы и осцилляторы рынка.	Осциллятор MACD. Стохастический осциллятор (стохастик). Стратегия осциллятора стохастик и принцип работы. Торговые сигналы стохастика. Торговля с помощью осцилляторов. Расчет стохастика. Анализ работы осциллятора. Баланс объемов торгов.	6	6	14	26
5	Ценовые графики и методы их анализа.	Конвергенция и дивергенция. Торговля на дивергенциях и планирование сделки. Сетап. Ценовые фигуры. Фигуры продолжения и разворота тренда. Бары. Японские свечи. Виды свечей. Анализ графиков рынка.	6	6	14	26
6	Методы прогнозирования	Построение моделей прогноза рынка. Анализ рисков. Модели продолжения и изменения тренда. Прогноз рынка по индикаторам, осцилляторам. Прогноз по ценовым фигурам.	6	6	13	25
Контроль						27
Итого			36	36	81	180

очно-заочная форма обучения

№ п/п	Наименование темы	Содержание раздела	Лекц	Прак зан.	СР С	Всего, час
-------	-------------------	--------------------	------	-----------	------	------------

1	Мировые рынки и биржи.	Фондовые и срочные рынки. Товарные и сырьевые биржи. Ценообразование на бирже. Организация и работа биржи. Основные участники биржи. График торгов.	4	6	16	26
2	Модели рыночного цикла. Теория Доу. Волновой принцип Эллиотта	Основные тренды. Первичный, промежуточный, краткосрочные тренды. Последовательность и разворот трендов. Уровни поддержки и сопротивления. Действительный и ложный прорыв линии поддержки (сопротивления). Основные положения теории Доу. Основные положения теории Эллиотта. Уровни Фибоначчи.	4	6	16	26
3	Численные методы технического анализа. Индикаторы рынка.	Трендовые индикаторы. Сигналы индикаторов. Индикатор МА (Moving Average). Скользящие средние. Простая, взвешенная, экспоненциальная, смещенная скользящие средние. Применение скользящих средних. Определение, подтверждение тренда. Выбор длины для скользящей средней. Ценовые фильтры. Полосы Боллинджера. Индикатор Чайкина. Индикатор накопления/распределения.	4	6	16	26
4	Численные методы технического анализа. Индикаторы и осцилляторы рынка.	Осциллятор MACD. Стохастический осциллятор (стохастик). Стратегия осциллятора стохастик и принцип работы. Торговые сигналы стохастика. Торговля с помощью осцилляторов. Расчет стохастика. Анализ работы осциллятора. Баланс объемов торгов.	2	6	16	24
5	Ценовые графики и методы их анализа.	Конвергенция и дивергенция. Торговля на дивергенциях и планирование сделки. Сетап. Ценовые фигуры. Фигуры продолжения и разворота тренда. Бары. Японские свечи. Виды свечей. Анализ графиков рынка.	2	6	18	26
6	Методы прогнозирования	Построение моделей прогноза рынка. Анализ рисков. Модели продолжения и изменения тренда. Прогноз рынка по индикаторам, осцилляторам. Прогноз по ценовым фигурам.	2	6	17	25
Контроль						27
Итого			18	36	99	180

заочная форма обучения

№ п/п	Наименование темы	Содержание раздела	Лекц	Прак зан.	СР С	Всего, час
1	Мировые рынки и биржи.	Фондовые и срочные рынки. Товарные и сырьевые биржи. Ценообразование на бирже. Организация и работа биржи. Основные участники биржи. График торгов.	-	0,5	26	26,5
2	Модели рыночного цикла. Теория Доу. Волновой принцип Эллиотта	Основные тренды. Первичный, промежуточный, краткосрочные тренды. Последовательность и разворот трендов. Уровни поддержки и сопротивления. Действительный и ложный прорыв линии поддержки (сопротивления). Основные положения теории Доу. Основные положения теории Эллиотта. Уровни Фибоначчи.	0,5	0,5	28	29
3	Численные методы технического анализа. Индикаторы рынка.	Трендовые индикаторы. Сигналы индикаторов. Индикатор МА (Moving Average). Скользящие средние. Простая, взвешенная, экспоненциальная, смещенная скользящие средние. Применение скользящих средних. Определение, подтверждение тренда. Выбор длины для скользящей средней. Ценовые фильтры. Полосы Боллинджера. Индикатор Чайкина. Индикатор накопления/распределения.	0,5	0,5	28	29
4	Численные методы технического анализа. Индикаторы и осцилляторы рынка.	Осциллятор MACD. Стохастический осциллятор (стохастик). Стратегия осциллятора стохастик и принцип работы. Торговые сигналы стохастика. Торговля с помощью осцилляторов. Расчет стохастика. Анализ работы осциллятора. Баланс объемов торгов.	0,5	0,5	28	29
5	Ценовые графики и методы их анализа.	Конвергенция и дивергенция. Торговля на дивергенциях и планирование сделки. Сетап. Ценовые фигуры. Фигуры продолжения и разворота тренда. Бары. Японские свечи. Виды свечей. Анализ графиков рынка.	0,5	1	28	29,5
6	Методы прогнозирования	Построение моделей прогноза рынка. Анализ рисков. Модели продолжения и изменения тренда. Прогноз рынка по индикаторам, осцилляторам. Прогноз по ценовым фигурам.	-	1	27	28
Контроль						9
Итого			2	4	165	180

5.2 Перечень лабораторных работ

Не предусмотрено учебным планом

6. ПРИМЕРНАЯ ТЕМАТИКА КУРСОВЫХ РАБОТ

В соответствии с учебным планом освоение дисциплины предусматривает выполнение курсовой работы в 7 семестре для очной формы обучения, 10, в 7 семестре для заочной формы обучения.

1. Японские свечи. Виды свечей. Анализ графиков рынка.
2. Паттерны «японских свечей». Фигуры разворота тренда.
3. Трендовые индикаторы. Виды индикаторов. Сигналы индикаторов
4. Скользящие средние. Простая, взвешенная, экспоненциальная, смещенная скользящие средние.
5. Двойные и тройные скользящие средние. Торговые сигналы.
6. Применение скользящих средних. Определение, подтверждение тренда. Выбор длины скользящей средней.
7. Ценовые фильтры. Применение в торговле.
8. Конверты (торговые полосы). Полосы Боллинджера.
9. Дивергенция. Виды дивергенции. Классическая дивергенция
10. Классы обычных дивергенций.

Задачи, решаемые при выполнении курсовой работы:

1. Расчет финансовых показателей
2. Расчет справедливой цены опциона.
3. Определение тренда с помощью скользящих средних.

Курсовая работа включает в себя теоретическую и расчетную части.

7. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

7.1. Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

7.1.1 Этап текущего контроля

Результаты текущего контроля знаний и межсессионной аттестации оцениваются по следующей системе:

«аттестован»;

«не аттестован».

Компетенция	Результаты обучения, характеризующие сформированность компетенции	Критерии оценивания	Аттестован	Не аттестован
ПК-4	Знать – виды ценных бумаг, находящихся в обращении на территории РФ и за рубежом, включая производные инструменты (деривативы), виды и особенности торговли механизмы валютного обращения. – законодательство Российской Федерации в области банковской деятельности и рынка ценных бумаг; – методы и инструменты технического и фундаментального анализа фондовых рынков;	Студент демонстрирует необходимый объем теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах

	виды специализированных торговых терминалов, используемых в биржевой торговле. Уметь – использовать производные финансовые инструменты для заключения срочных контрактов; – прогнозировать динамику валютного рынка и использовать валютные свопы; – осуществлять брокерское обслуживание в соответствии с законодательством РФ; – использовать программное обеспечение и виды специализированных торговых терминалов, используемых в биржевой торговле. Владеть – методами технического анализа финансовых рынков; – методами заключения форвардных контрактов на покупку (продажу) валюты по фиксированному курсу на определенную дату в будущем; – инструментами технического анализа фондовых рынков; навыками работы со специализированными торговыми терминалами, используемыми в биржевой торговле.	Студент демонстрирует умение решать практические задачи на основе полученных теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Владеть – методами технического анализа финансовых рынков; – методами заключения форвардных контрактов на покупку (продажу) валюты по фиксированному курсу на определенную дату в будущем; – инструментами технического анализа фондовых рынков; навыками работы со специализированными торговыми терминалами, используемыми в биржевой торговле.	Студент владеет навыками применения полученных теоретических и практических знаний при решении задач прикладного характера.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
ПК-5	Знать – методы прогнозирования основных рыночных трендов; – методы оценки рисков финансовых активов; – механизмы хеджирования рисков с применением различных финансовых инструментов; – правила биржевой торговли и внебиржевого рынка ценных бумаг; – специализированные информационные системы и приложения для технического анализа и построения графиков. Уметь – применять инструменты фундаментального и технического анализа для выработки инвестиционных стратегий на фондовом и валютном рынках; – осуществлять операции купли-продажи ценных бумаг в соответствии с выбранной стратегией; – пользоваться специализированными информационными системами и приложениями для технического анализа рынка; – использовать программное обеспечение для совершения сделок. Владеть – методами разработки стратегий эффективного управления средствами клиентов на денежном рынке, включая Форекс, срочный и спотовый рынки; – методами хеджирования рисков; – навыками биржевой торговли; – навыками работы с информационными системами, приложениями для технического анализа рынков.	Студент демонстрирует необходимый объем теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Уметь – применять инструменты фундаментального и технического анализа для выработки инвестиционных стратегий на фондовом и валютном рынках; – осуществлять операции купли-продажи ценных бумаг в соответствии с выбранной стратегией; – пользоваться специализированными информационными системами и приложениями для технического анализа рынка; – использовать программное обеспечение для совершения сделок.	Студент демонстрирует умение решать практические задачи на основе полученных теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Владеть – методами разработки стратегий эффективного управления средствами клиентов на денежном рынке, включая Форекс, срочный и спотовый рынки; – методами хеджирования рисков; – навыками биржевой торговли; – навыками работы с информационными системами, приложениями для технического анализа рынков.	Студент владеет навыками применения полученных теоретических и практических знаний при решении задач прикладного характера.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах

7.1.2 Этап промежуточного контроля знаний

Результаты промежуточного контроля знаний оцениваются в 7 семестре для очной формы обучения, 10 семестре для очно-заочной формы обучения, 7 семестре для заочной формы обучения по четырехбалльной системе:

«отлично»;

«хорошо»;

«удовлетворительно»;

«неудовлетворительно».

Компетенция	Результаты обучения, характеризующие сформированность компетенции	Критерии оценивания	Отлично	Хорошо	Удовл.	Неудовл.
ПК-4	Знать – виды ценных бумаг, находящихся в обращении на территории РФ и за рубежом, включая производные инструменты (деривативы), виды и особенности торговли механизмы валютного обращения. – законодательство Российской Федерации в области банковской деятельности и рынка ценных бумаг; – методы и инструменты технического и фундаментального анализа фондовых рынков; виды специализированных торговых терминалов, используемых в биржевой торговле.	Тест	Выполнение теста на 90- 100%	Выполнение теста на 80-90%	Выполнение теста на 70-80%	В тесте менее 70% правильных ответов
	Уметь – использовать производные финансовые инструменты для заключения срочных контрактов; – прогнозировать динамику валютного рынка и использовать валютные свопы; – осуществлять брокерское обслуживание в соответствии с законодательством РФ; – использовать программное обеспечение и виды специализированных торговых терминалов, используемых в биржевой торговле.	Решение стандартных практических задач	Задачи решены в полном объеме и получены верные ответы	Продемонстрирован верный ход решения всех, но не получен верный ответ во всех задачах	Продемонстрирован верный ход решения в большинстве задач	Задачи не решены
	Владеть – методами технического анализа финансовых рынков; – методами заключения форвардных контрактов на покупку (продажу) валюты по фиксированному курсу на определенную дату в будущем; – инструментами технического анализа фондовых рынков; навыками работы со специализированными торговыми терминалами, используемыми в биржевой торговле.	Решение прикладных задач в конкретной предметной области	Задачи решены в полном объеме и получены верные ответы	Продемонстрирован верный ход решения всех, но не получен верный ответ во всех задачах	Продемонстрирован верный ход решения в большинстве задач	Задачи не решены

ПК-5	Знать – методы прогнозирования основных рыночных трендов; – методы оценки рисков финансовых активов; – механизмы хеджирования рисков с применением различных финансовых инструментов; – правила биржевой торговли и внебиржевого рынка ценных бумаг; – специализированные информационные системы и приложения для технического анализа и построения графиков.	Тест	Выполнение теста на 90- 100%	Выполнение теста на 80-90%	Выполнение теста на 70-80%	В тесте менее 70% правильных ответов
	Уметь – применять инструменты фундаментального и технического анализа для выработки инвестиционных стратегий на фондовом и валютном рынках; – осуществлять операции купли-продажи ценных бумаг в соответствии с выбранной стратегией; – пользоваться специализированными информационными системами и приложениями для технического анализа рынка; – использовать программное обеспечение для совершения сделок.	Решение стандартных практических задач	Задачи решены в полном объеме и получены верные ответы	Продемонстрирован верный ход решения всех, но не получен верный ответ во всех задачах	Продемонстрирован верный ход решения в большинстве задач	Задачи не решены
	Владеть – методами разработки стратегий эффективного управления средствами клиентов на денежном рынке, включая Форекс, срочный и спотовый рынки; – методами хеджирования рисков; – навыками биржевой торговли; – навыками работы с информационными системами, приложениями для технического анализа рынков.	Решение прикладных задач в конкретной предметной области	Задачи решены в полном объеме и получены верные ответы	Продемонстрирован верный ход решения всех, но не получен верный ответ во всех задачах	Продемонстрирован верный ход решения в большинстве задач	Задачи не решены

7.2 Примерный перечень оценочных средств (типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности)

7.2.1 Примерный перечень заданий для подготовки к тестированию

1. Рынок, организованный фондовой (фьючерсной, фондовыми секциями валютной и товарной) биржей и работающими на ней брокерскими и дилерскими фирмами, — это:

- а) биржевой рынок;
- б) внебиржевой рынок;

- в) срочный рынок.
2. Что относится к субъектам рынка ценных бумаг?
- а) акция;
- б) брокер;
- в) облигация.
3. Что относится к объектам рынка ценных бумаг?
- а) эмитент;
- б) инвестор;
- в) акция.
4. В чем состоит отличие организованного рынка ценных бумаг от неорганизованного?
- а) на организованном рынке торгуют любые участники рынка, а на неорганизованном — только профессиональные участники рынка;
- б) торговля на неорганизованном рынке ценных бумаг осуществляется на основе законодательно установленных правил, а на организованном правила не установлены;
- в) на организованном рынке обращение ценных бумаг осуществляется на основе законодательно установленных правил между лицензированными профессиональными посредниками, а на неорганизованном — без соблюдения единых для всех участников рынка правил.
5. Фондовые биржи согласно российскому законодательству создаются в организационно-правовой форме:
- а) общества с ограниченной ответственностью или закрытого акционерного общества;
- б) некоммерческого партнерства или акционерного общества;
- в) ассоциации или некоммерческого партнерства.
6. Держателем реестра акционеров акционерного общества может быть:
- а) специализированный регистратор или акционерное общество, осуществившее размещение акций;
- б) исключительно специализированный регистратор;
- в) исключительно акционерное общество, осуществившее размещение акций.
7. Модель “восходящий треугольник”:
- а) как правило, подтверждает восходящую тенденцию;
- б) как правило, предупреждает о переломе восходящей тенденции;
- в) как правило, подтверждает нисходящую тенденцию.
8. Что означает понятие – “рынок учитывает все”:
- а) в рыночном курсе ценной бумаги нашли свое отражение все
- б) факторы, которые по каким-либо причинам могли или могут повли-
- в) ять на ее стоимость ценной бумаги;
- г) информация о сделках равнодоступна всем участникам рынка;
- д) все участники рынка обязаны раскрывать информацию о своих сделках.
9. На протяжении торговой сессии в РТС все котировки являются:
- а) индикативными;
- б) твердыми.
10. Фондовая биржа может совмещать свою деятельность с деятельностью:
- а) в качестве дилера;
- б) по определению взаимных обязательств;
- в) по ведению реестра владельцев ценных бумаг.

7.2.2 Примерный перечень заданий для решения стандартных задач

1. Какого индекса Доу-Джонса не существует?
- а) Промышленный индекс Доу-Джонса;

- б) Финансовый индекс Доу-Джонса;
 - в) Транспортный индекс Доу-Джонса;
 - г) Коммунальный индекс Доу-Джонса.
2. Как называется Центральный Банк Еврозоны?
- а) ЕЦБ;
 - б) СФР;
 - в) ЦБЕ;
 - г) ФРС.
3. Государственное регулирование деятельности на рынке ценных бумаг в РФ осуществляется путем:
- а) лицензирования деятельности профессиональных участников фондового рынка;
 - б) участия в саморегулируемых организациях;
 - в) непосредственного управления деятельностью профессиональных участников фондового рынка
4. Если линия скользящей средней находится ниже ценового графика, то тренд является:
- а) восходящим;
 - б) боковым;
 - в) нисходящим.
5. Фьючерсные контракты стандартизированы по следующим параметрам:
- а) количество базисного актива;
 - б) срок поставки;
 - в) цена базисного актива;
 - г) наименование биржи, на которой продается контракт.
6. При покупке опциона на продажу:
- а) держатель опциона играет на повышение, надписатель – на понижение;
 - б) держатель опциона играет на понижение, надписатель – на повышение;
 - в) держатель и надписатель играют на повышение;
 - г) держатель и надписатель играют на понижение.
7. Какова основная задача постановки уровня StopLoss?
- а) Получить дополнительную прибыль;
 - б) Ограничить риски;
 - в) Открыть сделку;
 - г) Все три варианта верны.
8. Что означает понятие – “рынок учитывает все”:
- а) в рыночном курсе ценной бумаги нашли свое отражение все факторы, которые по каким-либо причинам могли или могут повлиять на ее стоимость ценной бумаги;
 - б) информация о сделках равнодоступна всем участникам рынка;
 - в) все участники рынка обязаны раскрывать информацию о своих сделках.
9. Как динамика значений объема связана с направлением изменения цены:
- а) при восходящей тенденции значения объема увеличиваются по мере роста значений цены;
 - б) при нисходящей тенденции значения объема уменьшаются по мере уменьшения значений цены;
 - в) динамика значений объема не зависит от направления тенденции?
10. Член биржи, биржевой спекулянт, торгующий для себя:
- а) скалпер;
 - б) спредер;
 - в) маклер;
 - г) трейдер;

7.2.3 Примерный перечень заданий для решения прикладных задач

1. Модель “восходящий треугольник”:
 - а) как правило, подтверждает восходящую тенденцию;
 - б) как правило, предупреждает о переломе восходящей тенденции;
 - в) как правило, подтверждает нисходящую тенденцию.
2. Как динамика значений объема связана с направлением изменения цены:
 - а) при восходящей тенденции значения объема увеличиваются по мере роста значений цены;
 - б) при нисходящей тенденции значения объема уменьшаются по мере уменьшения значений цены;
 - в) динамика значений объема не зависит от направления тенденции?
3. В техническом анализе используются:
 - а) финансовый анализ эмитента;
 - б) осцилляторы;
 - в) макроэкономический анализ;
 - г) скользящие средние;
 - д) трендовые модели.
4. Подтверждением фигуры «голова и плечи» является:
 - а) уменьшение объема торговли при повышении цены;
 - б) рост объема торговли при снижении цены;
 - в) уменьшение объема торговли при снижении цены;
 - г) рост объема торговли при повышении цены.
5. К какой группе моделей графического способа технического анализа принадлежит модель «двойная вершина»:
 - а) модели перелома тенденции;
 - б) модели подтверждения тенденции.
6. Фьючерсный контракт ликвидируется
 - а) в одностороннем порядке покупателем;
 - б) в одностороннем порядке продавцом;
 - в) путем заключения офсетной сделки (контракта);
 - г) расчетной палатой.
7. Какие фигуры относятся к моделям разворота тренда?
 - а) «Флаг»;
 - б) «Бриллиант»;
 - в) «Вымпел»
8. Какие фигуры относятся к моделям продолжения тренда?
 - а) «Двойная вершина»;
 - б) «Бриллиант»;
 - в) «Треугольник»
9. Скользящая средняя пересекает график цены снизу. Это означает:
 - а) снижение объемов торгов;
 - б) возможность открыть короткую позицию;
 - в) разворот тренда
10. Фьючерсный контракт ликвидируется
 - а) в одностороннем порядке покупателем;
 - б) в одностороннем порядке продавцом;
 - в) путем заключения офсетной сделки (контракта);
 - г) расчетной палатой.

7.2.4 Примерный перечень вопросов для подготовки к зачету

Не предусмотрено учебным планом

7.2.5 Примерный перечень заданий для подготовки к экзамену

1. Крупнейшие биржи мира и современные тенденции развития биржевой торговли
2. Модель рыночного цикла. Понятие тренда. Основные тренды. Последовательность пиков и впадин.
3. Уровни поддержки и сопротивления. Силы поддержки и сопротивления
4. Уровни поддержки и сопротивления. Действительный и ложный прорыв линии поддержки (сопротивления).
5. Первичный, промежуточный, краткосрочные тренды. Последовательность и разворот трендов.
6. Теория Доу. Основные положения теории.
7. Волновой принцип Эллиотта. Основные положения теории Эллиотта.
8. Волновой принцип Эллиотта. Распознавание волновых характеристик.
9. Уровни Фибоначчи. Расширения Фибоначчи. Стратегии торговли по уровням Фибоначчи.
10. Ценовые фигуры. Фигуры продолжения и разворота тренда. Зоны консолидации
11. Японские свечи. Виды свечей. Анализ графиков рынка.
12. Паттерны «японских свечей». Фигуры разворота тренда.
13. Трендовые индикаторы. Виды индикаторов. Сигналы индикаторов
14. Скользящие средние. Простая, взвешенная, экспоненциальная, смещенная скользящие средние.
15. Двойные и тройные скользящие средние. Торговые сигналы.
16. Применение скользящих средних. Определение, подтверждение тренда. Выбор длины скользящей средней.
17. Ценовые фильтры. Применение в торговле.
18. Конверты (торговые полосы). Полосы Боллинджера.
19. Дивергенция. Виды дивергенции. Классическая дивергенция
20. Классы обычных дивергенций.
21. Скрытая дивергенция.
22. Расширенная дивергенция
23. Торговля на дивергенциях и планирование сделки.
24. Осцилляторы. Сущность и виды осцилляторов.
25. Осциллятор MACD. Стратегия осциллятора и принцип работы.
26. Стохастический осциллятор (стохастик). Стратегия осциллятора стохастик и принцип работы.
27. Торговые сигналы стохастика. Практическое применение.
28. Индекс относительной силы (RSI). Торговые сигналы. Практическое применение индикатора RSI
29. Осциллятор Аккумуляции/Распыления (A/D). Торговые сигналы. Практическое применение.
30. Осциллятор Чайкина. Торговые сигналы. Практическое применение.
31. Индикатор Parabolic SAR. Модифицированные индикаторы Parabolic

SAR. Торговые сигналы. Практическое применение.

32. Индикатор «Объемы торгов» (Volume, Trade Volume). Торговые сигналы.

33. Индикатор «Баланс объемов» (OBV). Стратегии торговли и торговые сигналы.

34. Индикатор «Индекс Силы». Принцип работы. Торговые сигналы.

35. Индикатор ADX. Стратегия и принцип работы.

36. Индикатор CCI (Индекс Товарного Канала). Торговля по CCI.

37. Уровни Пивот. Стратегии торговли по уровням Пивот.

38. Инструменты Ганна. Виды и методы торговли.

39. Биржевые приказы и их использование в торговых стратегиях. Stop Loss и Take Profit.

40. Современный фондовый рынок России

7.2.6. Методика выставления оценки при проведении промежуточной аттестации

Экзамен проводится по тест-билетам, каждый из которых содержит 10 вопросов и задачу. Каждый правильный ответ на вопрос в тесте оценивается 1 баллом, задача оценивается в 10 баллов (5 баллов верное решение и 5 баллов за верный ответ). Максимальное количество набранных баллов – 20.

1. Оценка «Неудовлетворительно» ставится в случае, если студент набрал менее 6 баллов.

2. Оценка «Удовлетворительно» ставится в случае, если студент набрал от 6 до 10 баллов

3. Оценка «Хорошо» ставится в случае, если студент набрал от 11 до 15 баллов.

4. Оценка «Отлично» ставится, если студент набрал от 16 до 20 баллов.)

7.2.7 Паспорт оценочных материалов

№ п/п	Контролируемые разделы (темы) дисциплины	Код контролируемой компетенции	Наименование оценочного средства
1	Мировые рынки и биржи.	ПК-4, ПК-5	Тест, вопросы для подготовки к экзамену, требования к курсовой работе
2	Модели рыночного цикла. Теория Доу. Волновой принцип Эллиотта	ПК-4, ПК-5	Тест, вопросы для подготовки к экзамену, требования к курсовой работе
3	Численные методы технического анализа. Индикаторы рынка.	ПК-4, ПК-5	Тест, вопросы для подготовки к экзамену, требования к курсовой работе
4	Численные методы технического анализа. Индикаторы и осцилляторы рынка.	ПК-4, ПК-5	Тест, вопросы для подготовки к экзамену, требования к курсовой работе
5	Ценовые графики и методы их анализа.	ПК-4, ПК-5	Тест, вопросы для подготовки к экзамену, требования к курсовой работе
6	Методы прогнозирования	ПК-4, ПК-5	Тест, вопросы для подготовки к экзамену, требования к курсовой работе

7.3. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности

Тестирование осуществляется, либо при помощи компьютерной системы тестирования, либо с использованием выданных тест-заданий на бумажном носителе. Время тестирования 30 мин. Затем осуществляется проверка теста экзаменатором и выставляется оценка согласно методике выставления оценки при проведении промежуточной аттестации.

Решение стандартных задач осуществляется, либо при помощи компьютерной системы тестирования, либо с использованием выданных задач на бумажном носителе. Время решения задач 30 мин. Затем осуществляется проверка решения задач экзаменатором и выставляется оценка, согласно методике выставления оценки при проведении промежуточной аттестации.

Решение прикладных задач осуществляется, либо при помощи компьютерной системы тестирования, либо с использованием выданных задач на бумажном носителе. Время решения задач 30 мин. Затем осуществляется проверка решения задач экзаменатором и выставляется оценка, согласно методике выставления оценки при проведении промежуточной аттестации.

Защита курсовой работы, курсового проекта или отчета по всем видам практик осуществляется согласно требованиям, предъявляемым к работе, описанным в методических материалах. Примерное время защиты на одного студента составляет 20 мин.

8 УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

8.1 Перечень учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

1. Рынок ценных бумаг : Курс лекций / сост. Э. Ю. Околелова. - Воронеж : Воронежский государственный архитектурно-строительный университет, ЭБС АСВ, 2013. - 163 с. - ISBN 973-5-89040-439-8.

URL: <http://www.iprbookshop.ru/22668.html>

2. Балтин, В. Э. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс] : Практикум / В. Э. Балтин, Ю. И. Булатова. - Оренбург : Оренбургский государственный университет, ЭБС АСВ, 2017. - 140 с. - ISBN 978-5-7410-1950-4.

URL: <http://www.iprbookshop.ru/78833.html>

3. Иванилова, С. В. Биржевое дело : Учебное пособие для бакалавров / Иванилова С. В. - Москва : Дашков и К, 2015. - 224 с. - ISBN 978-5-394-02541-9.

URL: <http://www.iprbookshop.ru/29259.html>

4. Околелова Э.Ю., Шибаева М.А., Ефимьев А.С., Шальнев О.Г., Сергеева С.И. Технический анализ финансовых рынков [Текст] : учебное пособие для бакалавров, обучающихся по направлению "Экономика", и магистров, обучающихся по программе "Финансы и кредит" / ФГБОУ ВО "Воронеж. гос. техн. ун-т". - Воронеж : [ООО "Ритм"], 2019. - 163 с. : ил. - Библиогр.: с. 160-161 (33 назв.). - ISBN 978-5-6043308-8-3 : 100-00.

5. Технический анализ финансовых рынков [Электронный ресурс] : методические указания к практическим занятиям и самостоятельной работе

для студентов направления 38.03.01 «Экономика» (профиль «Финансы, кредит, страхование») всех форм обучения / ФГБОУ ВО "Воронеж. гос. техн. ун-т", каф. цифровой и отраслевой экономики ; сост. : Э. Ю. Околелова, Л. В. Березняков. - Воронеж : Воронежский государственный технический университет, 2021. - Электрон. текстовые и граф. данные (2,22 Мб) : ил. - Библиогр.: с. 23 (6 назв.).

Электронные ресурсы: 179-2021 Технический анализ финансовых рынков

6. Технический анализ финансовых рынков [Текст] : методические указания к выполнению курсового проекта по дисциплине "Технический анализ финансовых рынков" для студентов направления 38.03.01 "Экономика" (профиль "Финансы, кредит, страхование") всех форм обучения / ФГБОУ ВО "Воронеж. гос. техн. ун-т", каф. цифровой и отраслевой экономики ; сост. : Э. Ю. Околелова, М. А. Шибаева, Л. В. Березняков. - Воронеж : Воронежский государственный технический университет, 2020. - Электрон. текстовые и граф. данные (1,9 Мб) : ил. : табл. - Библиогр.: с. 19 (5 назв.).

Электронные ресурсы: 112-2020 Технический анализ финансовых рынков

8.2 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень лицензионного программного обеспечения, ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем:

Лицензионное программное обеспечение

1. Office Professional Plus 2013 Single MVL A Each Academic
2. 1С:Предприятие 8. Комплект для обучения в высших и средних учебных заведениях. Электронная поставка

Свободное ПО

1. LibreOffice
2. Moodle
3. OpenOffice
4. Skype
5. Zoom

Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

1. <http://www.edu.ru/>
2. Образовательный портал ВГТУ

Информационные справочные системы

1. <http://window.edu.ru>
2. <https://wiki.cchgeu.ru/>

Современные профессиональные базы данных

1. Федеральная служба государственной статистики
Адрес ресурса: <http://www.gks.ru/>
2. Центральный банк Российской Федерации
Адрес ресурса: <http://www.cbr.ru/>
3. Ресурсы издательства World Bank
Адрес ресурса: <https://www.worldbank.org/>

4. РосБизнесКонсалтинг — информационное аналитическое агентство
Адрес ресурса: <https://www.rbc.ru/>
5. Россия и всемирная торговая организация
Адрес ресурса: <https://wto.ru/>
6. Бухгалтерский учет и налоги
Адрес ресурса: <http://businessuchet.ru/>
7. АК&М — экономическое информационное агентство
Адрес ресурса: <http://www.akm.ru/>
8. Bloomberg -Информационно-аналитическое агентство
Адрес ресурса: <https://www.bloomberg.com/europe>
9. CATBACK.RU — Справочник для экономистов
Адрес ресурса: <http://www.catback.ru/>
10. Библиотека конгресса США
Адрес ресурса: <https://www.loc.gov/>
11. Единый портал бюджетной системы Российской Федерации
Адрес ресурса: <http://budget.gov.ru/>
12. Независимый финансовый портал
Адрес ресурса: <https://www.finweb.com/>

9 МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКАЯ БАЗА, НЕОБХОДИМАЯ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА

Материально-техническое обеспечение дисциплины включает:

Лекционная аудитория, оснащённая мультимедийным оборудованием (проектор, экран, звуковоспроизводящее оборудование), обеспечивающим демонстрацию (воспроизведение) мультимедиа-материалов.

Аудитории для практических занятий и лабораторные работы, оснащенные:

- мультимедийным оборудованием (проектор, экран, звуковоспроизводящее оборудование), обеспечивающим демонстрацию (воспроизведение) мультимедиа-материалов;
- интерактивными информационными средствами;
- компьютерной техникой с подключением к сети Интернет.

10. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

По дисциплине «Технический анализ финансовых рынков» читаются лекции, проводятся практические занятия, выполняется курсовая работа.

Основой изучения дисциплины являются лекции, на которых излагаются наиболее существенные и трудные вопросы, а также вопросы, не нашедшие отражения в учебной литературе.

Практические занятия направлены на приобретение практических навыков анализа финансовых рынков. Занятия проводятся путем решения конкретных задач в аудитории.

Методика выполнения курсовой работы изложена в методических ука-

заниях. Выполнять этапы курсовой работы должны своевременно и в установленные сроки.

Контроль усвоения материала дисциплины производится проверкой курсовой работы, защитой курсовой работы.

Вид учебных занятий	Деятельность студента
Лекция	Написание конспекта лекций: кратко, схематично, последовательно фиксировать основные положения, выводы, формулировки, обобщения; пометать важные мысли, выделять ключевые слова, термины. Проверка терминов, понятий с помощью энциклопедий, словарей, справочников с выписыванием толкований в тетрадь. Обозначение вопросов, терминов, материала, которые вызывают трудности, поиск ответов в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удастся разобраться в материале, необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на лекции или на практическом занятии.
Практическое занятие	Конспектирование рекомендуемых источников. Работа с конспектом лекций, подготовка ответов к контрольным вопросам, просмотр рекомендуемой литературы. Прослушивание аудио- и видеозаписей по заданной теме, выполнение расчетно-графических заданий, решение задач по алгоритму.
Самостоятельная работа	Самостоятельная работа студентов способствует глубокому усвоению учебного материала и развитию навыков самообразования. Самостоятельная работа предполагает следующие составляющие: - работа с текстами: учебниками, справочниками, дополнительной литературой, а также проработка конспектов лекций; - выполнение домашних заданий и расчетов; - работа над темами для самостоятельного изучения; - участие в работе студенческих научных конференций, олимпиад; - подготовка к промежуточной аттестации.
Подготовка к промежуточной аттестации	Готовиться к промежуточной аттестации следует систематически, в течение всего семестра. Интенсивная подготовка должна начаться не позднее, чем за месяц-полтора до промежуточной аттестации. Данные перед экзаменом, экзаменом, экзаменом три дня эффективнее всего использовать для повторения и систематизации материала.