

АННОТАЦИЯ
к рабочей программе учебной дисциплины
«Технический анализ финансовых рынков»
для направления подготовки (специальности) 38.03.01 «Экономика»
профиль (специализация) «Финансы, кредит, страхование»

1. Наименование образовательной программы, в рамках которой изучается дисциплина

Данная рабочая программа учебной дисциплины «Технический анализ финансовых рынков» предназначена для студентов, обучающихся по направлению 38.03.01 «Экономика».

Дисциплина «Технический анализ финансовых рынков» (Б1.В.ОД.13) относится к обязательным дисциплинам вариативной части.

2. Общая трудоёмкость

Дисциплина «Технический анализ финансовых рынков» изучается в объеме 5 зачетных единиц (ЗЕТ) – 180 часов, которые включают (очно/заочно) 36/- ч. лекций, 36/- ч. практических занятий, и 72/- ч. самостоятельных занятий.

3. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Технический анализ финансовых рынков» (Б1.В.ОД.13) относится к обязательным дисциплинам вариативной части. При ее освоении используются знания следующих дисциплин.

Рынок ценных бумаг: основные понятия рынка ценных бумаг, виды рынков и финансовых активов, рынок производных финансовых инструментов, методы биржевой торговли, операции с ценными бумагами.

Финансы: основные понятия финансов, финансовые рынки и институты, механизмы финансового обращения на различных уровнях хозяйствующих субъектов.

Теория отраслевых рынков: развитие рынка труда и капитала, анализ взаимосвязи с финансовым рынком.

Мировая экономика и международные экономические отношения: механизмы формирования мировой финансовой системы, валютные отношения, развитие финансовых рынков, условия их взаимодействия с другими рынками, их взаимосвязь.

Финансовые инвестиции: методы формирования капитала акционерного общества, система управления движением капитала на корпоративном уровне, механизмы формирования и распределения прибыли, эмиссия ценных бумаг, формирование инвестиционного портфеля.

Теория вероятностей и математическая статистика: понятие вероятности события, выборки, построение регрессионных уравнений, оценка точности аппроксимации, теория проверки гипотез; динамические ряды; построение вероятностных моделей случайных событий; факторный анализ.

Методы моделирования и прогнозирования экономики: процессы моделирования и прогнозирования общерыночных трендов, выявление динамики и точек разворота тренда, прогнозирование динамики рынка, факторный анализ, корреляционно-регрессионный анализ, задачи оптимизации процессов, имитационное моделирование, анализ рисков.

Информатика: используются навыки программирования, работы с ЭВМ в лабораторном практикуме, курсовом проектировании.

Знания, полученные при изучении дисциплины «Технический анализ финансовых рынков» используются в дальнейшем при изучении специальных дисциплин в части моделирования и управления пакетом ценных бумаг и других активов предприятия.

4. Цель изучения дисциплины

Учебный курс посвящен комплексному системному изучению особенностей функционирования рынка ценных бумаг, изучению механизмов анализа и прогнозирования рыночных трендов в условиях динамично трансформирующейся экономики. В рамках дисциплины «Технический анализ финансовых рынков» анализируя широкий спектр проблем фондового рынка в российских условиях, систематизируются основные знания о механизме функционирования, технике операций на рынке ценных бумаг. Учебная программа полностью отвечает требованиям государственного стандарта к специальной дисциплине "Рынок ценных бумаг и биржевое дело". Особое внимание уделено вопросам моделирования и прогнозирования динамики торгов на фондовых биржах, как основному механизму разработки финансовых инвестиционных стратегий. Значительное внимание уделяется методам анализа и прогнозирования рынка деривативов.

В курсе рассмотрены различные формы биржевой торговли и биржевые инструменты, а также основные виды профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг и формы его регулирования. Подробно изучаются методы финансового анализа ценных бумаг, такие, как фундаментальный и технический методы, которые помогают при принятии инвестиционных решений. Особое внимание уделяется фондовым индексам, поскольку они являются самым удобным инструментом для описания динамики и оценки состояния фондового рынка. В учебной программе рассмотрены различные методы математического моделирования рынка, в том числе построение рыночных циклов, прогнозирование по скользящим средним, исследование индикаторов рынка.

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

Задачами дисциплины являются:

- изучение методов биржевой торговли;
- изучение рыночных циклов;
- изучение методов анализа ситуации на рынке ценных бумаг;
- построение прогнозных моделей рынка;
- исследование индикаторов и осцилляторов рынка;
- анализ и прогнозирование по ценовым фигурам тренда;
- построение торговых стратегий.

В результате изучения курса студент должен знать:

- модель рыночных циклов;
- теория Доу и волновой принцип Элиотта;
- численные методы технического анализа;
- основные индикаторы и осцилляторы рынка;
- методы прогнозирования по скользящим средним;
- понятие дивергенции и конвергенции;
- сигналы индикаторов рынка;
- ценовые фигуры тренда, фигуры продолжения и разворота;
- правила торговли для трейдеров.

5. Требования к результатам освоения дисциплины:

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

общекультурные компетенции:

способность использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности (ОК-3);

способность работать в коллективе, толерантно воспринимая социальные, этнические, конфессиональные и культурные различия (ОК-5);

общефессиональные компетенции:

способность решать стандартные задачи профессиональной деятельности на основе информационной и библиографической культуры с применением информационно-коммуникационных технологий и с учетом основных требований информационной безопасности (ОПК-1);

способность осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач (ОПК-2);

способность находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовность нести за них ответственность (ОПК-4).

профессиональные компетенции

аналитическая, научно-исследовательская деятельность:

способность анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений (ПК-5);

способность анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей (ПК-6);

способность, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет (ПК-7);

способность использовать для решения аналитических и исследовательских задач современные технические средства и информационные технологии (ПК-8);

способность использовать для решения коммуникативных задач современные технические средства и информационные технологии (ПК-10);

После освоения дисциплины студент должен приобрести следующие знания, умения и навыки, соответствующие компетенциям ОПОП: ОК-3, ОК-5, ОПК-1, ОПК-2, ОПК-4, ПК-5, ПК-6, ПК-7, ПК-8, ПК-10.

Студент должен знать:

Методику анализа фондовых рынков, в том числе рыночные методы и механизмы; механизмы валютного обращения; виды ценных бумаг, находящихся в обращении на территории РФ и за рубежом; производные инструменты – деривативы, виды деривативов; фьючерсные контракты, форварды, опционы; хеджирующие, арбитражные и спекулятивные стратегии фондового рынка; методы прогнозирования основных рыночных трендов; методы оценки рисков финансовых активов (ОПК-1, ОПК-2, ОПК-4, ПК-5, ПК-6, ПК-7, ПК-8, ПК-10).

Студент должен уметь:

Применять полученные знания в области теории и практики деятельности фондовых бирж; анализировать динамику рынка ценных бумаг; оценивать инвестиционную привлекательность финансовых активов; прогнозировать трендовую динамику отдельных активов и рынка в целом; определять рациональные стратегические решения по обеспечению эффективной деятельности предприятия в области финансовых инвестиций (ОПК-1, ОПК-2, ОПК-4, ПК-5, ПК-6, ПК-7, ПК-8, ПК-10).

Студент должен владеть:

Методами анализа фондовых рынков, оценки доходности финансовых активов, формирования оптимальных инвестиционных стратегий, методами прогнозирования, анализа и оценки рисков, приемами расчета цены и доходности активов (ОПК-1, ОПК-2, ОПК-4, ПК-5, ПК-6, ПК-7, ПК-8, ПК-10).

6. Содержание дисциплины

В основе дисциплины лежат 6 основополагающих разделов:

1. Мировые рынки и биржи.
2. Модели рыночного цикла. Теория Доу. Волновой принцип Эллиотта
3. Численные методы технического анализа. Индикаторы рынка.
4. Численные методы технического анализа. Осцилляторы рынка.
5. Ценовые графики и методы их анализа.
6. Методы прогнозирования

7. Формы организации учебного процесса по дисциплине

Изучение дисциплины «Технический анализ финансовых рынков» складывается из следующих элементов:

• лекции по дисциплине в соответствии с рабочей программой и календарным планом;

• практические занятия;

• самостоятельное изучение проблем, вынесенных на лекционных и практических занятиях;

• самостоятельное изучение отдельных вопросов, не включенных в содержание лекционных и практических занятий;

• подготовка к текущему и промежуточному контролю знаний;

• подготовка к итоговому зачету.

Подготовка к практическим занятиям и самостоятельное изучение отдельных рекомендуемых к изучению вопросов осуществляется с использованием:

• лекционных материалов;

• рекомендуемой литературы;

• периодических изданий;

• сети «Интернет».

8. Виды контроля

Экзамен: 7/- семестр

Составитель:

Околелова Э.Ю., д.э.н., проф.