

**МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ  
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Воронежский государственный технический университет»

УТВЕРЖДАЮ  
Декан факультета  С.А. Баркалов  
«30» августа 2017 г.



**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**


**Форма обучения очная**

**Год начала подготовки 2017**


Автор программы

 /Околелова Э.Ю./

Заведующий кафедрой  
Экономики и основ пред-  
принимательства

 /Гасилов В.В./

Руководитель ОПОП

 /Околелова Э.Ю./

Воронеж 2017

## 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 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.

## 2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП

Дисциплина «Технический анализ финансовых рынков» относится к дисциплинам вариативной части блока Б1.

## 3. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

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

ОПК-3 - способностью выбрать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, проанализировать результаты расчетов и обосновать полученные выводы

ПК-4 - способностью на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты

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

ПК-8 - способностью использовать для решения аналитических и исследовательских задач современные технические средства и информационные технологии

Компетенция	Результаты обучения, характеризующие сформированность компетенции
ОПК-3	Знать <ul style="list-style-type: none"><li>• численные методы технического анализа;</li><li>• основные индикаторы и осцилляторы рынка;</li><li>• методы прогнозирования по скользящим средним;</li><li>• понятие дивергенции и конвергенции;</li><li>• сигналы индикаторов рынка;</li></ul>

	<ul style="list-style-type: none"> <li>• ценовые фигуры тренда, фигуры продолжения и разворота;</li> <li>• правила торговли для трейдеров.</li> </ul>
	<p>Уметь</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• выбрать инструментальные средства для обработки данных о динамике рынка;</li> <li>• обосновать полученные выводы и принять оптимальное инвестиционное решение.</li> </ul>
	<p>Владеть</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• инструментами технического анализа финансовых рынков;</li> <li>• техникой биржевой торговли.</li> </ul>
ПК-4	<p>Знать</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• методику анализа фондовых рынков;</li> <li>• модель рыночных циклов;</li> <li>• теорию Доу и волновой принцип Эллиотта</li> <li>• рыночные методы и механизмы;</li> <li>• производные инструменты (деривативы), виды особенности торговли;</li> <li>• хеджирующие, арбитражные и спекулятивные стратегии фондового рынка;</li> <li>• методы прогнозирования основных рыночных трендов;</li> <li>• методы оценки рисков финансовых активов</li> </ul>
	<p>Уметь</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• строить модели прогнозирования основных рыночных трендов;</li> <li>• анализировать и оценивать риски финансовых активов;</li> <li>• принимать инвестиционные решения на основе моделирования финансовых процессов.</li> </ul>
	<p>Владеть</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• навыками построения моделей основных рыночных трендов;</li> <li>• методами разработки и обоснования инвестиционных решений.</li> </ul>
ПК-6	<p>Знать</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• механизмы валютного обращения;</li> <li>• виды ценных бумаг, находящихся в обращении на территории РФ и за рубежом;</li> <li>• правила биржевой торговли;</li> <li>• систему государственного регулирования рынка ценных бумаг и биржевой торговли.</li> </ul>
	<p>Уметь</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• выявлять тенденции изменения финансовых рынков;</li> <li>• применять на практике ценовые сигналы индикаторов рынка;</li> <li>• определять основные определяющие факторы финансового рынка.</li> </ul>
	<p>Владеть</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• методами и приемами анализа данных отечественной и зарубежной статистики о финансовых рынках;</li> <li>• навыками определения основных тенденций изменения рыночных трендов и отдельных активов;</li> <li>• методами прогнозирования ценовой динамики финансовых рынков.</li> </ul>
ПК-8	<p>знать</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• правила биржевой торговли с использованием Интернет-технологий;</li> <li>• программы трейдинга (QUIK, Metatreder 5)</li> </ul>
	<p>Уметь</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• применять полученные знания в области теории и практики деятельности</li> </ul>

фондовых бирж, используя современные технические средства; <ul style="list-style-type: none"> <li>• анализировать динамику рынка ценных бумаг с использованием трейдинг-программ (QUIK, Metatreder 5)</li> </ul>
Владеть <ul style="list-style-type: none"> <li>• методами построения экономических моделей, описывающих трендовые изменения финансовых рынков;</li> <li>• современными техническими средствами в области трейдинга;</li> <li>• навыками работы на торговых площадках с помощью трейдинг-программ (QUIK, Metatreder 5).</li> </ul>

#### 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
		8
<b>Аудиторные занятия (всего)</b>	44	44
В том числе:		
Лекции	22	22
Практические занятия (ПЗ)	22	22
<b>Самостоятельная работа</b>	100	100
<b>Курсовая работа</b>	+	+
Часы на контроль	36	36
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.	СРС	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	2	16	22
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.	4	4	16	24

		Основные положения теории Эллиотта. Уровни Фибоначчи.				
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	4	16	24
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.	4	4	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.	4	4	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	4	18	24
<b>Итого</b>			<b>22</b>	<b>22</b>	<b>100</b>	<b>144</b>

## 5.2 Перечень лабораторных работ

Не предусмотрено учебным планом

## 6. ПРИМЕРНАЯ ТЕМАТИКА КУРСОВЫХ ПРОЕКТОВ (РАБОТ) И КОНТРОЛЬНЫХ РАБОТ

В соответствии с учебным планом освоение дисциплины предусматривает выполнение курсовой работы в 8 семестре для очной формы обучения.

Примерная тематика курсовой работы: «Технический анализ финансовых рынков»

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 графическую часть и расчетно-пояснительную записку.

## 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
ОПК-3	Знать <ul style="list-style-type: none"> <li>• численные методы технического анализа;</li> <li>• основные индикаторы и осцилляторы рынка;</li> <li>• методы прогнозирования по скользящим средним;</li> <li>• понятие дивергенции и конвергенции;</li> <li>• сигналы индикаторов рынка;</li> <li>• ценовые фигуры тренда, фигуры продолжения и разворота;</li> <li>• правила торговли для трейдеров.</li> </ul>	Студент демонстрирует необходимый объем теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Уметь <ul style="list-style-type: none"> <li>• выбрать инструментальные средства для обработки данных о динамике рынка;</li> <li>• обосновать полученные выводы и принять оптимальное инвестиционное решение.</li> </ul>	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 <ul style="list-style-type: none"> <li>• инструментами технического анализа финансовых рынков;</li> <li>• техникой биржевой торговли.</li> </ul>	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-4	Знать <ul style="list-style-type: none"> <li>• методику анализа фондовых рынков;</li> <li>• модель рыночных циклов;</li> <li>• теорию Доу и волновой принцип Элиотта</li> <li>• рыночные методы и механизмы;</li> <li>• производные инструменты (деривативы), виды особенности торговли;</li> <li>• хеджирующие, арбитражные и спекулятивные стратегии фондового рынка;</li> <li>• методы прогнозирования основных рыночных трендов;</li> <li>• методы оценки рисков финансовых активов</li> </ul>	Студент демонстрирует необходимый объем теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Уметь <ul style="list-style-type: none"> <li>• строить модели прогнозирования основных рыночных трендов;</li> <li>• анализировать и оценивать риски</li> </ul>	Студент демонстрирует умение решать практические задачи на основе полученных	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих про-

	<p>финансовых активов;</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• принимать инвестиционные решения на основе моделирования финансовых процессов.</li> </ul>	теоретических знаний.	программах	граммах
	<p>Владеть</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• навыками построения моделей основных рыночных трендов;</li> <li>• методами разработки и обоснования инвестиционных решений.</li> </ul>	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-6	<p>Знать</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• механизмы валютного обращения;</li> <li>• виды ценных бумаг, находящихся в обращении на территории РФ и за рубежом;</li> <li>• правила биржевой торговли;</li> <li>• систему государственного регулирования рынка ценных бумаг и биржевой торговли.</li> </ul>	Студент демонстрирует необходимый объем теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	<p>Уметь</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• выявлять тенденции изменения финансовых рынков;</li> <li>• применять на практике ценовые сигналы индикаторов рынка;</li> <li>• определять основные определяющие факторы финансового рынка.</li> </ul>	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
	<p>Владеть</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• методами и приемами анализа данных отечественной и зарубежной статистики о финансовых рынках;</li> <li>• навыками определения основных тенденций изменения рыночных трендов и отдельных активов;</li> <li>• методами прогнозирования ценовой динамики финансовых рынков.</li> </ul>	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-8	<p>знать</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• правила биржевой торговли с использованием Интернет-технологий;</li> <li>• программы трейдинга (QUIK, Metatreder 5)</li> </ul>	Студент демонстрирует необходимый объем теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	<p>Уметь</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• применять полученные знания в области теории и практики деятельности фондовых бирж, используя современные технические средства;</li> <li>• анализировать динамику рынка ценных бумаг с использованием трейдинг-программ (QUIK, Metatreder 5)</li> </ul>	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
	<p>Владеть</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• методами построения экономических моделей, описывающих трендовые изменения финансовых рынков;</li> <li>• современными техническими средствами в области трейдинга;</li> <li>• навыками работы на торговых площадках с помощью трейдинг-программ (QUIK, Metatreder 5).</li> </ul>	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 8 семестре для очной формы обучения по четырехбалльной системе:

«отлично»;

«хорошо»;

«удовлетворительно»;

«неудовлетворительно».

Компетенция	Результаты обучения, характеризующие сформированность компетенции	Критерии оценивания	Отлично	Хорошо	Удовл.	Неудовл.
ОПК-3	Знать <ul style="list-style-type: none"> <li>численные методы технического анализа;</li> <li>основные индикаторы и осцилляторы рынка;</li> <li>методы прогнозирования по скользящим средним;</li> <li>понятие дивергенции и конвергенции;</li> <li>сигналы индикаторов рынка;</li> <li>ценовые фигуры тренда, фигуры продолжения и разворота;</li> <li>правила торговли для трейдеров.</li> </ul>	Тест	Выполнение теста на 90-100%	Выполнение теста на 80-90%	Выполнение теста на 70-80%	В тесте менее 70% правильных ответов
	Уметь <ul style="list-style-type: none"> <li>выбрать инструментальные средства для обработки данных о динамике рынка;</li> <li>обосновать полученные выводы и принять оптимальное инвестиционное решение.</li> </ul>	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 <ul style="list-style-type: none"> <li>инструментами технического анализа финансовых рынков;</li> <li>техникой биржевой торговли.</li> </ul>	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-4	Знать <ul style="list-style-type: none"> <li>методику анализа фондовых рынков;</li> <li>модель рыночных циклов;</li> <li>теорию Доу и волновой принцип Эллиотта</li> <li>рыночные методы и механизмы;</li> <li>производные инструменты (деривативы), виды особенности торговли;</li> <li>хеджирующие, арбитражные и спекулятивные стратегии фон-</li> </ul>	Тест	Выполнение теста на 90-100%	Выполнение теста на 80-90%	Выполнение теста на 70-80%	В тесте менее 70% правильных ответов



	<p>догового рынка;</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• методы прогнозирования основных рыночных трендов;</li> <li>• методы оценки рисков финансовых активов</li> </ul>					
	<p>Уметь</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• строить модели прогнозирования основных рыночных трендов;</li> <li>• анализировать и оценивать риски финансовых активов;</li> <li>• принимать инвестиционные решения на основе моделирования финансовых процессов.</li> </ul>	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
	<p>Владеть</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• навыками построения моделей основных рыночных трендов;</li> <li>• методами разработки и обоснования инвестиционных решений.</li> </ul>	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-6	<p>Знать</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• механизмы валютного обращения;</li> <li>• виды ценных бумаг, находящихся в обращении на территории РФ и за рубежом;</li> <li>• правила биржевой торговли;</li> <li>• систему государственного регулирования рынка ценных бумаг и биржевой торговли.</li> </ul>	Тест	Выполнение теста на 90-100%	Выполнение теста на 80-90%	Выполнение теста на 70-80%	В тесте менее 70% правильных ответов
	<p>Уметь</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• выявлять тенденции изменения финансовых рынков;</li> <li>• применять на практике ценовые сигналы индикаторов рынка;</li> <li>• определять основные определяющие факторы финансового рынка.</li> </ul>	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
	<p>Владеть</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• методами и приемами анализа данных отечественной и зарубежной статистики о финансовых рынках;</li> <li>• навыками определения основных тенденций изменения рыночных трендов и отдельных активов;</li> <li>• методами прогнозирования ценовой дина-</li> </ul>	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

	мики финансовых рынков.					
ПК-8	знать <ul style="list-style-type: none"> <li>• правила биржевой торговли с использованием Интернет-технологий;</li> <li>• программы трейдинга (QUIK, Metatrader 5)</li> </ul>	Тест	Выполнение теста на 90-100%	Выполнение теста на 80- 90%	Выполнение теста на 70-80%	В тесте менее 70% правильных ответов
	Уметь <ul style="list-style-type: none"> <li>• применять полученные знания в области теории и практики деятельности фондовых бирж, используя современные технические средства;</li> <li>• анализировать динамику рынка ценных бумаг с использованием трейдинг-программ (QUIK, Metatrader 5)</li> </ul>	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 <ul style="list-style-type: none"> <li>• методами построения экономических моделей, описывающих трендовые изменения финансовых рынков;</li> <li>• современными техническими средствами в области трейдинга;</li> <li>• навыками работы на торговых площадках с помощью трейдинг-программ (QUIK, Metatrader 5).</li> </ul>	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:

- a) биржевой рынок;
- b) внебиржевой рынок;
- c) срочный рынок.

2. Что относится к субъектам рынка ценных бумаг?

- a) акция;
- b) брокер;
- c) облигация.

3. Что относится к объектам рынка ценных бумаг?

- a) эмитент;
- b) инвестор;
- c) 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;

с) 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;

с) 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;

с) исключительно акционерное общество, осуществившее размещение акций.

7. Модель “восходящий треугольник”:

а) как правило, подтверждает восходящую тенденцию;

б) как правило, предупреждает о переломе восходящей тенденции;

с) как правило, подтверждает нисходящую тенденцию.

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;

с) 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;

с) по ведению реестра владельцев ценных бумаг.

### **7.2.2 Примерный перечень заданий для решения стандартных задач**

1. Основные тренды рынка. Первичный, промежуточный, краткосрочные тренды. Последовательность и разворот трендов.

2. Основные положения теории Доу.

3. Основные положения теории Эллиотта.
4. Уровни Фибоначчи.
5. Трендовые индикаторы. Сигналы индикаторов.
6. Скользящие средние. Простая, взвешенная, экспоненциальная, смещенная скользящие средние.
7. Стохастический осциллятор (стохастик). Стратегия осциллятора стохастик и принцип работы. Торговые сигналы стохастика.
8. Торговля с помощью осцилляторов. Расчет стохастика. Анализ работы осциллятора. Баланс объемов торгов.
9. Конвергенция и дивергенция. Торговля на дивергенциях и планирование сделки. Ценовые фигуры. Фигуры продолжения и разворота тренда.
10. Бары. Японские свечи. Виды свечей. Анализ графиков рынка.

### **7.2.3 Примерный перечень заданий для решения прикладных задач**

1. Построение моделей прогноза рынка.
2. Анализ рисков.
3. Модели продолжения и изменения тренда.
4. Прогноз рынка по индикаторам, осцилляторам.
5. Прогноз по ценовым фигурам.
6. Торговля на дивергенциях.
7. Уровни Пивот.
8. Инструменты Ганна.
9. Уровни Фибоначчи.
10. Расширения Фибоначчи.

### **7.2.4 Примерный перечень вопросов для подготовки к зачету** Не предусмотрено учебным планом

### **7.2.5 Примерный перечень заданий для решения прикладных задач**

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. Расширенная дивергенция
22. Торговля на дивергенциях и планирование сделки.
23. Осцилляторы. Сущность и виды осцилляторов.
24. Осциллятор MACD. Стратегия осциллятора и принцип работы.
25. Стохастический осциллятор (стохастик). Стратегия осциллятора стохастик и принцип работы.
26. Торговые сигналы стохастика. Практическое применение.
27. Индекс относительной силы (RSI). Торговые сигналы. Практическое применение индикатора RSI
28. Осциллятор Аккумуляции/Распыления (A/D). Торговые сигналы. Практическое применение.
29. Осциллятор Чайкина. Торговые сигналы. Практическое применение.
30. Индикатор Parabolic SAR. Модифицированные индикаторы Parabolic SAR. Торговые сигналы. Практическое применение.
31. Индикатор «Объемы торгов» (*Volume, Trade Volume*). Торговые сигналы.
32. Индикатор «Баланс объемов» (OBV). Стратегии торговли и торговые сигналы.
33. Индикатор «Индекс Силы». Принцип работы. Торговые сигналы.
34. Индикатор ADX. Стратегия и принцип работы.
35. Индикатор CCI (Индекс Товарного Канала). Торговля по CCI.
36. Уровни Пивот. Стратегии торговли по уровням Пивот.
37. Инструменты Ганна. Виды и методы торговли.
38. Биржевые приказы и их использование в торговых стратегиях. Stop Loss и Take Profit.

### **7.2.6. Методика выставления оценки при проведении промежуточной аттестации**

*(Например: 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.	ОПК-3, ПК-4, ПК- 6, ПК-8	Тест, защита курсовой работы

2	Модели рыночного цикла. Теория Доу. Волновой принцип Эллиотта	ОПК-3, ПК-4, ПК- 6, ПК-8	Тест, защита курсовой работы
3	Численные методы технического анализа. Индикаторы рынка.	ОПК-3, ПК-4, ПК- 6, ПК-8	Тест, защита курсовой работы
4	Численные методы технического анализа. Индикаторы и осцилляторы рынка.	ОПК-3, ПК-4, ПК- 6, ПК-8	Тест, защита курсовой работы
5	Ценовые графики и методы их анализа.	ОПК-3, ПК-4, ПК- 6, ПК-8	Тест, защита курсовой работы
6	Методы прогнозирования	ОПК-3, ПК-4, ПК- 6, ПК-8	Тест, защита курсовой работы

### **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 методики 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 методики 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 методики 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. Околелова Э.Ю. Рынок ценных бумаг: учеб. пособие/сост. Э.Ю. Околелова; Воронежский ГАСУ. – Воронеж, 2013. - 160с.

2. Околелова Э.Ю. Рынок ценных бумаг: метод. указания к выполнению курсовой работы для студ. бакалавриата дневного и заочного обучения спец. «Экономика» / Воронежский ГАСУ ; сост.: Э.Ю. Околелова. - Воронеж, 2014. – 20 с.

3. Алиев, А.Р. Рынок ценных бумаг в России [Электронный ресурс] : учебное пособие / А.Р. Алиев. - Рынок ценных бумаг в России; 2020-10-10. -

Москва: ЮНИТИ-ДАНА, 2017. - 199 с.

4. Газалиев, М. М. Рынок ценных бумаг / М.М. Газалиев; В.А. Осипов. - Москва: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2015. - 160 с.

5. Николаева, И. П. Рынок ценных бумаг : учебник / И.П. Николаева. - Москва: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2015. - 256 с.

6. Рынок ценных бумаг : учебник / В.А. Зверев. - Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2015. - 256 с.

7. Рынок ценных бумаг : учебник / Е.Ф. Жуков. - Москва : Юнити-Дана, 2015. - 567 с.

8. Хазанович, Э. С. Рынок ценных бумаг (практикум в Excel) : учебное пособие. 1: Основы / Э.С. Хазанович. - Москва|Берлин : Директ-Медиа, 2016. - 110 с.

9. Цибулькинова, В. Ю. Рынок ценных бумаг: учебное пособие / В.Ю. Цибулькинова. - Томск : ТУСУР, 2016. - 167 с.

**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:**

«Строй Консультант», правовая система «Гарант», Интернет.

## **9 МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКАЯ БАЗА, НЕОБХОДИМАЯ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА**

Материально-техническое обеспечение дисциплины включает:

- лекционную аудиторию, оборудованную экраном для показа слайдов через проектор;
- специализированные классы, оснащенные персональными компьютерами с выходом в 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 технического анализа финансовых рынков. Занятия проводятся путем решения конкретных задач в аудитории.

Методика выполнения курсовой работы изложена в учебно-методическом пособии. 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: <ul style="list-style-type: none"> <li>- работа с текстами: учебниками, справочниками, дополнительной литературой, а также проработка конспектов лекций;</li> <li>- выполнение домашних заданий и расчетов;</li> <li>- работа над темами для самостоятельного изучения;</li> <li>- участие в работе студенческих научных конференций, олимпиад;</li> <li>- подготовка к промежуточной аттестации.</li> </ul>
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 три дня эффективнее всего использовать для повторения и систематизации материала.