

Документ подписан простой электронной подписью.
Информация о владельце:

ФИО: Кандрашина Елена Александровна

Должность: И.о. ректора ФГАОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 12.08.2025 11:06:46

Уникальный программный ключ:

2db64eb9605ce27edd3b8e8fdd32c70e0674ddd2

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный экономический университет»

Институт Институт национальной и мировой экономики

Кафедра Экономической теории

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета

(протокол № 10 от 22 мая 2025 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Наименование дисциплины Б1.О.35 Технический анализ финансовых рынков

Основная профессиональная образовательная программа 09.03.03 Прикладная информатика программа
Информационные системы на финансовых рынках

Квалификация (степень) выпускника Бакалавр

Самара 2025

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный экономический университет»**

Институт Институт национальной и мировой экономики
Кафедра Экономической теории

АННОТАЦИЯ

Наименование дисциплины	Б1.О.35 Технический анализ финансовых рынков
Основная профессиональная образовательная программа	09.03.03 Прикладная информатика программа Информационные системы на финансовых рынках

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный экономический университет»**

Институт Институт национальной и мировой экономики
Кафедра Экономической теории

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета
(протокол № 10 от 22 мая 2025 г.)

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ
ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ**

Наименование дисциплины	Б1.О.35 Технический анализ финансовых рынков
Основная профессиональная образовательная программа	09.03.03 Прикладная информатика программа Информационные системы на финансовых рынках

Содержание (рабочая программа)

Стр.

- 1 Место дисциплины в структуре ОП
- 2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 3 Объем и виды учебной работы
- 4 Содержание дисциплины
- 5 Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины
- 6 Фонд оценочных средств по дисциплине

Содержание (ФОС)

Стр.

- 6.1 Контрольные мероприятия по дисциплине
- 6.2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 6.3 Паспорт оценочных материалов
- 6.4 Оценочные материалы для текущего контроля
- 6.5 Оценочные материалы для промежуточной аттестации
- 6.6 Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

Целью изучения дисциплины является формирование результатов обучения, обеспечивающих достижение планируемых результатов освоения образовательной программы.

1. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Технический анализ финансовых рынков входит в обязательную часть блока Б1. Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Технологии цифровой экономики, Основы алгоритмизации и программирования, Эконометрика, Современные технологии и языки программирования, Фундаментальный анализ на финансовых рынках, Финансовый рынок, Рынок ценных бумаг, Международные финансовые отношения, Международные экономические организации, Финансовые технологии и инструменты, Хранение, обработка и анализ данных

Последующие дисциплины по связям компетенций: Проектирование информационных систем, Портфельное инвестирование

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Изучение дисциплины Технический анализ финансовых рынков в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Общепрофессиональные компетенции (ОПК):

ОПК-2 - Способен понимать принципы работы современных информационных технологий и программных средств, в том числе отечественного производства, и использовать их при решении задач профессиональной деятельности

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ОПК-2	ОПК-2.1: Знать:	ОПК-2.2: Уметь:	ОПК-2.3: Владеть (иметь навыки):
	принципы работы современных информационных технологий и программных средств	применять современные информационные технологии и программные средства, в том числе отечественного производства, и использовать их при решения задач профессиональной деятельности	навыками применения современных информационных технологий и программных средств, использования их при решения задач профессиональной деятельности

ОПКЭ-5 - Способен использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ОПКЭ-5	ОПКЭ-5.1: Знать:	ОПКЭ-5.2: Уметь:	ОПКЭ-5.3: Владеть (иметь навыки):
	инструментальные средства для обработки данных в соответствии с поставленной задачей,	осуществлять обработку данных, связанных с профессиональной задачей, с помощью избранных	методами выбора инструментальных средств для обработки данных; методикой расчетов

	методы и анализа результатов расчетов и способы обоснования полученных выводов	средств, анализировать информацию, результаты расчетов, обосновывать полученные выводы	экономических показателей, приемами обоснования полученных результатов при расчетах экономических данных
--	--	--	--

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-5 - Способен осуществлять мониторинг и анализ конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков и подбирать в интересах клиента финансовые услуги и продукты

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-5	ПК-5.1: Знать:	ПК-5.2: Уметь:	ПК-5.3: Владеть (иметь навыки):
	основы финансового консультирования клиентов по ограниченному кругу финансовых продуктов	осуществлять анализ конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков	навыками мониторинга конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков и подбирать в интересах клиента финансовые услуги и продукты

3. Объем и виды учебной работы

Учебным планом предусматриваются следующие виды учебной работы по дисциплине:

Очная форма обучения

Виды учебной работы	Всего час/ з.е.
	Сем 6
Контактная работа, в том числе:	56.3/1.56
Занятия семинарского типа	54/1.5
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.3/0.01
Групповая контактная работа (ГКР)	2/0.06
Самостоятельная работа:	53.7/1.49
Промежуточная аттестация	34/0.94
Вид промежуточной аттестации: Экзамен	Экз
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	144
Зачетные единицы	4

4. Содержание дисциплины

4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Технический анализ финансовых рынков представлен в таблице.

Разделы, темы дисциплины и виды занятий

Очная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контактная работа				Самостоятельная работа	Планируемые результаты обучения в
		Занятия	ИКР	ГКР	СР		

		семинарского типа				соотношении с результатами обучения по образовательной программе
		Практич. занятия				
1.	Графический технический анализ: понятие, постулаты, область применения	26			23,7	ОПК-2.1, ОПК-2.2, ОПК-2.3, ОПКЭ- 5.1, ОПКЭ-5.2, ОПКЭ-5.3, ПК-5.1, ПК-5.2, ПК-5.3
2.	Количественный технический анализ: понятие индикатора, виды, принципы построения и использования	28			30	ОПК-2.1, ОПК-2.2, ОПК-2.3, ОПКЭ- 5.1, ОПКЭ-5.2, ОПКЭ-5.3, ПК-5.1, ПК-5.2, ПК-5.3
	Контроль	34				
	Итого	54	0.3	2	53.7	

4.2 Содержание разделов и тем

4.2.1 Контактная работа

Тематика занятий семинарского типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия семинарского типа**	Тематика занятия семинарского типа
1.	Графический технический анализ: понятие, постулаты, область применения	практическое занятие	Основные понятия, постулаты и предпосылки технического анализа
		практическое занятие	Техническое и инфраструктурное сопровождение процесса интернет-трейдинга
		практическое занятие	Маржинальная торговля: возможности и риски. Риск-менеджмент в интернет-трейдинге
		практическое занятие	Брокерский торговый терминал на примере Quik
		практическое занятие	Торговые приказы: рыночные, лимитированные, стоп-приказы (stop-loss, take-profit)
		практическое занятие	Основные положения и допущения технического анализа. Классификация методов технического анализа
		практическое занятие	Основные понятия графического анализа ценных бумаг. Параметры рынка ценных бумаг: цена и объём
		практическое занятие	Графическое отображение параметров рынка ценных бумаг. Правила построения графиков и гистограмм
		практическое занятие	Тенденции и тренды на биржевых графиках и принципы их выявления: понятие, виды, графическое отображение
		практическое занятие	Графические фигуры как метод

			технического анализа
		практическое занятие	Основные предпосылки и правила построения графических фигур, и их применение в техническом анализе
		практическое занятие	Фигуры продолжения тенденции. Фигуры разворота тенденции. Фигуры неопределенности
		практическое занятие	Достоинства и недостатки методов графического анализа
2.	Количественный технический анализ: понятие индикатора, виды, принципы построения и использования	практическое занятие	Индикаторы как метод технического анализа. Понятие индикатора.
		практическое занятие	Скользящие средние как основной вид трендовых индикаторов: правила построения скользящих средних и их интерпретация
		практическое занятие	Вспомогательные индикаторы и их применение: индикаторы объёма, индикаторы рынка
		практическое занятие	Достоинства, недостатки и область применения индикаторов в техническом анализе
		практическое занятие	Осцилляторы как метод технического анализа. Понятие осциллятора. Основные предпосылки построения осцилляторов
		практическое занятие	Основные виды осцилляторов и их интерпретация: Momentum, RSI, Stochastic, MACD
		практическое занятие	Достоинства, недостатки и область применения осцилляторов
		практическое занятие	Специальные методы технического анализа ценных бумаг. Индикаторы Фибоначчи: понятие и применение
		практическое занятие	Волновая теория Р. Эллиотта: основные понятия, принципы выявления, численные соотношения
		практическое занятие	Теория Ганна и ее применение в техническом анализе
		практическое занятие	Методы «крестики-нолики» и «японские свечи» как альтернатива методам графического анализа ценных бумаг
		практическое занятие	Психологические методы технического анализа
		практическое занятие	Понятие торговой системы в интернет-трейдинге
		практическое занятие	Построение механической торговой системы на основе индикатора

** семинары, практические занятия, практикумы, лабораторные работы, коллоквиумы и иные аналогичные занятия

Иная контактная работа

При проведении учебных занятий СГЭУ обеспечивает развитие у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств (включая при необходимости проведение интерактивных лекций, групповых дискуссий, ролевых игр, тренингов, анализ ситуаций и имитационных моделей, преподавание дисциплин (модулей) в форме курсов, составленных на основе результатов научных исследований, проводимых организацией, в том числе с учетом региональных особенностей профессиональной деятельности выпускников и потребностей работодателей).

Формы и методы проведения иной контактной работы приведены в Методических указаниях по основной профессиональной образовательной программе.

4.2.2 Самостоятельная работа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид самостоятельной работы ***
1.	Графический технический анализ: понятие, постулаты, область применения	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование
2.	Количественный технический анализ: понятие индикатора, виды, принципы построения и использования	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование

*** самостоятельная работа в семестре, написание курсовых работ, докладов, выполнение контрольных работ

5. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

5.1 Литература:

Основная литература

1. Щеголева, Н. Г. Технологии и финансовые инновации: учебник для вузов / Н. Г. Щеголева. — Москва: Издательство Юрайт, 2024. — 81 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16353-7. — Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/544459>

2. Гусева, И. А. Финансовые рынки и институты: учебник и практикум для вузов / И. А. Гусева. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2024. — 344 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16872-3. — Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/536731>

3. Розанова, Н. М. Теория денег и кредита: учебник для вузов / Н. М. Розанова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2024. — 321 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16458-9. — Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/537647>

Дополнительная литература

1. Рынок ценных бумаг: учебник для вузов / Н. И. Берзон [и др.]; под общей редакцией Н. И. Берзона. — 5-е изд., перераб. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2024. — 514 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-11196-5. — Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/535435>

2. Михайленко, М. Н. Финансовые рынки и институты: учебник для вузов / М. Н. Михайленко. — 3-е изд., перераб. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2024. — 351 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16945-4. — Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/535885>

3. Деньги, кредит, банки. Финансовые рынки: учебник для вузов / С. Ю. Янова [и др.]; под редакцией С. Ю. Яновой. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2024. — 591 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16459-6. — Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/544920>

Литература для самостоятельного изучения

1. Мэрфи Джон Дж. Технический анализ фьючерсных рынков: теория и практика. Пер с англ.

- М., «Диаграмма», 2002.

2. Швагер Джек. Технический анализ. Пер с англ. - М., Альпина Бизнес Букс, 2011.

3. Демарк Томас Р. Технический анализ – новая наука. Пер с англ. - М., «Диаграмма», 2001.

4. Колби Роберт. Энциклопедия технических индикаторов рынка. Пер с англ. - М.: Альпина Бизнес Букс, 2010.

5. ЛеБо Ч., Лукас Д.В. Компьютерный анализ фьючерсных рынков. Пер. с англ. - 2-е изд. – М.: Альпина бизнес букс, 2006.

6. Лука Корнелиус. Применение технического анализа на мировом валютном рынке Forex., Пер с англ. - М.: ИД «Евро», 2003.

7. Моррис Грегори Л. Японские свечи: Метод анализа акций и фьючерсов, проверенный временем. Пер с англ. - М., Альпина Бизнес Букс, 2011.

8. Мэрфи Джон Дж. Межрыночный технический анализ. Пер с англ. -Диаграмма, 1999

9. Найман Эрик. Малая энциклопедия трейдера. Пер с англ. - М., Альпина Бизнес Букс, 2011.

10. Нисон Стив. Японские свечи: графический анализ финансовых рынков. Пер с англ. - М.: «Диаграмма», 1998. Пректер Роберт, А. Дж. Фрост.

11. Волновой принцип Эллиотта. Ключ к пониманию рынка. Пер с англ. - М.: Альпина Бизнес Букс, 2011.

12. Фишер Ричард. Трейдинг по Фибоначчи. Практические приемы и методы. Пер с англ. – М.: Евро 2009.

13. Элдер Александр. Как играть и выигрывать на бирже. Психология. Технический анализ. Контроль над капиталом. Пер с англ. - М.: «Диаграмма», 2001.

Аппель Джеральд "Технический анализ. Эффективные инструменты для активного инвестора". Пер с англ. – М.: Питер. 2007

5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения

1. Astra Linux Special Edition «Смоленск», «Орел»; РедОС ; ОС "Альт Рабочая станция" 10; ОС "Альт Образование" 10

2. МойОфис Стандартный 2, МойОфис Образование, Р7-Офис Профессиональный, МойОфис Стандартный 3, МойОфис Профессиональный 3

5.3 Современные профессиональные базы данных, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Профессиональная база данных «Информационные системы Министерства экономического развития Российской Федерации в сети Интернет» (Портал «Официальная Россия» - <http://www.gov.ru/>)

2. Государственная система правовой информации «Официальный интернет-портал правовой информации» (<http://pravo.gov.ru/>)

3. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/ru/>)

4. Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики - <http://www.gks.ru/>)

5.4. Информационно-справочные системы, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Справочно-правовая система «Консультант Плюс»

2. Справочно-правовая система «ГАРАНТ-Максимум»

5.5. Специальные помещения

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран
Учебные аудитории для проведения практических занятий (занятий семинарского типа)	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска

	Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для самостоятельной работы	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для хранения и профилактического обслуживания оборудования	Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования

5.6 Лаборатории и лабораторное оборудование

6. Фонд оценочных средств по дисциплине Технический анализ финансовых рынков:

6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

Вид контроля	Форма контроля	Отметить нужное знаком « + »
Текущий контроль	Оценка докладов	+
	Устный/письменный опрос	+
	Тестирование	+
	Практические задачи	+
Промежуточный контроль	Экзамен	+

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования; Положением о балльно-рейтинговой системе оценки успеваемости обучающихся по основным образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры в федеральном государственном автономном образовательном учреждении высшего образования «Самарский государственный экономический университет».

6.2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Общепрофессиональные компетенции (ОПК):

ОПК-2 - Способен понимать принципы работы современных информационных технологий и программных средств, в том числе отечественного производства, и использовать их при решении задач профессиональной деятельности

Планируемые	Планируемые результаты обучения по дисциплине
-------------	---

результаты обучения по программе			
	ОПК-2.1: Знать:	ОПК-2.2: Уметь:	ОПК-2.3: Владеть (иметь навыки):
	принципы работы современных информационных технологий и программных средств	применять современные информационные технологии и программные средства, в том числе отечественного производства, и использовать их при решения задач профессиональной деятельности	навыками применения современных информационных технологий и программных средств, использования их при решения задач профессиональной деятельности
Пороговый	основные виды инструментальных и программных средств, используемых для обработки экономических данных	анализировать результаты расчетов, полученных с использованием инструментальных и программных средств и проведенных в соответствии с поставленной экономической проблемой, и приводить обоснование полученных выводов	навыками выбора инструментальных и программных средств для анализа экономических данных, обоснования выводов
Стандартный (в дополнении к пороговому)	основные возможности, предоставляемые современными информационно-коммуникационными технологиями для решения стандартных задач профессиональной деятельности с учетом основных требований информационной безопасности	применять информационно-коммуникационные технологии с учетом основных требований информационной безопасности	навыками применения информационно-коммуникационных технологий с учетом основных требований информационной безопасности
Повышенный (в дополнении к пороговому, стандартному)	информационные процессы профессиональной деятельности; основы теории, нормативную базу и пути формирования информационной и цифровой культуры	решать стандартные экономические задачи, используя доступные информационные базы данных, практикумы и современные электронно-информационные программные продукты; осуществлять самодиагностику уровня профессиональной информационной компетентности	практическими навыками решения стандартных экономических задач с применением современных информационно-коммуникационных технологий и с учетом требований информационной безопасности; методами повышения уровня информационной культуры для решения задач профессиональной деятельности

ОПКЭ-5 - Способен использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ОПКЭ-5.1: Знать:	ОПКЭ-5.2: Уметь:	ОПКЭ-5.3: Владеть (иметь навыки):
	инструментальные средства для обработки данных в соответствии с поставленной задачей, методы и анализа результатов расчетов и способы обоснования полученных выводов	осуществлять обработку данных, связанных с профессиональной задачей, с помощью избранных средств, анализировать информацию, результаты расчетов, обосновывать полученные выводы	методами выбора инструментальных средств для обработки данных; методикой расчетов экономических показателей, приемами обоснования полученных результатов при расчетах экономических данных
Пороговый	общие понятия о способах и методах решения вычислительных задач с помощью информационных технологий; некоторые программные продукты, используемые для профессиональных расчетов в научных исследованиях	пользоваться основными прикладными программами; самостоятельно расширять и углублять знания в области профессионально-ориентированных информационных технологий, применять программные продукты для обработки данных и информации	практическим опытом использования информационных и сетевых технологий для получения, обработки и распространения информации и данных
Стандартный (в дополнении к пороговому)	базовые способы и методы решения вычислительных задач с помощью информационных технологий; ключевые концепции современных информационных технологий для проведения научных расчетов	решать задачи, требующие применения методов и алгоритмов информационных технологий, осуществлять обработку и анализ информации и представлять результаты расчетов в наглядной графической форме	навыками применения ресурсов Интернет для получения и публикации информации по исследовательской тематике
Повышенный (в дополнении к пороговому, стандартному)	разнообразные способы и методы решения вычислительных задач с помощью информационных технологий; систему ключевых концепций современных информационных технологий, как общих, так и специфических для области научных исследований	выбирать адекватные поставленной задаче алгоритмы процедурного и функционального программирования; осуществлять обработку и анализ информации, выполнять расчеты и представлять результаты расчетов в наглядной графической форме, используя профессиональные программные продукты	навыками работы в разнообразных профессиональных программных средах; средствами и приемами процедурного и функционального программирования

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-5 - Способен осуществлять мониторинг и анализ конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков и подбирать в интересах клиента

финансовые услуги и продукты

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ПК-5.1: Знать:	ПК-5.2: Уметь:	ПК-5.3: Владеть (иметь навыки):
	основы финансового консультирования клиентов по ограниченному кругу финансовых продуктов	осуществлять анализ конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков	навыками мониторинга конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков и подбирать в интересах клиента финансовые услуги и продукты
Пороговый	теоретические аспекты процедуры консультирования клиентов при совершении финансовых операций	оценивать емкость спроса при оценке рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков	методиками оценки инвестиционной привлекательности финансовых продуктов на рынке банковских услуг, рынке ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынках
Стандартный (в дополнении к пороговому)	методики оценки риск-профиля клиента при его финансовом консультировании	оценивать инвестиционную привлекательность финансовых продуктов на рынке банковских услуг, рынке ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынках	навыками мониторинга конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков
Повышенный (в дополнении к пороговому, стандартному)	методики разрешения конфликтов интересов с клиентом в процессе их консультирования по ограниченному кругу финансовых продуктов	анализировать конъюнктуру рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков	навыками подбора в интересах клиента финансовых услуг и продуктов

6.3. Паспорт оценочных материалов

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контролируемые планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по программе	Вид контроля/используемые оценочные средства	
			Текущий	Промежуточный
1.	Графический технический анализ: понятие, постулаты, область применения	ОПК-2.1, ОПК-2.2, ОПК-2.3, ОПКЭ-5.1, ОПКЭ-5.2, ОПКЭ-5.3, ПК-5.1, ПК-5.2, ПК-5.3	- доклад - тестирование - практические задания	Экзамен
2.	Количественный	ОПК-2.1, ОПК-2.2,	- доклад	Экзамен

технический анализ: понятие индикатора, виды, принципы построения и использования	ОПК-2.3, ОПКЭ-5.1, ОПКЭ-5.2, ОПКЭ-5.3, ПК-5.1, ПК-5.2, ПК-5.3	- тестирование - практические задания	
---	---	---	--

6.4.Оценочные материалы для текущего контроля

Примерная тематика докладов

Раздел дисциплины	Темы
Графический технический анализ: понятие, постулаты, область применения	1. История развития и сущность технического анализа 2. Интернет-трейдинг: инфраструктурные, программные и цифровые принципы 3. Участники фондового рынка и их роль в формировании курсов ценных бумаг 4. Информационная база анализа рынка ценных бумаг 5. Рыночные гуру 6. Быки и медведи – участники биржевой игры 7. Психология трейдинга 8. Поведение толпы в ходе биржевых торгов 9. Как играть и выигрывать на фондовой бирже 10. Торговая стратегия трейдера 11. Числа Фибоначчи и их математическое обоснование 12. Теория Доу и биржевые индексы Доу-Джонса 13. Волновые принципы Эллиота 14. Цикличность тенденций на фондовом рынке 15. Принятие инвестиционных решений на основе графического анализа 16. Японские свечи – традиции восточной биржевой торговли 17. Метод графического анализа «крестики-нолики» 18. Формирование цены ценной бумаги 19. Виды трендов и их характеристика
Количественный технический анализ: понятие индикатора, виды, принципы построения и использования	20. Численные индикаторы технического анализа 21. Практическое использование метода скользящих средних в техническом анализе 22. Осцилляторы и их практическое применение 23. Характеристические индикаторы 24. Торговые стратегии трейдеров и механические торговые системы 25. Применение методов технического анализа на российском биржевом рынке ценных бумаг 26. Портфельное инвестирование и риски, связанные с ним 27. Формирование инвестиционного портфеля и управление им 28. Снижение риска при формировании портфеля ценных бумаг 29. Оптимизация инвестиционного портфеля ценных бумаг 30. Доходность, как важнейшая характеристика инвестиционного портфеля 31. Портфель ценных бумаг, как товар на фондовом рынке 32. Цикличность рынка: Теория Доу, волновой принцип Эллиота 33. Методы расчета индексов: среднеарифметической, среднеарифметической взвешенной и средней геометрической 34. Конвергенция - Дивергенция. Графическая интерпретация 35. Осцилляторы: преимущества и недостатки. Интерпретация сигналов 36. Характеристические индикаторы: Баланс объема, индикатор Чайкина

	37. Диверсификация и хеджирование 38. Построение механических торговых систем
--	--

Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций (min 20, max 50 + ссылку на ЭИОС с тестами)

укажите задания

Укажите, какие программные продукты не относятся к брокерским торговым терминалам

- SMARTx
- Transaq
- FinamTrade
- Тинькофф Инвестиции
- +нет правильного ответа

Укажите, какому требованию не должна соответствовать цифровая торговая платформа

- прием торговой информации от биржевых серверов в реальном времени
- обработка и предоставление участникам торгов биржевой информации без искажений и в удобном виде
- мгновенное формирование торговых заявок клиента и трансляция их на биржевые сервера без искажений
- +поступление торговых заявок на биржевой сервер с максимальными задержками

Укажите группу торгового софта, не относящегося к признакам классификации по используемым аппаратно-программным платформам

- десктоп
- мобильные терминалы
- веб-терминалы
- +стационарные терминалы

Торговый софт, который устанавливается на стационарные компьютеры и ноутбуки, работает под управлением операционных систем для ПК, используемый профессиональными инвесторами и трейдерами – это

- мобильный терминал
- + десктоп
- веб-терминал

За последние семь дней торгов значения фондового индекса составили 13, 12, 10, 13, 14, 16, 17. Каким будет значение 5-дневной простой скользящей средней для последнего дня торгов?

- +14
- 14,5
- 15
- 16,4

При каком из приведенных ниже сигналов индекса относительной силы можно ожидать падения цен в ходе развития повышательного тренда?

- индекс образует "бычью" дивергенцию с графиком цен
- +индекс поднялся выше 70 %-ной отметки
- индекс опустился ниже 30 %-ной отметки
- индекс достиг уровня сопротивления на отметке 50 %

Технический анализ изучает:

- причины, вызывающие изменения цены
- +закономерности изменения цены вне зависимости от причин, вызывающих эти изменения

- влияние макроэкономических индикаторов на поведение цены
- технику совершения сделок

Индикатор Stochastic является:

- индикатором-фильтром
- трендовым индикатором
- +осциллятором
- нет правильного ответа

Какой анализ основывается на оценке цен и объемов торгов ценных бумаг:

- +технический
- статистический
- фундаментальный
- экономический

Какой из графиков технического анализа показывает максимальные и минимальные цены за торговую сессию:

- +график баров
- гистограмма
- линейный график
- столбиковая диаграмма

Индикатор скользящей средней является:

- опережающим индикатором;
- двойственным индикатором;
- +трендоследящим индикатором
- не является индикатором технического анализа

Как в техническом анализе называют верхнюю границу диапазона колебаний цен:

- +уровнем сопротивления
- уровнем поддержки
- каналом
- трендом

Какие из нижеперечисленных формаций указывают на возможность продолжения восходящей ценовой тенденции:

- медвежий клин
- +флаг
- двойное основание
- двойная вершина

В число организаций, обслуживающих функционирование рынка ценных бумаг, не входят:

- +брокеры
- депозитарии
- регистраторы
- расчетные центры

Имеется 10 разных акций. Инвестор хотел бы построить портфель из трех акций, включив каждую из них по одной штуке. Сколько вариантов портфелей может сформировать инвестор?

- +120
- 30
- 90

Маркет-мейкерами могут быть:

- +брокеры, дилеры, управляющие
- юридическое лицо или индивидуальный предприниматель, имеющие лицензию на осуществление профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг

- эмитенты
- брокеры и депозитарии

Какие действия не соответствуют понятию «манипулирование ценами»?

- распространение ложной и недостоверной информации
- +распространение правдивой и достоверной информации
- совершение сделок с ценными бумагами на торгах фондовой биржи, в результате которых не меняется владелец ценных бумаг
- одновременное выставление поручений на покупку и продажу ценных бумаг по ценам, имеющим существенное отклонение от текущих рыночных цен по аналогичным сделкам

Уровень маржи для направления требования о внесении клиентом денежных средств или ценных бумаг, в размере, достаточном для увеличения уровня до ограничительного составляет:

- 25 %, если более высокий уровень не установлен в договоре с клиентом
- 35%
- +35 %, если более высокий уровень не установлен в договоре с клиентом
- 35 %, если более низкий уровень не установлен в договоре с клиентом

На момент направления брокером требования о внесении клиентом денежных средств или ценных бумаг в размере, достаточном для увеличения уровня до ограничительного уровня маржи, задолженность клиента перед брокером составляла 2000000 рублей и уровень маржи был равен 34,5 %. Определите величину обеспечения клиента.

- +2290076 руб.
- 2550076 руб.
- 2770076 руб.
- 2690000 руб.

После перечисления клиентом по требованию брокера 1000000 рублей на специальный брокерский счет, величина обеспечения стала равна 4500000 рублей и уровень маржи стал равным ограничительному уровню маржи. Определите величину задолженности клиента перед брокером, возникшую в результате заключения в интересах клиента маржинальных сделок.

- + 3 млн. руб.
- 3,3 млн. руб.
- 3,9 млн. руб.
- 4 млн. руб.

Практические задачи (min 20, max 50 + ссылку на ЭИОС с электронным изданием, если имеется)

Раздел дисциплины	Задачи
Графический технический анализ: понятие, постулаты, область применения	<i>Каждая практическая работа выполняется самостоятельно каждым студентом. Форма представления – единый файл в формате PDF с графиками, на которых выполнено графическое задание, осуществлены все необходимые построения и отмечены соответствующие торговые сигналы.</i> Практическая работа №1 «Анализ биржевого графика А) «Линия тренда, линия канала, линия двойного канала (построить и для восходящей, и для нисходящей тенденции на графике любой акции и любого таймфрейма), уровень поддержки и уровень сопротивления». В) «Инструменты по Фибоначчи» (измерить на растущем и на падающем рынке глубину коррекции посредством Уровней Фибоначчи, Веера Фибоначчи, Дуг Фибоначчи, а также построить Временные зоны Фибоначчи). С) «Волновой анализ» (найти, отложить и измерить

	волны Эллиотта на растущем и падающем рынках). Практическая работа №2 «Графические модели» А) «Графические модели перелома» (найти и построить на графиках цены и объема на дневном тайм-фрейме следующие модели): 1. Модели перелома: 1. Голова-плечи, 2. Кратные вершины и основания (т.е. двойная или тройная вершина, двойное или тройное основание); 3. Неудавшийся размах; 4. Шип или V-образный перелом; 5. Клин; 6. Расширяющаяся формация; 7. Блюдце или Крышка (если найдете, редкие). (На всех моделях следует указать графические границы и отложить ценовой ориентир!!! Отметить вход в позицию, уровень Stop-loss и Take-profit. В) «Модели продолжения тенденции и модели неопределенности» (найти и построить на графиках цены и объема на дневном тайм-фрейме следующие модели): 1. Флаг; 2. Вымпел; 3. Клин; 4. Прямоугольник; 5. Треугольник; 6. Ромб(алмаз). (На всех моделях следует указать графические границы и отложить ценовой ориентир!!! Отметить вход в позицию, уровень Stop-loss и Take-profit.
Количественный технический анализ: понятие индикатора, виды, принципы построения и использования	Практическая работа №3 «Трендовые индикаторы» 1. МА, 2. Комбинация 2-х МА, 3. Alligator, 4. ADX, 5. Полосы Боллинджера. <i>Указываете, где нужно открыть и закрыть Long и открыть и закрыть Short на каждом индикаторе.</i> Практическая работа №4 «Осцилляторы» 1. Momentum, 2. RSI, 3. Stochastic, 4. MACD. <i>Указываете, где это нужно, конвергенцию и дивергенцию и все возможные по осциллятору сигналы к покупке и продаже, то есть, где нужно открыть и закрыть Long и открыть и закрыть Short на каждом осцилляторе.</i>

6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме экзамена

Раздел дисциплины	Вопросы
Графический технический анализ: понятие, постулаты, область применения	1. Понятие интернет-трейдинга: возможности, техническое и программное обеспечение 2. Брокерские торговые терминалы на примере «QUIK» 3. Специализированные программы по техническому анализу на примере «MetaStock» 4. Понятие и основные аксиомы, и постулаты технического анализа. 5. Основные положения теории Чарльза Доу 6. Классификация методов технического анализа 7. Параметры биржевого финансового рынка: цена и объём 8. Графическое отображение параметров биржевого рынка: графики и гистограммы и правила их построения 9. Понятие тенденции. Основные виды тенденций 10. Графическое отображение тенденции. Растущий, падающий и боковой рынки 11. Линии тенденции и методы их построения 12. Коридоры и каналы. Уровни и линии поддержки и сопротивления 13. Показатели оценки силы тенденции. Виды пробелов и их интерпретация 14. Понятие графической фигуры. Состоявшиеся и несостоявшиеся фигуры

	15. Основные предпосылки построения фигур и их применение в анализе ценных бумаг 16. Фигуры разворота тенденции: «голова и плечи», двойные и тройные вершины и основания, «блюдец», «шип», «клин» 17. Фигуры продолжения тенденции: «флаг», «вымпел», «прямоугольник», «клин». Фигуры неопределенности: треугольники, алмазы 18. Достоинства и недостатки методов графического анализа
Количественный технический анализ: понятие индикатора, виды, принципы построения и использования	19. Понятие индикатора. Основные предпосылки построения индикаторов. 20. Основные правила разработки индикаторов. 21. Скользящие средние значения как основной вид индикаторов. 22. Правила построения скользящих средних. Интерпретация скользящих средних. 23. Вспомогательные индикаторы и их применение. Индикаторы объёма. Индикаторы рынка. 24. Достоинства, недостатки и область применения индикаторов. 25. Понятие осциллятора. Основные предпосылки построения осцилляторов. 26. Основные правила разработки осцилляторов. 27. Основные виды осцилляторов и их интерпретация. 28. Достоинства и недостатки осциллятора «индекс относительной силы». 29. Достоинства и недостатки осциллятора «Моментум». 30. Достоинства и недостатки стохастического осциллятора. 31. Достоинства и недостатки осциллятора «MACD». 32. Достоинства, недостатки и область применения осцилляторов. 33. Волновая теория Эллиотта. Основные понятия, принципы выявления, численные соотношения. 34. Числа Фибоначчи: понятие и применение в техническом анализе. 35. Теория Ганна. Основные понятия, принципы выявления, численные соотношения. 36. Метод «крестики-нолики» как альтернатива методам графического анализа ценных бумаг. 37. Метод «японские свечи». Основные понятия, модели и их значения. 38. Торговые системы: основные принципы построения 39. Стратегия автоследования: преимущества и недостатки 40. Механические торговые системы и торговые роботы: принципы и алгоритмы построения

6.6. Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

Шкала и критерии оценивания

Оценка	Критерии оценивания для мероприятий контроля с применением 4-х балльной системы
«отлично»	Повышенный ОПК-2.1, ОПК-2.2, ОПК-2.3, ОПКЭ-5.1, ОПКЭ-5.2, ОПКЭ-5.3, ПК-5.1, ПК-5.2, ПК-5.3
«хорошо»	Стандартный ОПК-2.1, ОПК-2.2, ОПК-2.3, ОПКЭ-5.1, ОПКЭ-5.2, ОПКЭ-5.3, ПК-5.1, ПК-5.2, ПК-5.3
«удовлетворительно»	Пороговый ОПК-2.1, ОПК-2.2, ОПК-2.3, ОПКЭ-5.1, ОПКЭ-5.2, ОПКЭ-5.3, ПК-5.1, ПК-5.2, ПК-5.3
«неудовлетворительно»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне