

Документ подписан простой электронной подписью.
Информация о владельце:

ФИО: Кандрашина Елена Александровна

Должность: Врио ректора ФГАОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 22.06.2023 16:19:59

Уникальный программный ключ:

b2fd765521f4c570b8c6e8e502a10b4f1de8ae0d

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 Мировой экономики

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета

(протокол № 11 от 30 мая 2023 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

| | |
|--|--|
| Наименование дисциплины | Б1.В.15 Практикум по мировому фондовому рынку |
| Основная профессиональная образовательная программа | 38.03.01 Экономика программа Мировая экономика и международные отношения |

Квалификация (степень) выпускника Бакалавр

Самара 2023

**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 Мировой экономики

АННОТАЦИЯ

Наименование дисциплины Б1.В.15 Практикум по мировому фондовому рынку

Основная профессиональная образовательная программа 38.03.01 Экономика программа Мировая экономика и международные отношения

**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 Мировой экономики

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета

(протокол № 11 от 30 мая 2023 г.)

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ
ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ**

Наименование дисциплины Б1.В.15 Практикум по мировому фондовому рынку

Основная профессиональная образовательная программа 38.03.01 Экономика программа Мировая экономика и международные отношения

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 Практикум по мировому фондовому рынку входит в часть, формируемая участниками образовательных отношений блока Б1. Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Консультационный проект, Мировая экономика и международные отношения, Анализ и прогнозирование мировых рынков, Экономика транснациональных корпораций, Международное право и внешнеторговый контракт, Цифровая трансформация мировой экономики, Электронная коммерция на мировых рынках, Организация и техника внешнеторговых операций, Деловой протокол, этика и межкультурные коммуникации, Деловой иностранный язык, Технологии работы в социальных сетях, Информационно-коммуникационные технологии в профессиональной деятельности

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

Изучение дисциплины Практикум по мировому фондовому рынку в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-4 - Способен на основе отечественных и зарубежных источников информации анализировать и выявлять макроэкономические тенденции и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений, в том числе по вопросам финансирования внешнеэкономических сделок

| Планируемые результаты обучения по программе | Планируемые результаты обучения по дисциплине | | |
|--|--|--|---|
| ПК-4 | ПК-4.1: Знать: | ПК-4.2: Уметь: | ПК-4.3: Владеть (иметь навыки): |
| | отечественные и зарубежные источники информации для анализа и выявления макроэкономических тенденций | эффективно использовать отечественные и зарубежные источники информации для анализа и выявления макроэкономических тенденций | навыками принятия управленческих решений, в том числе по вопросам финансирования внешнеэкономических сделок |

ПК-2 - Способен готовить документацию для заключения внешнеэкономической сделки, осуществлять ее организационное сопровождение, мониторинг и контроль исполнения обязательств по внешнеэкономическим контрактам

| Планируемые результаты обучения по программе | Планируемые результаты обучения по дисциплине | | |
|--|--|---|---|
| ПК-2 | ПК-2.1: Знать: | ПК-2.2: Уметь: | ПК-2.3: Владеть (иметь навыки): |
| | методы разработки внешнеторгового контракта, методы организации и оценки рекламно-выставочной деятельности, формирования перечня потенциальных партнеров, подготовки проекта внешнеторгового | разработать проект внешнеторгового контракта, организационные мероприятия проведения рекламной компании | способами проведения предварительного анализа целесообразности участия в выставочно ярмарочных и конгрессных мероприятиях за рубежом в целях привлечения потенциальных партнеров; способами формирования списка потенциальных партнеров |

| | | | |
|--|-----------|--|--|
| | контракта | | для заключения внешнеторгового контракта; способами формирования проекта внешнеторгового контракта |
|--|-----------|--|--|

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 8 |
| Контактная работа, в том числе: | 36.15/1 |
| Занятия семинарского типа | 36/1 |
| Индивидуальная контактная работа (ИКР) | 0.15/0 |
| Самостоятельная работа: | 89.85/2.5 |
| Промежуточная аттестация | 18/0.5 |
| Вид промежуточной аттестации: | |
| Зачет | Зач |
| Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы | 144 |
| Зачетные единицы | 4 |

очно-заочная форма

| Виды учебной работы | Всего час/ з.е. |
|--|-----------------|
| | Сем 9 |
| Контактная работа, в том числе: | 2.15/0.06 |
| Занятия семинарского типа | 2/0.06 |
| Индивидуальная контактная работа (ИКР) | 0.15/0 |
| Самостоятельная работа: | 123.85/3.44 |
| Промежуточная аттестация | 18/0.5 |
| Вид промежуточной аттестации: | |
| Зачет | Зач |
| 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 Практикум по мировому фондовому рынку 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 соотношении с результатами обучения по образовательной программе |
|-------|--|---------------------------|------|-----|------------------------|--|
| | | Занятия семинарского типа | | ИКР | | |
| | | Практич. занятия | ГКР | | | |
| 1. | Биржевая динамика мирового фондового рынка | 16 | 0.07 | | 40 | ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3 |

| | | | | | | |
|----|--|-----------|-------------|--|--------------|--|
| 2. | Технический и фундаментальный анализ на мировом фондовом рынке | 20 | 0.08 | | 49.85 | ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3 |
| | Контроль | 18 | | | | |
| | Итого | 36 | 0.15 | | 89.85 | |

очно-заочная форма

| № п/п | Наименование темы (раздела) дисциплины | Контактная работа | | | Самостоятельная работа | Планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по образовательной программе |
|-------|--|---------------------------|-------------|-----|------------------------|--|
| | | Занятия семинарского типа | | ИКР | | |
| | | Практич. занятия | | | | |
| 1. | Биржевая динамика мирового фондового рынка | 1 | 0,07 | | 55 | ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3 |
| 2. | Технический и фундаментальный анализ на мировом фондовом рынке | 1 | 0,08 | | 68,85 | ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3 |
| | Контроль | 18 | | | | |
| | Итого | 2 | 0.15 | | 123.85 | |

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. | Биржевая динамика мирового фондового рынка | практическое занятие | Основные понятия фондового рынка |
| | | практическое занятие | Фондовая биржа |
| | | практическое занятие | Торговля на Московской бирже |
| | | практическое занятие | Основы риск-менеджмента на фондовом рынке |
| | | практическое занятие | Торговые системы |
| 2. | Технический и фундаментальный анализ на мировом фондовом рынке | практическое занятие | Введение в технический анализ |
| | | практическое занятие | Графический технический анализ |
| | | практическое занятие | Количественный технический анализ |
| | | практическое занятие | Индикаторы |
| | | практическое занятие | Осцилляторы |
| | | практическое занятие | Теория и практика фундаментального анализа |

** 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. | Биржевая динамика мирового фондового рынка | - подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование |
| 2. | Технический и фундаментальный анализ На мировом фондовом рынке | - 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. Гусева, И. А. Финансовые рынки и институты: учебник и практикум для вузов / И. А. Гусева. — Москва: Издательство Юрайт, 2021. — 347 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00339-0. — Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/469564>

Дополнительная литература

1. Деньги, кредит, банки. Финансовые рынки. В 2 ч. Часть 1 : учебник для вузов / С. Ю. Янова [и др.] ; ответственный редактор С. Ю. Янова. — Москва: Издательство Юрайт, 2021. — 299 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-07172-6. — Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/472775>

2. Деньги, кредит, банки. Финансовые рынки. В 2 ч. Часть 2 : учебник для вузов / С. Ю. Янова [и др.] ; ответственный редактор С. Ю. Янова. — Москва: Издательство Юрайт, 2021. — 306 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-07174-0. — Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/474548>

Литература для самостоятельного изучения

1. Мэрфи, Джон Дж. Технический анализ финансовых рынков [Текст] = Technical analysis of the financial markets: A comprehensive guide to trading methods and applications: полный справочник по методам и практике трейдинга. - Пер. с англ. - М.: Вильямс, 2015. - 496 с.; 70x100/16. - Библиогр.: с. 481 -482. - ISBN 978-5-8459-1978-6: Шифры: У 9(7США) - М 97
2. Ключников И.К. Фондовые биржи: вводный курс [электронный ресурс]. Учебное пособие/ -М.: Финансы и статистика, 2013. — 200с. — Режим доступа: <http://ibooks.ru/product.php?productid=335383> ISBN 978-5-279-03338-6
3. Аппель Дж. Эффективные инвестиции. Как зарабатывать на росте и падении акций, инфляции, скачках цен на нефть... и не только[электронный ресурс]/ Пер. с англ. под ред. В.В. Ильина. - СПб.: Питер, 2009. - 416с. - Режим доступа: <http://ibooks.ru/reading.php?productid=21898> ISBN 978-5-91180-949-2
4. Ковел М. Биржевая торговля по трендам. Как заработать, наблюдая тенденции рынка [электронный ресурс] / Пер. с англ. Под ред. В.В. Ильин. – СПб.: питер, 2009. – 352с. - Режим доступа: <http://ibooks.ru/reading.php?productid=21897> ISBN 978-5-91180-755-9
5. Луданов Н.Н. Интуитивный трейдинг [электронный ресурс] / - СПб.: Питер, 2010. – 320с. – Режим доступа: <http://ibooks.ru/reading.php?productid=21662> ISBN 978-5-49807-096-4
6. Солабуто Н.В. Трейдинг: торговые системы и методы [электронный ресурс] / - СПб.: Питер, 2010. – 336с. – Режим доступа: <http://ibooks.ru/reading.php?productid=21755> ISBN 978-5-49807-634-8

5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения

1. Microsoft Windows 10 Education / Microsoft Windows 7 / Windows Vista Business
2. Office 365 ProPlus, Microsoft Office 2019, Microsoft Office 2016 Professional Plus (Word, Excel, Access, PowerPoint, Outlook, OneNote, Publisher) / Microsoft Office 2007 (Word, Excel, Access, PowerPoint)

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

| | |
|--------------|--|
| оборудования | |
|--------------|--|

5.6 Лаборатории и лабораторное оборудование

6. Фонд оценочных средств по дисциплине Практикум по мировому фондовому рынку:

6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

| Вид контроля | Форма контроля | Отметить нужное знаком « + » |
|------------------------|---|---------------------------------------|
| Текущий контроль | Оценка докладов | + |
| | Устный/письменный опрос | - |
| | Тестирование | + |
| | Практические задачи | - |
| | Оценка контрольных работ (для заочной формы обучения) | - |
| Промежуточный контроль | Зачет | + |

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

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-4 - Способен на основе отечественных и зарубежных источников информации анализировать и выявлять макроэкономические тенденции и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений, в том числе по вопросам финансирования внешнеэкономических сделок

| Планируемые результаты обучения по программе | Планируемые результаты обучения по дисциплине | | |
|--|--|--|--|
| | ПК-4.1: Знать: | ПК-4.2: Уметь: | ПК-4.3: Владеть (иметь навыки): |
| | отечественные и зарубежные источники информации для анализа и выявления макроэкономических тенденций | эффективно использовать отечественные и зарубежные источники информации для анализа и выявления макроэкономических тенденций | навыками принятия управленческих решений, в том числе по вопросам финансирования внешнеэкономических сделок |
| Пороговый | Основные методы анализа мирового фондового рынка. | Анализировать во взаимосвязи и использовать источники экономической и управленческой информации. | Современным программным обеспечением, используемым для изучения тенденций развития фондового рынка посредством сбора и обработки первичной |

| | | | |
|--|---|--|--|
| | | | информации. |
| Стандартный (в дополнение к пороговому) | Технологию заключения и исполнения сделок с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами на биржевом и внебиржевом рынке. | Производить анализ фондового рынка, используя отечественные и зарубежные источники информации. | Основными методами обработки, анализа и формулирования результатов по управленческим решениям. |
| Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному) | Порядок эмиссии и механизмы размещения финансовых инструментов на фондовом рынке. | Составлять гражданско-правовые договоры, работать с документами. | Навыками решения проблем в области инвестиционной привлекательности эмитента и устойчивости финансовой организации в условиях рыночной нестабильности и антикризисного управления. |

ПК-2 - Способен готовить документацию для заключения внешнеэкономической сделки, осуществлять ее организационное сопровождение, мониторинг и контроль исполнения обязательств по внешнеэкономическим контрактам

| | | | |
|--|--|--|--|
| Планируемые результаты обучения по программе | Планируемые результаты обучения по дисциплине | | |
| | ПК-2.1: Знать: | ПК-2.2: Уметь: | ПК-2.3: Владеть (иметь навыки): |
| | методы разработки внешнеторгового контракта, методы организации и оценки рекламно-выставочной деятельности, формирования перечня потенциальных партнеров, подготовки проекта внешнеторгового контракта | разработать проект внешнеторгового контракта, организационные мероприятия проведения рекламной компании | способами проведения предварительного анализа целесообразности участия в выставочно ярмарочных и конгрессных мероприятиях за рубежом в целях привлечения потенциальных партнеров; способами формирования списка потенциальных партнеров для заключения внешнеторгового контракта; способами формирования проекта внешнеторгового контракта |
| Пороговый | Основы функционирования мирового фондового рынка. | Анализировать во взаимосвязи и использовать источники экономической и управленческой информации. | Методами комплексного исследования проблем мирового фондового рынка. |
| Стандартный (в дополнение к пороговому) | Теории регулирования мирового фондового рынка, владеть актуальной информацией о стратегиях ЦБ, ФРС, ЕЦБ и других | Анализировать структуру мирового фондового рынка, закономерности и особенности его развития в условиях глобализации мировой экономики. | Навыками проведения аналитических исследований мирового фондового рынка. |

| | | | |
|--|--|---|---|
| | международных финансовых институтов. | | |
| Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному) | Структуру мирового фондового рынка, закономерности и особенности его развития в условиях глобализации мировой экономики. | Использовать знания теории и практики операций на мировом фондовом рынке для выработки и принятия управленческих решений. | Навыками эффективного использования современных информационных технологий анализа данных об особенностях развития мирового фондового рынка. |

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. | Биржевая динамика мирового фондового рынка | ПК-4.1, ПК-4.2, ПК- 4.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3 | Оценка докладов Оценка презентаций Тестирование | Зачет |
| 2. | Технический и фундаментальный анализ на мировом фондовом рынке | ПК-4.1, ПК-4.2, ПК- 4.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3 | Оценка докладов Оценка презентаций Тестирование | Зачет |

6.4. Оценочные материалы для текущего контроля

Примерная тематика докладов

| Раздел дисциплины | Темы |
|--|--|
| Биржевая динамика фондового рынка | <ol style="list-style-type: none"> 1. Календарные циклы фондового рынка. 2. Политические, сезонные и временные циклы: катание на волнах рыночных приливов и отливов. 3. Выбор правильных инвестиционных инструментов. 4. Проблема использования торговых систем на практике. 5. Риск: сравнение вознаграждения между более волатильными и менее волатильными портфелями. |
| Технический и фундаментальный анализ на фондовом рынке | <ol style="list-style-type: none"> 6. Природа, предмет изучения и границы применимости технического анализа. 7. Постулаты и предпосылки технического анализа. 8. Классификация методов и методика анализа графиков. 9. Фундаментальный и технический анализ. 10. Психологические аспекты технического анализа. 11. Методы технического анализа. 12. Конфигурационные методы. 13. Анализ фигур на графиках японских свечей. 14. Фильтрационные методы технического анализа. 15. Скользящие средние: мифы и недоразумения. 16. Осцилляторные методы технического анализа. 17. Корреляционные методы технического анализа. 18. Исследование инструментов технического анализа и выработка рекомендаций их применения на рынке ценных бумаг. 19. Исследование результатов применения методов технического анализа. |

| | |
|--|--|
| | <p>20. Применение методов технического анализа в сочетании с элементами фундаментальных методик.</p> <p>21. Использование скользящих средних для определения четырех стадий рыночного цикла.</p> <p>22. Диаграммы скорости изменения рынка «быков» и рынка «медведей».</p> <p>23. Синергия основных трендов в действии.</p> <p>24. Ложные «пробой» и «провалы»: ключевые рыночные фигуры.</p> <p>25. Отличие «бычьих» и «медвежьих» циклических фигур.</p> |
|--|--|

Вопросы для устного/письменного опроса

| Раздел дисциплины | Вопросы |
|--|---|
| Биржевая динамика фондового рынка | <ol style="list-style-type: none"> 1. Понятие и структура РЦБ. 2. Участники рынка. Фондовые посредники. Инфраструктурные профессиональные участники. 3. Ценные бумаги и их основные виды. Инвестиционные характеристики ценных бумаг. 4. Современные фондовые биржи, механизм торговли, торгуемые инструменты. 5. Налогообложение и стоимость операций на фондовом рынке. Московская Биржа и торговля на ней. 6. Типы торговых приказов. 7. Типы торговых приказов: stop-loss и take-profit. 8. Уровень маржи на рынке ценных бумаг: понятие, назначение, методика расчета. 9. Оценка потенциального риска и дохода. Графический способ входа и выхода из позиции. Условия немедленной ликвидации позиции. 10. Понятие торговой системы (ТС) и ее составные части. 11. Поведение различных категорий игроков при построении торговых систем. 12. Управление капиталом. 13. Психология рынка. |
| Технический и фундаментальный анализ на фондовом рынке | <ol style="list-style-type: none"> 14. Основные постулаты технического анализа. 15. Анализ и прогнозирование рынка с использованием графиков. 16. Тенденция и ее основные характеристики. 17. Линия тренда. Уровни поддержки и сопротивления. 18. Теория Доу (основные постулаты теории Чарльза Доу). 19. Последовательность Фибоначчи. 20. Волновая теория Эллиота. 21. Ценовые пробелы и их типы. 22. Трендовые линии Демарка. Ценовые проекторы. 23. Графические модели. 24. Скользящие средние (МА). Комбинация 2-х МА, комбинация 3-х МА. 25. Схождение-расхождение скользящих средних (MACD). Дивергенция. 26. Индикаторы-конверты: полосы Боллинджера (BB). 27. Осцилляторы и тенденция: проблемы анализа, общие принципы применения. 28. Трендовые и рейнджевые осцилляторы. Построение осцилляторов. 29. Торговля на сигналах осциллятора. |

- | | |
|--|--|
| | <p>30. Понятие и уровни фундаментального анализа.</p> <p>31. Анализ финансовой устойчивости компании-эмитента.</p> <p>32. Макроэкономическая статистика.</p> <p>33. Оценка качеств биржевого актива.</p> |
|--|--|

Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций размещены в ЭИОС СГЭУ, <https://lms2.sseu.ru/course/index.php?categoryid=1793>

Что из перечисленного ниже не относится к принципам технического анализа:

- курс учитывает все
- необходимость учета всех факторов
- цена движется в одном направлении
- история повторяется

Первый фондовый индекс был разработан:

- Милтоном Фридманом
- Доу Джонсом
- Чарльзом Доу
- Джорджем Соросом

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

- график баров
- гистограмма
- линейный график
- столбиковая диаграмма

В качестве брокера могут выступать:

- физические лица
- юридические лица
- и физические и юридические лица
- специальные организации

Утром курс акции равен 100 руб. Инвестор полагает, что к вечеру курс акции может вырасти на 20% с вероятностью 60% или упасть на 30% с вероятностью 40%. Определить математическое ожидание курса акции к концу дня.

- 90
- 100
- 110

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

Технический анализ используется в мировой биржевой практике:

- не более 10 лет;
- не менее 1000 лет;
- не более 50 лет;
- не менее 100 лет.

При пробитии ценой линии поддержки:

- Эта линия становится линией сопротивления
- Цена проходит не менее 50 пунктов
- Линия теряет свое свойство

-Линия становится линией тренда

Фигуры продолжения это:

- методы измерения длительности трендов
- фигуры, выходя из которых цена продолжает двигаться в ту же сторону, в какую она двигалась при входе в фигуру
- методы, позволяющие оценивать продолжительность данного ценового движения
- фигуры, после которых цена меняет направление движения

Фигуры разворота это:

- методы измерения длинны коррекции
- фигуры, выходя из которых цена начинает двигаться в сторону противоположную той, в которую она двигалась при входе в фигуру
- методы, позволяющие оценивать продолжительность данного ценового движения
- фигуры, после которых цена меняет направление движения

Открывать позиции при достижении ценой линий поддержки/сопротивления необходимо:

Ответы:

- на отскок от линии
- на пробой линии
- достижение ценой уровня не является торговым сигналом
- спустя один час, после достижения ценой линии

Пробой линии тренда означает:

- окончание данного тренда
- скорое возвращение цены в старый тренд
- консолидацию цены
- не является торговым сигналом

Очень большой угол наклона тренда (чем круче тренд), чаще всего означает что:

- тренд будет долго находиться в таком состоянии
- скоро начнется консолидация
- данное состояние неустойчиво, возможны коррекции
- ничего не означает

Технические индикаторы это:

- простейшая математическая обработка цены
- методы анализа фигур
- методы измерения намерений участников рынка
- модели поведения макроэкономических индикаторов

Технических индикаторов по разным оценкам создано более 100. Что это означает?

- случайное совпадение
- технический анализ очень глубоко разработан
- они все показывают одно и тоже и не имеют принципиальных отличий
- так много необходимо для более точного моделирования

Точка пересечения скользящей средней с ценой:

- запаздывает по отношению к реальной точке перегиба рынка
- совпадает по времени с точкой перегиба рынка
- опережает точку перегиба рынка
- в зависимости от ситуации, может вести себя по-разному

Длительное нахождение цены над и под МА генерирует:

- сигнал к изменению тренда
- сигнал к покупке, если МА направлены вверх, а цена находится над МА

- сигнал к продаже, если МА направлены вниз, а цена находится под МА
- сигнал на удержание позиции

Сколько технических индикаторов лучше использовать при анализе рынка?

- чем больше, тем лучше
- два индикатора: один осциллятор и одну МА
- две МА и четыре осциллятора
- зависит от направления тренда

Что является более сильным фактором, который необходимо учитывать, при принятии решения, показания осцилляторов или направление тренда?

- показание осциллятора
- направление тренда
- нет взаимосвязи
- они дают одинаковые сигналы

Открывать позиции лучше всего:

- по тренду
- против тренда, тогда можно поймать начало нового тренда
- не имеет значения
- при уходе позиции в минус, открывать новые позиции

Дивергенция это:

- расхождение между трендом и ценой
- расхождение между направлением движения осциллятора и цены
- пересечение ценой МА
- движение в одну сторону осциллятора и цены

Дивергенция это:

- расхождение между трендом и ценой
- расхождение между направлением движения осциллятора и цены
- цена движется вверх, а осциллятор вниз
- цена движется вниз, а осциллятор вверх

Конвергенция это:

- расхождение между трендом и ценой
- расхождение между направлением движения осциллятора и цены
- цена движется вверх, а осциллятор вниз
- цена движется вниз, а осциллятор вверх

Дивергенция дает наиболее сильный сигнал, когда:

- индикатор выходит из зоны перекупленности/перепроданности
- когда сопровождается графической фигурой «двойная вершина (дно)»
- линии МА направлены в ту же сторону, куда и сигнал, генерируемый дивергенцией
- линии МА направлены в другую сторону, чем сигнал, генерируемый дивергенцией

Торговля на основе технического анализа называется:

- инвестированием
- арбитражем
- спекуляцией
- хеджированием

В чем отличие трендоследующих индикаторов от осцилляторов?

- трендоследующие индикаторы более точные
- осцилляторы более точные
- трендоследующие индикаторы показывают направление тренда, а осцилляторы — перекупленность/перепроданность

-трендоследующие индикаторы показывают направление тренда, а осцилляторы – силу тренда

Какие из нижеприведенных утверждений не относятся к основным положениям технического анализа?

- цены на финансовых рынках изменяются случайным образом
- колебание цен на финансовых рынках имеет циклический характер
- в динамике цен на финансовых рынках проявляются устойчивые тенденции
- рынок учитывает все

Для какой из перечисленных ниже целей применяется технический анализ?

- отбор ценных бумаг при формировании портфеля
- выбор времени покупки и продажи ценных бумаг
- прогнозирование значения рыночной цены на следующий день
- анализ рисков на фондовом рынке

Что соединяет на ценовом графике линия повышательного тренда?

- несколько последовательных максимумов цен
- несколько последовательных минимумов цен
- цены закрытия торгов
- несколько зон консолидации цен

6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме зачета

| Раздел дисциплины | Вопросы |
|--|---|
| Биржевая динамика фондового рынка | <ol style="list-style-type: none">1. Биржевой рынок: понятие, структура, назначение.2. Профессиональная деятельности на РЦБ.3. Московская биржа.4. Налогообложение доходов участников биржевой торговли.5. Стоимость операций на фондовом рынке.6. Торговая программа «QUIK», назначение, возможности.7. Типы торговых приказов: рыночный, лимитированный.8. Методы торговли: инвестирование, спекуляции.9. Стоп-приказы: достоинства и недостатки.10. Методы использования Take-profit.11. Методы использования Stop-loss.12. Типы торговых счетов: кассовый, маржинальный.13. Оценка потенциального риска при открытии позиции.14. Определение точек входа и минимизация риска.15. Правила открытия новых позиций.16. Определение точек выхода из позиции.17. Правила немедленной ликвидации позиции.18. Основы фундаментального анализа.19. Понятие торговой системы, общие правила её построения.20. Поведение различных категорий игроков при построении торговых систем. |
| Технический и фундаментальный анализ на фондовом рынке | <ol style="list-style-type: none">21. Открытие длинных и коротких позиций.22. Уровни анализа на РЦБ: технический, фундаментальный.23. Уровни технического анализа: графический, математический.24. Практическое использование теории Ч. Доу.25. Тренд. Линия тренда. Канал тренда. Уровни поддержки и сопротивления.26. Графическое представление рыночной ситуации.27. Коррекция, расширение Фибо. |

| | |
|--|---|
| | <p>28. Ценовые пробелы.</p> <p>29. Трендовые линии Демарка. Ценовые проекторы. Квалификаторы прорывов.</p> <p>30. Графические фигуры перелома тенденции.</p> <p>31. Графические фигуры продолжения тенденции.</p> <p>32. Индикаторы и их использование.</p> <p>33. Использование комбинации 2-х и 3-х скользящих средних.</p> <p>34. Использование MACD.</p> <p>35. Конверты как тип индикаторов. Полосы Боллинджера.</p> <p>36. Осцилляторы и их использование.</p> <p>37. Дивергенция, ее типы.</p> <p>38. Momentum, ROC.</p> <p>39. RSI.</p> <p>40. Stochastic, Williams's %R.</p> |
|--|---|

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 2-балльной системы |
|--------------|---|
| «зачтено» | ПК-4, ПК-2 |
| «не зачтено» | Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне |