

Документ подписан простой электронной подписью.
Информация о владельце:

ФИО: Кандрашина Елена Александровна

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

Дата подписания: 29.06.2023 11:44:01

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 Экономической теории

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета

(протокол № 11 от 30 мая 2023 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Наименование дисциплины Б1.В.10 Практикум по фондовому рынку

Основная профессиональная образовательная программа 38.04.01 Экономика программа Финансовые аналитические и информационные технологии

Квалификация (степень) выпускника магистр

Самара 2023

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

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

1. Место дисциплины в структуре ОП

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

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Финансовые технологии и финансовые институты

Последующие дисциплины по связям компетенций: Технологические основы портфельного инвестирования

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

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

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-4 - Способен, используя современные методики, разрабатывать финансовый план для клиентов различного уровня; проводить научные исследования по актуальным вопросам повышения финансовой грамотности населения

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):
	современные методики разработки финансовых планов для различных групп клиентов	разрабатывать финансовый план для клиентов различного уровня	навыками сбора, анализа необходимой информации, применения современных методик разработки финансового плана для клиентов различного уровня

ПК-5 - Способен владеть инструментарием составления целевого инвестиционного портфеля для различной группы инвесторов

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):
	методику принятия инвестиционных решений и составления целевого инвестиционного портфеля	формировать целевой инвестиционный портфель для различных групп инвесторов	методами сравнительной оценки и выбора объектов инвестиций, определять ликвидность и риск целевого портфеля

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 3
Контактная работа, в том числе:	12.15/0.34
Занятия семинарского типа	12/0.33

Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.15/0
Самостоятельная работа:	77.85/2.16
Промежуточная аттестация	18/0.5
Вид промежуточной аттестации: Зачет	Зач
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	108
Зачетные единицы	3

4. Содержание дисциплины

4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Практикум по 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.	Подходы к анализу динамики биржевого рынка фондовых активов	6			30	ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3, ПК-5.1, ПК-5.2, ПК-5.3
2.	Теория и практика технического анализа фондовых активов	6			47.85	ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3, ПК-5.1, ПК-5.2, ПК-5.3
	Контроль	18				
	Итого	12	0.15		77.85	

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.	Подходы к анализу динамики биржевого рынка фондовых активов	практическое занятие	Биржевая динамика фондовых активов
		практическое занятие	Графическое отображение биржевой динамики фондовых активов
		практическое занятие	Торговые системы. Автоследование
2.	Теория и практика технического анализа фондовых активов	практическое занятие	Технический анализ: принципы, приемы, алгоритмы
		практическое занятие	Методика проведения технического анализа финансовых рынков
		практическое занятие	Графический и количественный технический анализ

** 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.	Подходы к анализу динамики биржевого рынка фондовых активов	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование
2.	Теория и практика технического анализа фондовых активов	- 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. Михайленко, М. Н. Финансовые рынки и институты: учебник для вузов / М. Н. Михайленко. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 336 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-01273-6. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/510907>

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, 2023. — 514 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-11196-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/510457>

2. Финансовые рынки и институты : учебник и практикум для вузов / Н. Б. Болдырева [и др.] ; под редакцией Н. Б. Болдыревой, Г. В. Черновой. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 379 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-15055-1. — Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/512162>

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. 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 оборудования	Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования

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

6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

Вид контроля	Форма контроля	Отметить нужное знаком « + »
Текущий контроль	Оценка докладов	+
	Аналитическая работа	+
	Тестирование	+
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, используя современные методики, разрабатывать финансовый план для клиентов различного уровня; проводить научные исследования по актуальным вопросам повышения финансовой грамотности населения

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ПК-4.1: Знать:	ПК-4.2: Уметь:	ПК-4.3: Владеть (иметь навыки):
	современные методики разработки финансовых планов для различных групп клиентов	разрабатывать финансовый план для клиентов различного уровня	навыками сбора, анализа необходимой информации, применения современных методик разработки финансового плана для клиентов различного уровня
Пороговый	понятие финансового плана и его основных элементов	составлять финансовый план для хозяйствующего субъекта	навыками подбора параметров финансового планирования
Стандартный (в дополнение к пороговому)	основные методы финансового планирования	выбирать методы управления финансовым планом хозяйствующего субъекта	компетенциями составления финансовых планов с учетом потребностей клиентов различного уровня
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	способы адаптации финансового плана под различные категории клиентов	адаптировать финансовый план под различные категории клиентов	навыками адаптации и нивелирования рисков финансовых планов для клиентов различного уровня

ПК-5 - Способен владеть инструментарием составления целевого инвестиционного портфеля для различной группы инвесторов

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
		ПК-5.1: Знать:	ПК-5.2: Уметь:
	методику принятия инвестиционных решений и составления целевого инвестиционного портфеля	формировать целевой инвестиционный портфель для различных групп инвесторов	методами сравнительной оценки и выбора объектов инвестиций, определять ликвидность и риск целевого портфеля
Пороговый	понятие целевого инвестиционного портфеля	определить тип целевого инвестиционного портфеля исходя из потребностей клиента	навыком определения риск-профиля клиента в инвестиционном процессе
Стандартный (в дополнение к пороговому)	типы инвестиционных портфелей в зависимости от риск-профиля клиента	отбирать финансовые активы в целевой инвестиционный портфель в соответствии с предпочтениями клиента	навыками мониторинга целевого инвестиционного портфеля исходя из смены предпочтений клиента и рыночной конъюнктуры
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	методы и подходы к управлению целевым инвестиционным портфелем	управлять целевым инвестиционным портфелем исходя из рыночной конъюнктуры	навыками расчета доходности и рискованности целевого инвестиционного портфеля и способами повышения его эффективности

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.	Подходы к анализу динамики биржевого рынка фондовых активов	ПК-4.1, ПК-4.2, ПК- 4.3, ПК-5.1, ПК-5.2, ПК-5.3	Оценка докладов, аналитическая работа, тестирование	зачет
2.	Теория и практика технического анализа фондовых активов	ПК-4.1, ПК-4.2, ПК- 4.3, ПК-5.1, ПК-5.2, ПК-5.3	Оценка докладов, аналитическая работа, тестирование	зачет

6.4. Оценочные материалы для текущего контроля

Задания и требования для подготовки доклада по дисциплине для оценки сформированности компетенций размещены в ЭИОС СГЭУ, <https://lms2.sseu.ru/enrol/index.php?id=269>

Задания и требования для подготовки аналитической работы по дисциплине для оценки сформированности компетенций размещены в ЭИОС СГЭУ, <https://lms2.sseu.ru/enrol/index.php?id=269>

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

<https://lms2.sseu.ru/enrol/index.php?id=269>

6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме зачета

Раздел дисциплины	Вопросы
Подходы к анализу динамики биржевого рынка фондовых активов	<ol style="list-style-type: none"> 1. Понятие динамики биржевого рынка. 2. Графическое отображение хода биржевых торгов. 3. Анализ объема торгов и открытого интереса. 4. Торговая система: понятие, виды, практика применения 5. "Механические" торговые системы, принципы построения, назначение, преимущества и недостатки. 6. Автоследование: преимущество и недостатки 7. Межрыночный анализ 8. Тенденция и ее основные характеристики. Теория Доу. 9. Виды графиков и их построение. 10. Линии тренда, их построение, корректировка. Веерный принцип. Линия канала. Перелом тенденции.
Теория и практика технического анализа фондовых активов	<ol style="list-style-type: none"> 11. Понятие технического анализа: особенности применения, история развития, основные методы и эффективность их использования. 12. Философия технического анализа (аксиомы технического анализа). 13. Ценовые модели: перелома, продолжения тенденции и неопределенности. 14. Скользящие средние значения: простое среднее скользящее, линейно-взвешенное, экспоненциально-сглаженное. 15. Использование скользящих средних для нахождения торгового сигнала. 16. Осцилляторы: основы построения, методы интерпретации. 17. Основы теории циклов. Характеристики. Принципы циклического анализа. 18. Классификация циклов. Технология выявления циклов. Числа Фибоначчи – математическая основа теории волн.

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-х балльной системы
«зачтено»	ПК-4, ПК-5
«не зачтено»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне