

Документ подписан простой электронной подписью.  
Информация о владельце:

ФИО: Кандрашина Елена Александровна

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

Дата подписания: 02.11.2022 14:09:01

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 № 9 от 31 мая 2022 г. )

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА**

**Наименование дисциплины**      Б1.В.08 Практикум по фондовому рынку

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

Квалификация (степень) выпускника магистр

Самара 2022

## 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: современные методики разработки финансовых планов для различных групп клиентов	ПК-4.2: Уметь: разрабатывать финансовый план для клиентов различного уровня

## 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.	Биржевая динамика фондового рынка	6			38,925	ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3
2.	Технический и фундаментальный анализ на фондовом рынке	6			38,925	ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3
	Контроль	18				
	<b>Итого</b>	<b>12</b>	<b>0.15</b>		<b>77.85</b>	

#### 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 фондового рынка	практическое занятие	Фондовая биржа. Торговля на Московской бирже
		практическое занятие	Основы риск-менеджмента на фондовом рынке
		практическое занятие	Торговые системы
2.	Технический и фундаментальный анализ на фондовом рынке	практическое занятие	Введение в технический анализ
		практическое занятие	Графический технический анализ
		практическое занятие	Количественный технический анализ. Индикаторы. Осцилляторы

\*\* 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 фондового рынка	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование
2.	Технический и фундаментальный анализ на 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. Михайленко, М. Н. Рынок ценных бумаг : учебник и практикум для вузов / М. Н. Михайленко. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 326 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-04961-9. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/468907>

#### **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, 2020. — 514 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-11196-5. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/449663>

#### **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»

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

#### 5.6 Лаборатории и лабораторное оборудование

### 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	+
	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, утвержденными Ученым советом ФГАОУ ВО СГЭУ, протокол № 16 от 20.05.2021; 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», утвержденным Ученым советом ФГАОУ ВО СГЭУ, протокол № 16 от 20.05.2021 г.

## 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	сущность и принципы построения инвестиционных портфелей	рассчитать ожидаемую доходность и риск инвестиционного портфеля	навыками осуществления различных видов сделок с ценными бумагами, валютой и фондовыми индексами
Стандартный (в дополнение к пороговому)	способы применения выводов, полученных на основе анализа, для совершения сделок на финансовых рынках	пользоваться программными продуктами для совершения операций с финансовыми инструментами	методологией анализа различных финансовых рынков с помощью финансовых технологий и финансовых инструментов
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	методики технического анализа и способы интерпретации его данных для использования в профессиональной деятельности	пользоваться программными продуктами для совершения операций с финансовыми инструментами	навыками прогнозирования развития финансовых технологий и финансовых инструментов

## 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 фондового рынка	ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3	Аналитическая задача, практическая задача, тест, лабораторные работы	
2.	Технический и фундаментальный анализ на фондовом рынке	ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3	Аналитическая задача, практическая задача, тест, лабораторные работы	

#### 6.4.Оценочные материалы для текущего контроля

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

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.



-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 то же 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"> <li>1. Биржевой рынок: понятие, структура, назначение.</li> <li>2. Профессиональная деятельности на РЦБ.</li> <li>3. Московская биржа.</li> <li>4. Налогообложение доходов участников биржевой торговли.</li> <li>5. Стоимость операций на фондовом рынке.</li> <li>6. Торговая программа «QUIK», назначение, возможности.</li> <li>7. Типы торговых приказов: рыночный, лимитированный.</li> <li>8. Методы торговли: инвестирование, спекуляции.</li> <li>9. Стоп-приказы: достоинства и недостатки.</li> </ol>

	<p>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.</p>
Технический и фундаментальный анализ на фондовом рынке	<p>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.  28. Ценовые пробелы.  29. Трендовые линии Демарка. Ценовые проекторы. Квалификаторы прорывов.  30. Графические фигуры перелома тенденции.  31. Графические фигуры продолжения тенденции.  32. Индикаторы и их использование.  33. Использование комбинации 2-х и 3-х скользящих средних.  34. Использование MACD.  35. Конверты как тип индикаторов. Полосы Боллинджера.  36. Осцилляторы и их использование.  37. Дивергенция, ее типы.  38. Momentum, ROC.  39. RSI.  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-х балльной системы
«зачтено»	ПК-4
«не зачтено»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне