

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:

ФИО: Ашмарина Светлана Игоревна

Должность: Ректор ФГБОУ ВО «Самарский государственный университет высшего образования»

Дата подписания: 01.02.2021 07:56:40

Уникальный программный ключ:

59650034d6e3a6baac49b7bd0f8e79fea1433ff3e82f1fc7e9279a031181baba

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

Институт национальной и мировой экономики

Кафедра Экономической теории

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета

(протокол № 10 от 29 апреля 2020 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Наименование дисциплины Б1.В.ДВ.13.02 Технический анализ рынка ценных бумаг

Основная профессиональная образовательная программа Направление 38.03.01 Экономика программа "Бизнес-аналитика и статистика"

Методический отдел УМУ
« 15 » _____ 20 20 г.

Научная библиотека СГЭУ
« 03 » _____ 20 20 г.

Рассмотрено к утверждению
на заседании кафедры Экономической теории
(протокол № 8 от 16.03.2020г.)
Зав. кафедрой _____ /М.Е.Коновалова/

Квалификация (степень) выпускника бакалавр

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 Технический анализ рынка ценных бумаг входит в вариативную часть (дисциплина по выбору) блока Б1. Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Экономика организации, Бухгалтерский учет, Методы многомерного статистического анализа, Теория бухгалтерского учета, Банковская статистика, Микроэкономическая статистика, Финансы, Статистика фондового рынка, Статистика видов экономической деятельности, Статистика финансово-коммерческих расчетов и валютных операций, Статистика предприятий и предпринимательства, Микроэкономика, Макроэкономика, Статистика, Национальное счетоводство, Налоговая система РФ, Мировая экономика и МЭО, Макроэкономическая статистика, Социальная статистика, Демография и статистика населения, Международная статистика, Региональная статистика, Муниципальная статистика, Статистические методы оценки инвестиций и инноваций, Статистические методы принятия управленческих решений, Статистика труда, Статистическая отчетность и единовременные статистические обследования

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

Изучение дисциплины Технический анализ рынка ценных бумаг в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-2 - способностью на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-2	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
	ПК2з1: правовой режим, определяющий основные экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов	ПК2у1: применять типовые методики, действующую нормативно-правовую базу для определения экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов	ПК2в1: методикой расчета важнейших экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов
	ПК2з2: типовые методики расчетов экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов	ПК2у2: рассчитать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов	ПК2в2: приемами выбора типовой методики расчета основных экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов

ПК-5 - способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-5	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
	ПК5з1: методы анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.	ПК5у1: анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.	ПК5в1: навыками анализа, интерпретации экономических показателей содержащихся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.
	ПК5з2: способы применения результатов анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д., для принятия управленческих решений	ПК5у2: использовать полученные в результате анализа бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. для принятия управленческих решений	ПК5в2: методами принятия управленческих решений по итогам результатов анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.

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

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-6	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
	ПК6з1: методы анализа и интерпретации данных отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях	ПК6у1: анализировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях	ПК6в1: способностью интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях
	ПК6з2: основы использования статистических данных для выявлений	ПК6у2: выявлять тенденции изменения социально-экономических	ПК6в2: методами построения прогнозов изменений социально-экономических показателей с применением

	тенденций изменения социально-экономических показателей	показателей, строить прогнозы социально-экономического развития	результатов анализа статистических данных
--	---	---	---

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:	33.15/0.92
Занятия лекционного типа	16/0.44
Занятия семинарского типа	16/0.44
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.15/0
Групповая контактная работа (ГКР)	1/0.03
Самостоятельная работа, в том числе:	19.85/0.55
Промежуточная аттестация	19/0.53
Вид промежуточной аттестации: Зачет	Зач
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	72
Зачетные единицы	2

4. Содержание дисциплины

4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Технический анализ рынка ценных бумаг 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
		Лекции	Занятия семинарского типа	ИКР	ГКР		
			Практич. занятия				
1.	Введение в технический анализ	6	6			8	ПК2з1, ПК2з2, ПК2у1, ПК2у2, ПК2в1, ПК2в2, ПК5з1, ПК5з2, ПК5у1, ПК5у2, ПК5в1, ПК5в2, ПК6з1, ПК6з2, ПК6у1, ПК6у2, ПК6в1, ПК6в2
2.	Инструменты технического анализа	10	10			11,85	ПК2з1, ПК2з2, ПК2у1, ПК2у2, ПК2в1, ПК2в2, ПК5з1, ПК5з2, ПК5у1, ПК5у2, ПК5в1, ПК5в2, ПК6з1, ПК6з2,

							ПК6у1, ПК6у2, ПК6в1, ПК6в2
	Контроль	19					
	Итого	16	16	0.15	1	19.85	

4.2 Содержание разделов и тем

4.2.1 Контактная работа

Тематика занятий лекционного типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия лекционного типа*	Тематика занятия лекционного типа
1.	Введение в технический анализ	лекция	Фондовая биржа. Торговля на Московской бирже
		лекция	Основы риск-менеджмента
		лекция	Основные постулаты технического анализа
2.	Инструменты технического анализа	лекция	Графический технический анализ
		лекция	Количественный технический анализ. Индикаторы.
		лекция	Осцилляторы

*лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся

Тематика занятий семинарского типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия семинарского типа**	Тематика занятия семинарского типа
1.	Введение в технический анализ	практическое занятие	Фондовая биржа. Торговля на Московской бирже
		практическое занятие	Основы риск-менеджмента
		практическое занятие	Основные постулаты технического анализа
2.	Инструменты технического анализа	практическое занятие	Графический технический анализ
		практическое занятие	Количественный технический анализ. Индикаторы.
		практическое занятие	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.	Введение в технический анализ	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование
2.	Инструменты технического анализа	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации

*** 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 академического бакалавриата / М. Н. Михайленко. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 326 с. — (Серия : Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-04961-9. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://www.biblio-online.ru/bcode/433137>

Дополнительная литература

1. Рынок ценных бумаг : учебник для академического бакалавриата / Н. И. Берзон [и др.] ; под общ. ред. Н. И. Берзона. — 4-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 443 с. — (Серия : Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-03265-9. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://www.biblio-online.ru/bcode/431116>

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 оборудования	Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования

Для проведения занятий лекционного типа используются демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия в виде презентационных материалов, обеспечивающих тематические иллюстрации.

6. Фонд оценочных средств по дисциплине Технический анализ рынка ценных бумаг:

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 ФГБОУ ВО СГЭУ №10 от 29.04.2020г.

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

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-2 - способностью на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
Пороговый	ПК2з1: правовой режим, определяющий основные экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов	ПК2у1: применять типовые методики, действующую нормативно-правовую базу для определения экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов	ПК2в1: методикой расчета важнейших экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов
Повышенный	ПК2з2: типовые методики расчетов экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов	ПК2у2: рассчитать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов	ПК2в2: приемами выбора типовой методики расчета основных экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов

ПК-5 - способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
Пороговый	ПК5з1: методы анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной	ПК5у1: анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную	ПК5в1: навыками анализа, интерпретации экономических показателей содержащихся в отчетности

	информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.	информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.	предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.
Повышенный	ПК5з2: способы применения результатов анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д., для принятия управленческих решений	ПК5у2: использовать полученные в результате анализа бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. для принятия управленческих решений	ПК5в2: методами принятия управленческих решений по итогам результатов анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.

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

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
Пороговый	ПК6з1: методы анализа и интерпретации данных отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях	ПК6у1: анализировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях	ПК6в1: способностью интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях
Повышенный	ПК6з2: основы использования статистических данных для выявления тенденций изменения социально-экономических показателей	ПК6у2: выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей, строить прогнозы социально-экономического развития	ПК6в2: методами построения прогнозов изменений социально-экономических показателей с применением результатов анализа статистических данных

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.	Введение в технический	ПК2з1, ПК2з2, ПК2у1,	Оценка докладов	Зачет

	анализ	ПК2у2, ПК2в1, ПК2в2, ПК5з1, ПК5з2, ПК5у1, ПК5у2, ПК5в1, ПК5в2, ПК6з1, ПК6з2, ПК6у1, ПК6у2, ПК6в1, ПК6в2	Устный/письменный опрос Тестирование	
2.	Инструменты технического анализа	ПК2з1, ПК2з2, ПК2у1, ПК2у2, ПК2в1, ПК2в2, ПК5з1, ПК5з2, ПК5у1, ПК5у2, ПК5в1, ПК5в2, ПК6з1, ПК6з2, ПК6у1, ПК6у2, ПК6в1, ПК6в2	Оценка докладов Устный/письменный опрос Тестирование	Зачет

6.4.Оценочные материалы для текущего контроля

Примерная тематика докладов

Раздел дисциплины	Темы
Введение в технический анализ	<ol style="list-style-type: none"> 1. Природа, предмет изучения и границы применимости технического анализа. 2. Постулаты и предпосылки технического анализа. 3. Классификация методов и методика анализа графиков. 4. Фундаментальный и технический анализ. 5. Психологические аспекты технического анализа. 6. Методы технического анализа. 7. Конфигурационные методы. 8. Исследование результатов применения методов технического анализа. 9. Проблема использования торговых систем на практике. 10. Риск: сравнение вознаграждения между более волатильными и менее волатильными портфелями. 11. Ложные «пробои» и «провалы»: ключевые рыночные фигуры. 12. Отличие «бычьих» и «медвежьих» циклических фигур. 13. Календарные циклы фондового рынка. 14. Политические, сезонные и временные циклы: катание на волнах рыночных приливов и отливов.
Инструменты технического анализа	<ol style="list-style-type: none"> 15. Применение методов технического анализа в сочетании с элементами фундаментальных методик. 16. Фильтрационные методы технического анализа. 17. Корреляционные методы технического анализа. 18. Анализ фигур на графиках японских свечей. 19. Скользящие средние: мифы и недоразумения. 20. Осцилляторные методы технического анализа. 21. Использование скользящих средних для определения четырех стадий рыночного цикла. 22. Диаграммы скорости изменения рынка «быков» и рынка «медведей». 23. Исследование инструментов технического анализа и выработка рекомендаций их применения на рынке ценных бумаг. 24. Синергия основных трендов в действии. 25. Выбор правильных инвестиционных инструментов.

Вопросы для устного/письменного опроса

Раздел дисциплины	Вопросы
Введение в технический анализ	<ol style="list-style-type: none"> 1. Современные фондовые биржи, механизм торговли, торгуемые инструменты. 2. Налогообложение и стоимость операций на фондовом рынке. 3. Московская Биржа и торговля на ней. 4. Типы торговых приказов. 5. Типы торговых приказов: stop-loss и take-profit.

	6. Уровень маржи на рынке ценных бумаг: понятие, назначение, методика расчета. 7. Оценка потенциального риска и дохода. Графический способ входа и выхода из позиции. Условия немедленной ликвидации позиции. 8. Понятие торговой системы (ТС) и ее составные части. 9. Поведение различных категорий игроков при построении торговых систем. 10. Управление капиталом. 11. Психология рынка. 12. Основные постулаты технического анализа. 13. Анализ и прогнозирование рынка с использованием графиков.
Инструменты технического анализа	14. Тенденция и ее основные характеристики. 15. Линия тренда. Уровни поддержки и сопротивления. 16. Теория Доу (основные постулаты теории Чарльза Доу). 17. Последовательность Фибоначчи. 18. Волновая теория Эллиота. 19. Ценовые пробелы и их типы. 20. Трендовые линии Демарка. Ценовые проекторы. 21. Графические модели. 22. Скользящие средние (МА). Комбинация 2-х МА, комбинация 3-х МА. 23. Схождение-расхождение скользящих средних (MACD). Дивергенция. 24. Индикаторы-конверты: полосы Боллинджера (BB). 25. Осцилляторы и тенденция: проблемы анализа, общие принципы применения. 26. Трендовые и реинджерные осцилляторы. Построение осцилляторов. 27. Торговля на сигналах осциллятора. 28. Понятие и уровни фундаментального анализа. 29. Оценка качества биржевого актива.

Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций размещены в ЭИОС СГЭУ, <https://lms2.sseu.ru/course/index.php?categoryid=514>

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 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
Введение в технический анализ	<ol style="list-style-type: none"> 1. Биржевой рынок: понятие, структура, назначение. 2. Профессиональная деятельности на РЦБ. 3. Московская биржа.

	<p>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. Открытие длинных и коротких позиций. 14. Уровни анализа на РЦБ: технический, фундаментальный. 15. Уровни технического анализа: графический, математический. 16. Практическое использование теории Ч. Доу.</p>
Инструменты технического анализа	<p>17. Тренд. Линия тренда. Канал тренда. Уровни поддержки и сопротивления. 18. Графическое представление рыночной ситуации. 19. Коррекция, расширение Фибо. 20. Ценовые пробелы. 21. Трендовые линии Демарка. Ценовые проекторы. Квалификаторы прорывов. 22. Графические фигуры перелома тенденции. 23. Графические фигуры продолжения тенденции. 24. Индикаторы и их использование. 25. Использование комбинации 2-х и 3-х скользящих средних. 26. Использование MACD. 27. Конверты как тип индикаторов. Полосы Боллинджера. 28. Осцилляторы и их использование. 29. Дивергенция, ее типы. 30. Momentum, ROC. 31. RSI. 32. Stochastic, Williams's %R. 33. Оценка потенциального риска при открытии позиции. 34. Определение точек входа и минимизация риска. 35. Правила открытия новых позиций. 36. Определение точек выхода из позиции. 37. Правила немедленной ликвидации позиции.</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»	ПК2з1, ПК2у1, ПК2в1, ПК5з1, ПК5у1, ПК5в1, ПК6з1, ПК6у1, ПК6в1
«не зачтено»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне