

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

СОГЛАСОВАНО
 Декан факультета
 Волков А.Н.
 2023 г.

УТВЕРЖДАЮ
 Проректор по УриКОД
 А.В. Иваненко
 « 16 » 06 2023 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
Основы фундаментального и технического анализа

Шифр и направление подготовки	<u>09.03.03 Прикладная информатика</u>
Квалификация (степень) выпускника	<u>бакалавр</u>
Профиль подготовки	<u>Цифровые технологии в аналитической деятельности</u>
Форма обучения	<u>очная</u>
Выпускающая кафедра	<u>Информационных технологий и математики</u>
Кафедра-разработчик рабочей программы	<u>Информационных технологий и математики</u>
Год набора	<u>2023</u>

Семестр	Трудоемкость (час./зет.)	Лекцион. занятий, (час.)	Практич. занятий, (час.)	Лаборат. занятий, (час.)	СРС, (час.)	КР/КП (час.)	Форма промежуточного контроля (экз./зачет)
6	216/6	32	16	32	109	-	Экзамен(27)
ИТОГО	216/6	32	16	32	109		Экзамен(27)

Сочи 2023 г.

Лист согласования рабочей программы дисциплины Основы фундаментального и технического анализа

Рабочую программу составили:
_____ Копырин А.С.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА РАССМОТРЕНА И ОДОБРЕНА

на заседании кафедры Информационных технологий и математики
Протокол № 1608 2023г.

Заведующий кафедрой

А.С. Копырин

Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины соответствует
библиотечному фонду СГУ:

Директор НОБ

Омиченко Е.В.

Структура рабочей программы соответствует предъявляемым требованиям:

Отдел качества образования и
методического обеспечения

Вешеряшова И.Е.

подпись

Ф.И.О.

ЛИСТ РЕГИСТРАЦИИ ИЗМЕНЕНИЙ РПД

Рабочая программа переутверждена на 20___/20___ учебный год,

В программу внесены дополнения и(или) изменения.

Заведующий кафедрой

подпись

ФИО

Рабочая программа переутверждена на 20___/20___ учебный год,

В программу внесены дополнения и(или) изменения.

Заведующий кафедрой

подпись

ФИО

Рабочая программа переутверждена на 20___/20___ учебный год

В программу внесены дополнения и(или) изменения.

Заведующий кафедрой

подпись

ФИО

СОДЕРЖАНИЕ

1 ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ	5
2 МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП НАПРАВЛЕНИЯ (СПЕЦИАЛЬНОСТИ)	5
3 ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ	6
4 СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ.....	7
4.1 Тематический план дисциплины.....	7
4.1.1 Лекционные занятия	8
4.1.2 Практические занятия.....	10
4.1.3 Лабораторные занятия	11
4.1.4 Самостоятельная работа студента	11
4.1.5 Интерактивные формы занятий	12
4.2 Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины	12
4.2.1 Литература.....	12
4.2.2 Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы	Ошибка! Закладка не определена.
4.2.3 Нормативные документы	Ошибка! Закладка не определена.
4.2.4 Интернет-ресурсы и другие электронные информационные источники	Ошибка! Закладка не определена.
4.3 Текущая и промежуточная аттестации по дисциплине	Ошибка! Закладка не определена.
5 УСЛОВИЯ ОСВОЕНИЯ И РЕАЛИЗАЦИИ ДИСЦИПЛИНЫ	17
5.1 Методические рекомендации обучающимся по изучению дисциплины.....	17
5.2 Организация самостоятельной работы студента по дисциплине	Ошибка! Закладка не определена.
5.3 Особенности преподавания дисциплины.....	Ошибка! Закладка не определена.
5.4 Материально-техническое обеспечение дисциплины	Ошибка! Закладка не определена.
5.5 Методическое обеспечение образовательного процесса для обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья	Ошибка! Закладка не определена.
Приложение к рабочей программе дисциплины	21
АННОТАЦИЯ.....	21

1 ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Целью освоения дисциплины Основы фундаментального и технического анализа является привить студентам навыки по вопросам принятия инвестиционных решений как на основе анализа фундаментальных показателей макросреды, отраслевой динамики и специфических характеристик публичных компаний (ключевых финансовых коэффициентов, структуры собственного капитала, качества корпоративного управления), делающих их привлекательными в глазах рыночных инвесторов, так и на основе анализа графического поведения цен.

Задачи дисциплины:

- Формирование навыков работы с финансовой информацией и обучение различным видам ее представления, необходимым для фундаментального и технического анализа.
- Приобретение навыков работы с информационно-торговыми системами.
- Определение границ применения технического анализа и его использования в сочетании с другими методами для проведения комплексного всестороннего анализа финансовых инструментов.

2 МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП НАПРАВЛЕНИЯ (СПЕЦИАЛЬНОСТИ)

Дисциплина Основы фундаментального и технического анализа относится к дисциплинам части учебного плана, формируемой участниками образовательных отношений.

Таблица 1 - Дисциплины, участвующие в формировании компетенции

Код и наименование компетенции	Дисциплины, участвующие в формировании компетенции
Профессиональные компетенции установленные вузом (ПКУВ)	
ПК-4 Способен составлять технико-экономическое обоснование проектных решений и техническое задание на разработку информационной системы.	Проектный практикум Экономика информационных систем Современный инструментарий бизнес-аналитики Бизнес-планирование Преддипломная практика
ПК-6 Способен выявлять бизнес-проблемы и бизнес-возможности и обосновывать выбор решений	Экономическая теория (продвинутый уровень) Цифровые финансы Современный инструментарий бизнес-аналитики Государственное регулирование использования цифровой экономики Бизнес-планирование Эконометрика Экономико-математическое моделирование Интернет-маркетинг в цифровой среде Информационные системы в бухгалтерском учете и налогообложении Предметно-ориентированные экономические информационные системы Информационные системы управления производственной компании Системы поддержки принятия решений Электронная коммерция и цифровые рынки Электронные платежные системы Преддипломная практика
ПК-8 Способен решать задачи в области развития науки,	Математическое и имитационное моделирование Интеллектуальные информационные системы

техники и технологии с учетом нормативного правового регулирования в сфере интеллектуальной собственности	<p>Введение в машинное обучение</p> <p>Правовые основы интеллектуальной собственности</p> <p>Эконометрика</p> <p>Экономико-математическое моделирование</p> <p>Информационные системы в бухгалтерском учете и налогообложении</p> <p>Предметно-ориентированные экономические информационные системы</p> <p>Информационные системы управления производственной компании</p> <p>Системы поддержки принятия решений</p> <p>Научно-исследовательская работа</p> <p>Преддипломная практика</p>
---	---

3 ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

ПК – профессиональные компетенции установленные вузом.

Таблица 2 - Компетенции и индикаторы их достижения

Компетенции и индикаторы их достижения		В результате изучения дисциплины обучающиеся должны:
Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	
ПК-8 Способен решать задачи в области развития науки, техники и технологии с учетом нормативного правового регулирования в сфере интеллектуальной собственности	ПК-8.1 Демонстрирует знание правовых основ охраны объектов интеллектуальной собственности, актуальной нормативной, научно-технической, охранной документации в области информационных технологий и методов определения патентной чистоты	ПК-8.1 Знает основы системного мышления и научно-исследовательских методов
ПК-4 Способен составлять технико-экономическое обоснование проектных решений и техническое задание на разработку информационной системы.	ПК-4.2 Описывает и согласовывает архитектуру системы; целевые показатели объекта автоматизации; рекомендуемые решения	ПК-4.2 Умеет формулировать цели, исходя из анализа проблем, потребностей и возможностей
ПК-6 Способен выявлять бизнес-проблемы и бизнес-возможности и обосновывать выбор решений	ПК-6.1 Выявляет бизнес-проблемы и бизнес-возможности с использованием современных ИКТ	ПК-6.1 Знает методы сбора, анализа, систематизации, хранения и поддержания в актуальном состоянии информации бизнес-анализа
	ПК-6.2 Формирует возможные решения на основе системы целевых показателей	<p>ПК-6.2 Знает цифровые технологии и типовое программное обеспечение, применяемое в экономике и бизнес-анализе</p> <p>ПК-6.2 Умеет анализировать факторы, условия, требования и связи между ними, влияющие на деятельность организации</p> <p>ПК-6.2 Владеет навыками анализа и описания решений по системе целевых показателей</p>

Компетенции и индикаторы их достижения		В результате изучения дисциплины обучающиеся должны:
Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	
	ПК-6.3 Анализирует и обосновывает выбор управленческих решений	ПК-6.3 Владеет навыками выбора решения для реализации

4 СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

4.1 Тематический план дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины составляет 6 зачетных единиц, 216 часов,

№ раздела, темы	Наименование модуля (раздела, темы) дисциплины	Всего часов	Виды учебной нагрузки и их трудоемкость, часы			
			Контактная работа			СРС
			Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
1	Основные понятия и предпосылки фундаментального анализа.	12	2	0	2	6
2	Особенности аналитической работы на финансовых рынках	10	2	0	2	6
3	Два направления проведения фундаментального анализа: «сверху-вниз» и «снизу-вверх».	14	2	2	2	8
4	Сравнительный подход в фундаментальном анализе для сопоставления фондовых рынков и отдельных акций	14	2	2	2	8
5	Моделирование положения инвестора и ценообразование финансовых активов.	14	2	2	2	8
6	Анализ ликвидности акций	14	2	2	2	8
7	Основные понятия, постулаты и предпосылки технического анализа	10	2	0	2	6
8	Основные понятия графического анализа ценных бумаг	10	2	0	2	6
9	Тенденции на рынке ценных бумаг и принципы их выявления	10	2	0	2	6
10	Графические фигуры как метод технического анализа	10	2	0	2	6
11	Графические фигуры как метод технического анализа	14	2	2	2	8
12	Индикаторы как метод технического анализа ценных бумаг	10	2	0	2	6
13	Индикаторы как метод технического анализа ценных бумаг	14	2	2	2	8
14	Осцилляторы как метод технического анализа ценных бумаг	10	2	0	2	6
15	Осцилляторы как метод технического анализа ценных бумаг	14	2	2	2	8
16	Специальные методы технического анализа ценных бумаг	11	2	2	2	5
	Экзамен	27				
	ИТОГО	216	32	16	32	109

4.1.1 Лекционные занятия

№ п/п	Наименование темы дисциплины	Краткое содержание
1	Основные понятия и предпосылки фундаментального анализа.	<p>Концепция «разумного инвестирования» Б.Грэхема и критика ее со стороны Дж. М. Кейнса. Гипотеза рационального поведения инвестора. Понятия «совершенный рынок», «конкурентный финансовый рынок», «трения на рынке». Понятие справедливой рыночной стоимости и инвестиционные стратегии на фондовом рынке. Многообразие показателей в рамках рыночного видения публичной компании. Рыночная информационная эффективность (ЕМН): определение и тестирование (Ю. Фама, 1971, 1991). Гипотеза адаптированных рынков (АМН) Андрея Ло. Микро и макронеэффективность (исследования Р.Шиллера). Критика бихевиористами положений ЕМН (работы А.Шлейфера). Рыночные аномалии и инвестиционные стратегии. Тестирование гипотезы учета настроений рыночных инвесторов (потакания интересам инвесторов) на примере феномена дивидендной премии Бейкера и Верглера. Роль дизайна рынка в установлении ценовых пропорций, возможности стоимостного инвестирования. Значимость микроструктуры рынка.</p>
2	Особенности аналитической работы на финансовых рынках	<p>Понятия «финансовый аналитик», «аналитическое покрытие», «консенсус прогнозы». Виды финансовых аналитиков (buy-side, sell-side). Причины и последствия конфликта интересов в области финансовой аналитики. Источники получения данных о прогнозах аналитических команд. Рейтингование аналитиков- проблемы выявления качественных прогнозов. Типичное построение аналитических отчетов и рекомендаций российских команд аналитиков. Влияние аналитических рекомендаций на поведение цен финансовых активов.</p>
3	Два направления проведения фундаментального анализа: «сверху-вниз» и «снизу- вверх».	<p>Концепция DCF для определения справедливой цены акции. Показатель FCF, оценка по отчетным показателя и принципы прогнозных построений. Методы анализа рыночных тенденций: ретроспективный анализ, прогнозирование будущих трендов. Традиционная значимость анализа макроэкономической динамики. Основные макроэкономические индикаторы, определяющие динамику фондовых индексов. Деловой цикл. Циклические экономические индикаторы. Инструменты прогнозирования. Роль опережающих индикаторов. Инфляционное влияние (теория «перетекания») и группировка отраслей и компаний по инвестиционной привлекательности. Задачи отраслевого анализа. Ключевые отраслевые факторы. Конкурентный анализ Портера. Жизненный цикл отрасли. Данные для отраслевого анализа. Классификация отраслей. Растущие, защитные и циклические отрасли и инвестиционные стратегии. Повышение значимости отраслевого прогнозирования и третья</p>

		направление в фундаментальном анализе.
4	Сравнительный подход в фундаментальном анализе для сопоставления фондовых рынков и отдельных акций	<p>Методы и техники анализа переоцененности фондовых индексов (скользящее среднее, многофакторные регрессии, «технический индикатор» Сигела). Р/Е Р.Шиллера (CAPE) для сопоставления рынков и акций. Классические инвестиционные стратегии выбора рынков и отдельных компаний, строящиеся на анализе мультипликаторов. Подход Грэхэма–Ри и другие популярные инвестиционные стратегии. Страновые и отраслевые финансовые мультипликаторы и отслеживание их динамики. Виды мультипликаторов, мультипликаторы на базе аналитических показателей (включая прогнозные EV/EBITDAR). Обоснование выбора мультипликатора и требования к обработке финансовых данных. Коррекция мультипликаторов на отраслевую специфику (значимость интеллектуального капитала), степень развития рынка капитала и специфические характеристики отдельных инвестиционных активов. Рекомендации по построению алгоритма выявления недооцененных и переоцененных акций по мультипликаторам.</p>
5	Моделирование положения инвестора и ценообразование финансовых активов.	<p>Методы и техники анализа переоцененности фондовых индексов (скользящее среднее, многофакторные регрессии, «технический индикатор» Сигела). Р/Е Р.Шиллера (CAPE) для сопоставления рынков и акций. Классические инвестиционные стратегии выбора рынков и отдельных компаний, строящиеся на анализе мультипликаторов. Подход Грэхэма–Ри и другие популярные инвестиционные стратегии. Страновые и отраслевые финансовые мультипликаторы и отслеживание их динамики. Виды мультипликаторов, мультипликаторы на базе аналитических показателей (включая прогнозные EV/EBITDAR). Обоснование выбора мультипликатора и требования к обработке финансовых данных. Коррекция мультипликаторов на отраслевую специфику (значимость интеллектуального капитала), степень развития рынка капитала и специфические характеристики отдельных инвестиционных активов. Рекомендации по построению алгоритма выявления недооцененных и переоцененных акций по мультипликаторам.</p>
6	Анализ ликвидности акций	<p>Понятие ликвидности финансовых активов и ранжирование активов по ликвидности. Индикаторы ликвидности (плотность, глубина, упругость, расчет относительного «бид-аск» спреда). Сбор информации для диагностирования ликвидности. Моделирование влияния ликвидности на вариацию доходности ценных бумаг. Переход от ликвидности отдельных активов к диагностированию динамики ликвидности рынков.</p>
7	Основные понятия, постулаты и предпосылки технического анализа	<p>Определения технического анализа. Основные положения и допущения технического анализа. Классификация методов технического анализа. Область применения методов</p>

		технического анализа. Основные положения теории Доу
8	Основные понятия графического анализа ценных бумаг	Параметры рынка ценных бумаг: цена и объём. Графическое отображение параметров рынка ценных бумаг. Графики и гистограммы. Правила построения графиков и гистограмм.
9	Тенденции на рынке ценных бумаг и принципы их выявления	Понятие тенденции. Виды тенденций. Графическое отображение тенденций. Растущий, падающий и боковой рынки. Линии тенденции и методы их построения. Коридоры и каналы. Уровни и линии поддержки и сопротивления
10	Графические фигуры как метод технического анализа	Понятие графической фигуры. Состоявшиеся и несостоявшиеся фигуры. Основные предпосылки построения фигур и их применение в анализе ценных бумаг. Основные правила построения фигур.
11	Графические фигуры как метод технического анализа	Фигуры продолжения тенденции. Фигуры разворота тенденции. Достоинства и недостатки методов графического анализа.
12	Индикаторы как метод технического анализа ценных бумаг	Понятие индикатора. Основные предпосылки построения индикаторов. Основные правила разработки индикаторов. Скользящие средние значения как основной вид индикаторов. Правила построения скользящих средних. Интерпретация скользящих средних.
13	Индикаторы как метод технического анализа ценных бумаг	Вспомогательные индикаторы и их применение. Индикаторы объёма. Индикаторы рынка. Достоинства, недостатки и область применения индикаторов
14	Осцилляторы как метод технического анализа ценных бумаг	Понятие осциллятора. Основные предпосылки построения осцилляторов. Основные правила разработки осцилляторов.
15	Осцилляторы как метод технического анализа ценных бумаг	Основные виды осцилляторов и их интерпретация. Достоинства, недостатки и область применения осцилляторов.
16	Специальные методы технического анализа ценных бумаг	Волновая теория Эллиотта: основные понятия, принципы выявления, численные соотношения. Числа Фибоначчи: понятие и применение. Теория Ганна. Методы «крестикинолики» и «японские свечи» как альтернатива методам графического анализа ценных бумаг. Психологические методы технического анализа.

4.1.2 Практические занятия

№ п/п	Наименование темы дисциплины	Краткое содержание
3	Два направления проведения фундаментального анализа: «сверху-вниз» и «снизу- вверх».	Семинарское занятие по вопросам лекции, решение расчетных задач
4	Сравнительный подход в фундаментальном анализе для сопоставления фондовых рынков и отдельных акций	Семинарское занятие по вопросам лекции, решение расчетных задач
5	Моделирование положения инвестора и ценообразование финансовых активов.	Семинарское занятие по вопросам лекции, решение расчетных задач
6	Анализ ликвидности акций	Семинарское занятие по вопросам лекции, решение расчетных задач
11	Графические фигуры как метод технического анализа	Семинарское занятие по вопросам лекции, решение расчетных задач
13	Индикаторы как метод технического анализа ценных бумаг	Семинарское занятие по вопросам лекции, решение расчетных задач
15	Осцилляторы как метод технического анализа	Семинарское занятие по вопросам лекции,

	ценных бумаг	решение расчетных задач
16	Специальные методы технического анализа ценных бумаг	Семинарское занятие по вопросам лекции, решение расчетных задач

4.1.1 Лабораторные занятия

№ п/п	Наименование темы дисциплины	Краткое содержание
1	Основные понятия и предпосылки фундаментального анализа.	Решение расчетных задач с ПО
2	Особенности аналитической работы на финансовых рынках	Решение расчетных задач с ПО
3	Два направления проведения фундаментального анализа: «сверху-вниз» и «снизу- вверх».	Решение расчетных задач с ПО
4	Сравнительный подход в фундаментальном анализе для сопоставления фондовых рынков и отдельных акций	Решение расчетных задач с ПО
5	Моделирование положения инвестора и ценообразование финансовых активов.	Решение расчетных задач с ПО
6	Анализ ликвидности акций	Решение расчетных задач с ПО
7	Основные понятия, постулаты и предпосылки технического анализа	Решение расчетных задач с ПО
8	Основные понятия графического анализа ценных бумаг	Решение расчетных задач с ПО
9	Тенденции на рынке ценных бумаг и принципы их выявления	Решение расчетных задач с ПО
10	Графические фигуры как метод технического анализа	Решение расчетных задач с ПО
11	Графические фигуры как метод технического анализа	Решение расчетных задач с ПО
12	Индикаторы как метод технического анализа ценных бумаг	Решение расчетных задач с ПО
13	Индикаторы как метод технического анализа ценных бумаг	Решение расчетных задач с ПО
14	Осцилляторы как метод технического анализа ценных бумаг	Решение расчетных задач с ПО
15	Осцилляторы как метод технического анализа ценных бумаг	Решение расчетных задач с ПО
16	Специальные методы технического анализа ценных бумаг	Решение расчетных задач с ПО

4.1.2 Самостоятельная работа студента

№ п/п	Наименование темы дисциплины	Краткое содержание
1	Основные понятия и предпосылки фундаментального анализа.	Работа с конспектом лекции, подготовка к лабораторной работе
2	Особенности аналитической работы на финансовых рынках	Работа с конспектом лекции, подготовка к лабораторной работе
3	Два направления проведения фундаментального анализа: «сверху-вниз» и «снизу- вверх».	Работа с конспектом лекции, подготовка к лабораторной работе
4	Сравнительный подход в фундаментальном анализе для сопоставления фондовых	Работа с конспектом лекции, подготовка к лабораторной работе

	рынков и отдельных акций	
5	Моделирование положения инвестора и ценообразование финансовых активов.	Работа с конспектом лекции, подготовка к лабораторной работе
6	Анализ ликвидности акций	Работа с конспектом лекции, подготовка к лабораторной работе
7	Основные понятия, постулаты и предпосылки технического анализа	Работа с конспектом лекции, подготовка к лабораторной работе
8	Основные понятия графического анализа ценных бумаг	Работа с конспектом лекции, подготовка к лабораторной работе
9	Тенденции на рынке ценных бумаг и принципы их выявления	Работа с конспектом лекции, подготовка к лабораторной работе
10	Графические фигуры как метод технического анализа	Работа с конспектом лекции, подготовка к лабораторной работе
11	Графические фигуры как метод технического анализа	Работа с конспектом лекции, подготовка к лабораторной работе
12	Индикаторы как метод технического анализа ценных бумаг	Работа с конспектом лекции, подготовка к лабораторной работе
13	Индикаторы как метод технического анализа ценных бумаг	Работа с конспектом лекции, подготовка к лабораторной работе
14	Осцилляторы как метод технического анализа ценных бумаг	Работа с конспектом лекции, подготовка к лабораторной работе
15	Осцилляторы как метод технического анализа ценных бумаг	Работа с конспектом лекции, подготовка к лабораторной работе
16	Специальные методы технического анализа ценных бумаг	Работа с конспектом лекции, подготовка к лабораторной работе

4.1.3 Интерактивные формы занятий

В учебном плане отсутствуют

4.2 Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

4.2.1 Литература

1. Никифорова, Л. Е. Современный стратегический анализ : учебное пособие / Л. Е. Никифорова, С. В. Цуриков, Е. А. Разомасова. — Москва : Ай Пи Ар Медиа, 2021. — 249 с. — ISBN 978-5-4497-1190-8. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/108247.html> (дата обращения: 29.05.2023). — Режим доступа: для авторизир. пользователей. - DOI: <https://doi.org/10.23682/108247>
2. Дж., Мэрфи Технический анализ фьючерсных рынков: теория и практика / Джон Мэрфи Дж. ; перевод О. Новицкая, В. Сидоров. — 3-е изд. — Москва : Альпина Паблишер, 2019. — 610 с. — ISBN 978-5-9614-5709-4. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/86797.html> (дата обращения: 29.05.2023). — Режим доступа: для авторизир. пользователей
3. Коришева, О. В. Рынок ценных бумаг и биржевое дело: технический анализ : учебное пособие / О. В. Коришева. — Москва : Российский университет транспорта (МИИТ), 2021. — 69 с. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/122132.html> (дата обращения: 29.05.2023). — Режим доступа: для авторизир. Пользователей
4. Выгодчикова И.Ю. Системный анализ финансового практикума [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Выгодчикова И.Ю.— Электрон. текстовые данные.— М.: Ай Пи Ар Медиа, 2023.— 284 с.— Режим доступа: <https://iprbookshop.ru/125345>.— IPR SMART, по паролю. - DOI: <https://doi.org/10.23682/125345>

5. Швагер, Д. Технический анализ : полный курс : практическое пособие : [16+] / Д. Швагер ; ред. А. Дзюра ; пер. А. Куницын, Б. Зуев. – Москва : Альпина Паблишер, 2017. – 803 с. : схем., табл., ил. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=495626> (дата обращения: 29.05.2023). – ISBN 978-5-9614-6342-2. – Текст : электронный.
6. Гузей, В. А. Анализ финансовых рынков : учебное пособие : [16+] / В. А. Гузей ; Ростовский государственный экономический университет (РИНХ). – Ростов-на-Дону : Издательско-полиграфический комплекс РГЭУ (РИНХ), 2021. – 74 с. : ил. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=682185> (дата обращения: 29.05.2023). – Библиогр. в кн. – ISBN 978-5-7972-2847-9. – Текст : электронный.
7. Кутузов, А. С. Введение в функциональный анализ : учебное пособие : [16+] / А. С. Кутузов. – Москва ; Берлин : Директ-Медиа, 2020. – 482 с. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=571413> (дата обращения: 29.05.2023). – ISBN 978-5-4499-0433-1. – DOI 10.23681/571413. – Текст : электронный.

4.2.2 Современные профессиональные базы данных и информационные

справочные системы

№	Наименование СПБД
1.	ScienceDirect : полнотекстовая база данных : сайт / издательство Elsevier. – URL: https://www.sciencedirect.com/ (дата обращения: 29.05.2023). – Режим доступа: для авториз. пользователей. – Текст : электронный.
2.	SpringerNature : полнотекстовая база данных: сайт / Springer Nature Switzerland AG. Part of Springer Nature. – URL: https://link.springer.com/ (дата обращения: 29.05.2023). – Режим доступа: для авториз. пользователей. – Текст : электронный.
3.	Электронная библиотека Сочинского государственного университета : база данных. – Сочи, 2017 – . – URL: http://lib.sutr.ru/ (дата обращения: 29.05.2023). – Текст : электронный.
Наименование ИИС	
1.	Электронная библиотека Сочинского государственного университета : база данных. – Сочи, 2017 – . – URL: http://lib.sutr.ru/ (дата обращения: 29.05.2023). – Текст : электронный.
2.	КонсультантПлюс : справочно-правовая система: сайт / Компания «КонсультантПлюс». – Москва, 1997 – . – Режим доступа: локальная сеть СГУ. – Текст : электронный.

4.2.3 Нормативные документы

1. Конституция Российской Федерации Принята на всенародном голосовании 12 декабря 1993 г. <http://ivo.garant.ru/SESSION/PILOT/main.htm>
2. Бюджетный кодекс Российской Федерации (БК РФ) от 31.07.1998 №145-ФЗ (принят ГД ФС РФ 17.07.1998г.) (в действующей редакции) <http://www.consultant.ru/popular/budget/>
3. Гражданский кодекс РФ (ГК РФ) от 26.01.1996 N 14-ФЗ Часть 2 (в действующей редакции). <http://www.consultant.ru/popular/gkrf1/>
4. Гражданский кодекс РФ (ГК РФ) от 30.11.1994 N 51-ФЗ - Часть 1 (в действующей редакции) <http://www.consultant.ru/popular/gkrf1/>

4.2.4 Интернет-ресурсы и другие электронные информационные источники

№	Наименование Интернет-ресурсов и электронных информационных источников
1.	Цифровой образовательный ресурс IPRsmart : электронно-библиотечная система : сайт / ООО Компания «Ай Пи Эр Медиа». – Саратов, 2010 – . – URL: http://www.iprbookshop.ru/ (дата обращения: 29.05.2023). – Режим доступа: для авториз. пользователей. – Текст : электронный.

2.	Университетская библиотека онлайн : электронно-библиотечная система : сайт / ООО «Нексмедиа». – Москва : Директ-Медиа, 2001 – . – URL: https://biblioclub.ru/index.php?page=book_blocks&view=main_ub (дата обращения: 29.05.2023). – Режим доступа: для авториз. пользователей. – Текст : электронный.
3.	Образовательная платформа Юрайт : электронно-библиотечная система : сайт / ООО «Электронное издательство Юрайт». – Москва, 2020 – . – URL: https://urait.ru/catalog/organization/DE41FE6D-0B08-4394-B225-3DD636CCCE1F (дата обращения: 29.05.2023). – Режим доступа: для авториз. пользователей. – Текст : электронный.
4.	Комплект Сочинского государственного университета / Консультант студента : электронно-библиотечная система : сайт / ООО «Политехресурс» – Электронная библиотека технического вуза. – Москва : Политехресурс, 2013 – . – URL: http://www.studentlibrary.ru/catalogue/switch_kit/x2019-138.html (дата обращения: 29.05.2023). – Режим доступа: для авториз. пользователей. – Текст : электронный.
5.	eLIBRARY.RU : научная электронная библиотека : сайт. – Москва, 2000 – . – URL: https://elibrary.ru/ (дата обращения: 29.05.2023). – Режим доступа: для авториз. пользователей. – Текст : электронный.

4.2. Текущая и промежуточная аттестации по дисциплине

Для оценки сформированности компетенций разрабатываются оценочные средства по дисциплине.

Форма и содержание текущей и промежуточной аттестации по дисциплине раскрывается в фонде оценочных средств, который является отдельным документом.

Оценочные средства по дисциплине содержат:

- материалы для текущего контроля оценки знаний по дисциплине;
- материалы для промежуточного контроля оценки знаний по дисциплине.
- критерии оценивания;
- шкалы оценивания.

Примерные вопросы для подготовки к промежуточной аттестации:

ВОПРОСЫ К ЭКЗАМЕНУ

1. Понятие справедливой рыночной стоимости и инвестиционные стратегии на фондовом рынке.
2. Основоположники фундаментального анализа. Принципы проведения фундаментального анализа и выставления рекомендаций заинтересованным лицам
3. Специфика разработки аналитических отчетов аналитиками инвестиционных компаний. Конфликты интересов. Ренкинги аналитиков
4. Многообразие показателей в рамках рыночного видения публичной компании.
5. Конструкция DCF в объяснении стоимости компаний и динамики фондовых индексов.
6. Подход Грэхэма-Додда. Методы анализа рыночных тенденций: ретроспективный анализ, прогнозирование будущих трендов.
7. Основные макроэкономические индикаторы, определяющие динамику фондовых индексов.
8. Влияние делового цикла на поведение цен финансовых активов. Циклические экономические индикаторы.
9. Инструменты прогнозирования на фондовом рынке. Роль опережающих индикаторов.
10. Инфляционное влияние на цены акций (теория «перетекания») и группировка отраслей и компаний по инвестиционной привлекательности.
11. Задачи отраслевого анализа в рамках фундаментального анализа акций и облигаций. Ключевые отраслевые индикаторы.
12. Конкурентный анализ Портера. Жизненный цикл отрасли и рекомендации фундаментального анализа.

13. Данные для отраслевого анализа. Классификация отраслей. Растущие, защитные и циклические отрасли и инвестиционные стратегии.

14. Повышение значимости отраслевого прогнозирования и третье направление в фундаментальном анализе.

15. Процесс выбора акции (компании) для инвестирования. Получение информации о компаниях, проблемы работы со стандартной финансовой отчетностью.

16. Значимость анализа нефинансовой информации в рамках фундаментального анализа (структура владельцев капитала, концентрация собственного капитала, роль институциональных и иностранных инвесторов)

17. Традиционные и современные финансовые показатели анализа эффективности деятельности компаний.

18. Значимость нефинансовых показателей в построении инвестиционных стратегий. Социально-ответственные инвестиции

19. Классические инвестиционные стратегии, строящиеся на анализе мультипликаторов. Подход Грэхэма –Ри и другие популярные инвестиционные стратегии.

20. Традиционный расчет P/E для фондового индекса, преимущества этого мультипликатора перед другими (Q Тобина для индекса) и развитие расчета P.Шиллером.

21. Страновые и отраслевые финансовые мультипликаторы и отслеживание их динамики.

22. Обоснование выбора мультипликатора и требования к обработке данных.

23. Коррекция мультипликаторов на отраслевую специфику, степень развития рынка капитала и специфические характеристики отдельных инвестиционных активов.

24. Моделирование положения инвестора и ценообразование финансовых активов.

25. Конструкция портфельных моделей и модификации с учетом возможностей формирования параметров и недиверсифицированной позиции инвесторов.

26. Критика конструкции CAPM и традиционно формируемых параметров локальной модели CAPM. Гибридные CAPM (HCAPM)

27. Реализованная рыночная доходность и гипотетическая, методы вычисления.

28. Модели фундаментальных факторов в рамках гипотетического метода.

29. Динамика волатильности рынков акций и облигаций и модификация конструкции CAPM.

30. Проблема обоснования меры систематического риска (бета коэффициента). Значимость отраслевого и лаггированного бета.

31. Фундаментальные факторы прогнозирования бета.

32. Переход к многофакторным моделям: конструирование ключевых факторов для развитых и развивающихся рынков.

33. Модели одностороннего риска в прогнозировании цен финансовых активов.

34. Основные характеристики развивающихся рынков капитала.

35. Модификация конструкции CAPM: от глобальной модели к скорректированной локальной и гибридной.

36. Модель Эрба, Харви и Висканта. Индекс инвестиционной доступности.

37. Информационные эффекты на развивающихся рынках капитала. Влияние поведения цен на финансовые активы на российском рынке.

38. Многофакторные модели для российского рынка, выявление факторов влияния. Значимость специфических рисков.

39. Значимость эффекта «восприятия» информации (модель Чена, 2001).

40. Учет фондовым рынком новостной информации по компаниям-эмитентам ценных бумаг.

41. Значимость качества корпоративного управления и оптимизации структуры собственности для инвестиционных стратегий на развивающихся рынках.

42. Понятие и основные аксиомы и постулаты технического анализа.

43. Основные положения теории Чарльза Доу.

44. Классификация методов технического анализа.

45. Параметры рынка ценных бумаг: Цена и объём.

46. Графическое отображение параметров рынка ценных бумаг. Графики и гистограммы. Правила построения графиков и гистограмм.

47. Понятие тенденции. Основные виды тенденций.

48. Графическое отображение тенденции. Растущий, падающий и боковой рынки.
49. Линии тенденции и методы их построения.
50. Коридоры и каналы. Уровни и линии поддержки и сопротивления.
51. Показатели оценки силы тенденции. Виды пробелов и их интерпретация.
52. Понятие графической фигуры. Состоявшиеся и несостоявшиеся фигуры.
53. Основные предпосылки построения фигур и их применение в анализе ценных бумаг.
54. Основные правила построения фигур. Фигуры разворота тенденции «голова и плечи», двойные и тройные вершины и основания, «блюдец», «шип».
55. Основные правила построения фигур. Фигуры продолжения тенденции. Треугольники, прямоугольники.
56. Достоинства и недостатки методов графического анализа.
57. Понятие индикатора. Основные предпосылки построения индикаторов.
58. Основные правила разработки индикаторов.
59. Скользящие средние значения как основной вид индикаторов.
60. Правила построения скользящих средних. Интерпретация скользящих средних.
61. Вспомогательные индикаторы и их применение. Индикаторы объёма. Индикаторы рынка.
62. Достоинства, недостатки и область применения индикаторов.
63. Понятие осциллятора. Основные предпосылки построения осцилляторов.
64. Основные правила разработки осцилляторов.
65. Основные виды осцилляторов и их интерпретация.

Примерные критерии оценивания результатов освоения дисциплины при проведении промежуточной аттестации:

Нормы оценки знаний предполагают учёт индивидуальных особенностей обучающихся, дифференцированный подход к обучению, проверке знаний, умений, уровня формирования компетенций.

В устных и письменных ответах обучающихся при выполнении практических заданий и расчетов учитываются: глубина знаний, владение необходимыми умениями (в объеме программы), логичность изложения материала, включая обобщения, выводы, соблюдение норм литературной речи, владение навыками и приемами выполнения практических заданий, подтверждение сделанных при решении практических заданий выводов соответствующими нормативными документами, правильность расчета показателей, полнота и правильность раскрытых процедур и действий в предложенном практическом задании.

Примерная шкала оценивания ответов обучающегося при проведении промежуточной аттестации по дисциплине (экзамен):

Оценка «отлично» выставляется обучающемуся, если он глубоко и прочно усвоил программный материал, исчерпывающе, последовательно, чётко и логически стройно его излагает, умеет тесно увязывать теорию с практикой, свободно справляется с задачами, вопросами и другими видами применения знаний, не затрудняется с ответом при видоизменении заданий, правильно обосновывает принятое решение, владеет разносторонними навыками и приёмами выполнения практических задач, правильно и точно подтверждает сделанные при решении практических заданий выводы соответствующими нормативными документами, точно и правильно производит расчет показателей, демонстрирует полноту и правильность раскрытых процедур и действий в предложенном практическом задании.

Оценка «хорошо» выставляется обучающемуся, если он твёрдо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос, правильно применяет теоретические положения при решении практических вопросов и задач, владеет необходимыми навыками и приёмами их выполнения.

Оценка «удовлетворительно» выставляется обучающемуся, если он имеет знания только основного материала, но не усвоил его деталей, допускает неточности, недостаточно правильные формулировки, нарушения логической последовательности в изложении программного материала, испытывает затруднения при выполнении практических работ, затрудняется подтвердить сделанные при решении практических заданий выводы хотя бы одним нормативным документом, допускает ошибки при проведении расчетов показателей, неточно использует основные процедуры и действия в предложенном практическом задании.

Оценка «неудовлетворительно» выставляется обучающемуся, который не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки, неуверенно, с большими затруднениями выполняет практические работы. Как правило, оценка «неудовлетворительно» ставится обучающимся, которые не могут продолжить обучение без дополнительных занятий по соответствующей дисциплине.

5 УСЛОВИЯ ОСВОЕНИЯ И РЕАЛИЗАЦИИ ДИСЦИПЛИНЫ

5.1 Методические рекомендации обучающимся по изучению дисциплины

Чтобы освоить учебный материал дисциплины, необходимо регулярно посещать все занятия, не опаздывать к началу занятий и обязательно конспектировать лекции. Лекции дают знания, которые подчас невозможно найти даже в учебниках. Невозможно дословно законспектировать все, что говорит преподаватель, поэтому следует постараться выделить, записать основные положения, идеи, выводы, понять логику учебного материала, излагаемого преподавателем. При конспектировании желательно использовать понятные для конспектирующего студента сокращения и условные знаки.

С целью более глубокого освоения темы дисциплины, конспекты следует дополнять и дорабатывать для систематизации и обобщения, используя информацию, полученную во время лабораторного занятия, а также рекомендуемую учебно-методическую литературу и Интернет-ресурсы. Аналогичную работу необходимо выполнять и при разработке тем дисциплины, предлагаемых для самостоятельного изучения.

Рекомендуется выработать в себе привычку просматривать, перечитывать перед новой лекцией и предстоящим лабораторным занятием текст предыдущей лекции.

Если возникают вопросы, обязательно обращайтесь за консультациями к преподавателю после занятия (или во время занятия при его вопросе к студентам: «Все понятно?») за разъяснениями, четко формулируя имеющийся «пробел» в понимании учебного материала.

При подготовке к промежуточной аттестации необходимо получить у преподавателя перечень дидактических единиц дисциплины, включенных в экзамен и электронный тест к нему.

Комплекс рекомендаций и разъяснений, позволяющих обучающемуся оптимальным образом организовать процесс изучения данной дисциплины, составляют:

1. Презентации лекционного материала.
2. Методические рекомендации по выполнению лабораторных работ.

Данные материалы представлены в электронном виде, размещены на сервере вуза и доступны студентам с любого компьютера, размещенного в компьютерных классах университета.

5.2 Организация самостоятельной работы студента по дисциплине

Самостоятельная работа студента является ключевой составляющей учебного процесса, которая определяет формирование навыков, умений и знаний, приемов познавательной деятельности и обеспечивает интерес к творческой работе.

Цель самостоятельной работы студента при изучении данной дисциплины состоит в:

- углубленном изучении отдельных вопросов теоретической части дисциплины с использованием основной и дополнительной литературы;
- подготовке к экзамену по дисциплине.

Самостоятельная работа студентов по дисциплине включает проработку лекций, чтение обязательной и дополнительной литературы, знакомство с содержанием электронных источников, самоконтроль и взаимоконтроль изучения материала.

Самостоятельная работа выполняется студентом по заданию преподавателя, но без его непосредственного участия.

Видами заданий для внеаудиторной самостоятельной работы студента выступают:

для овладения знаниями:

- чтение текста (учебника, первоисточника, дополнительной литературы, электронных презентаций лекционных материалов); составление плана текста;
- конспектирование текста;
- выписки из текста;
- работа со словарями и справочниками;

- составление отчетов по лабораторным работам;
- использование компьютерной техники и Интернет, и др., для закрепления и систематизации знаний;
- повторная работа над учебным материалом (электронного учебника, первоисточника, дополнительной литературы);
- составление плана и тезисов ответа на вопросы промежуточного тестового контроля; для формирования умений и навыков;
- выполнение дополнительных заданий по лабораторным работам.

Выполнение обучающимися всех видов самостоятельной работы по дисциплине обеспечивается:

- наличием помещений для СРС (компьютерные классы кафедры ИТ: а. 209, 217, 107);
- обеспечением средств вычислительной техники, программного обеспечения (компьютерные классы кафедры ИТ: а. 209, 217, 107);
- наличием учебно-методических материалов со списком рекомендуемой литературы, рекомендаций по решению задач, образцов отчетов о выполнении СРС и т.п.;
- обеспечением учебно-методической и справочной литературой самостоятельной работы (методические указания по выполнению лабораторных работ, контрольных работ).

Данные материалы представлены в электронном виде, размещены на сервере вуза и доступны студентам с любого компьютера, размещенного в компьютерных классах факультета.

Дисциплина обеспечена учебно-методической литературой в объеме, достаточном для проведения всех предусмотренных видов учебных занятий.

Для обеспечения выполнения самостоятельной работы по дисциплине студенты обеспечиваются:

- учебной, учебно-методической и справочной литературой;
- доступом к средствам ИВТ и необходимому программному обеспечению.

Каждый обучающийся обеспечен индивидуальным неограниченным доступом к электронно-библиотечным системам (электронным библиотекам) и электронной информационно-образовательной среде университета. Доступ осуществляется из читальных залов библиотеки, оснащенных оборудованными рабочими местами, из компьютерных классов.

5.3. Особенности преподавания дисциплины

Преподавание дисциплины ведется с применением элементов следующих видов образовательных технологий: Преподавание дисциплины ведется с применением следующих видов образовательных технологий:

- по видам учебной работы:
- лекция-презентация с элементами дискуссии;
- самостоятельная работа студентов;
- организация и проведение консультаций;
- проведение экзамена.

Для проведения лекций занятий используются:

информационные технологии:

- презентации лекций (слайды MS Power Point), используются вовремя лекций;
- использование электронных образовательных ресурсов (электронный конспект, размещенный во внутренней сети) при подготовке к лекциям;
- информационно-коммуникационных технологий, установленных в лабораторных компьютерных классах;
- программного обеспечения;
- контекстное обучение:
- знания, умения, навыки даются не как предмет для запоминания, а в качестве средства решения профессиональных задач.

5.4. Материально-техническое обеспечение дисциплины

1. Лекционные занятия:

- комплект электронных презентаций/слайдов;

- презентационная техника кафедры (проектор, экран, компьютер/ноутбук).
- 2. Практические занятия:
 - комплект электронных презентаций/слайдов;
 - презентационная техника кафедры (проектор, экран, компьютер/ноутбук).
- 3. Лабораторные занятия: компьютерный класс, презентационная техника (проектор, экран, компьютер/ноутбук), пакеты программного обеспечения (ПО) общего назначения (текстовые редакторы, графические редакторы).

Прочее:

- рабочее место преподавателя, оснащенное компьютером с доступом в Интернет;
- рабочие места студентов, оснащенные компьютерами с доступом в Интернет, предназначенные для работы в электронной образовательной среде.

Основная форма занятий – лекции и практические занятия. Кроме того, предполагается большая часть самостоятельной работы студентов по освоению теоретического материала. В процессе аудиторных занятий задействуются преимущества новейших мультимедийных технологий (проектор, ноутбук, экран).

При организации занятий, текущей и промежуточной аттестации с применением электронного обучения и дистанционных образовательных технологий используются различные электронные образовательные ресурсы и онлайн сервисы, входящие в состав ЭИОС СГУ.

Таблица 6 – Перечень программного обеспечения

№	Перечень ПО
1	<i>Microsoft Windows</i>
2	<i>Архиватор 7-zip.</i>
3	<i>Справочно-правовая система Консультант Плюс</i>

При организации занятий, текущей и промежуточной аттестации с применением электронного обучения и дистанционных образовательных технологий используются различные электронные образовательные ресурсы и онлайн сервисы, входящие в состав ЭИОС СГУ.

5.5.Методическое обеспечение образовательного процесса для обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья

Условия организации и содержание обучения и контроля знаний инвалидов и обучающихся с ОВЗ по дисциплине определяются программой дисциплины, адаптированной при необходимости для обучения указанных обучающихся.

Организация обучения, текущей и промежуточной аттестации студентов-инвалидов и студентов с ОВЗ осуществляется с учетом особенностей психофизического развития, индивидуальных возможностей и состояния здоровья таких обучающихся.

Исходя из психофизического развития и состояния здоровья студентов-инвалидов и студентов с ОВЗ, организуются занятия совместно с другими обучающимися в общих группах, используя социально-активные и рефлексивные методы обучения создания комфортного психологического климата в студенческой группе или, при соответствующем заявлении такого обучающегося, по индивидуальной программе, которая является модифицированным вариантом основной рабочей программы дисциплины. При этом содержание программы дисциплины не изменяется. Изменяются, как правило, формы обучения и контроля знаний, образовательные технологии и дидактические материалы.

Обучение студентов-инвалидов и студентов с ОВЗ также может осуществляться индивидуально и/или с применением дистанционных технологий.

Дистанционное обучение обеспечивает возможность коммуникаций с преподавателем, а также с другими обучаемыми посредством вебинаров (например, с использованием программы Skype), что способствует сплочению группы, направляет учебную группу на совместную работу, обсуждение, принятие группового решения.

В учебном процессе для повышения уровня восприятия и переработки учебной информации студентов-инвалидов и студентов с ОВЗ применяются мультимедийные и специализированные технические средства приема-передачи учебной информации в доступных

формах для студентов с различными нарушениями, обеспечивается выпуск альтернативных форматов печатных материалов (крупный шрифт), электронных образовательных ресурсов в формах, адаптированных к ограничениям здоровья обучающихся, наличие необходимого материально-технического оснащения.

Подбор и разработка учебных материалов производится преподавателем с учетом того, чтобы студенты с нарушениями слуха получали информацию визуально, с нарушениями зрения – аудиально (например, с использованием программ-синтезаторов речи).

Для осуществления процедур текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся инвалидов и лиц с ОВЗ фонд оценочных средств по дисциплине, позволяющий оценить достижение ими результатов обучения и уровень сформированности компетенций, предусмотренных учебным планом и рабочей программой дисциплины, адаптируется для обучающихся инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья с учетом индивидуальных психофизиологических особенностей (устно, письменно на бумаге, письменно на компьютере, в форме тестирования и т.п.). При необходимости обучающимся предоставляется дополнительное время для подготовки ответа при прохождении аттестации

**Приложение к рабочей программе дисциплины
09.03.03 Прикладная информатика, Цифровые технологии в аналитической деятельности**

АННОТАЦИЯ

рабочей программы дисциплины

Основы фундаментального и технического анализа

дисциплина к дисциплинам части учебного плана, формируемой участниками образовательных отношений.

Очная форма обучения

Общая трудоемкость дисциплины (ЗЕТ / час.)	6/216
Цель изучения дисциплины	привить студентам навыки по вопросам принятия инвестиционных решений как на основе анализа фундаментальных показателей макросреды, отраслевой динамики и специфических характеристик публичных компаний (ключевых финансовых коэффициентов, структуры собственного капитала, качества корпоративного управления), делающих их привлекательными в глазах рыночных инвесторов, так и на основе анализа графического поведения цен.
Содержание дисциплины	Фундаментальный анализ; Основные понятия и предпосылки фундаментального анализа. ; Особенности аналитической работы на финансовых рынках; Два направления проведения фундаментального анализа: «сверху-вниз» и «снизу- вверх». ; Сравнительный подход в фундаментальном анализе для сопоставления фондовых рынков и отдельных акций; Моделирование положения инвестора и ценообразование финансовых активов.; Анализ ликвидности акций; Технический анализ ; Основные понятия, постулаты и предпосылки технического анализа; Основные понятия графического анализа ценных бумаг; Тенденции на рынке ценных бумаг и принципы их выявления; Графические фигуры как метод технического анализа; Индикаторы как метод технического анализа ценных бумаг; Осцилляторы как метод технического анализа ценных бумаг; Специальные методы технического анализа ценных бумаг; Экзамен
Формируемые компетенции (коды)	ПК-4; ПК-6; ПК-8
Коды и наименование индикатора достижения компетенции	ПК-8.1 Демонстрирует знание правовых основ охраны объектов интеллектуальной собственности, актуальной нормативной, научно-технической, охранной документации в области информационных технологий и методов определения патентной чистоты; ПК-4.2 Описывает и согласовывает архитектуру системы; целевые показатели объекта автоматизации; рекомендуемые решения; ПК-6.1 Выявляет бизнес-проблемы и бизнес-возможности с использованием современных ИКТ; ПК-6.2 Формирует возможные решения на основе системы целевых показателей; ПК-6.3 Анализирует и обосновывает выбор управленческих решений
Дисциплины, участвующие в формировании компетенции	Бизнес-планирование Введение в машинное обучение Государственное регулирование использования цифровой экономики Интеллектуальные информационные системы Интернет-маркетинг в цифровой среде Информационные системы в бухгалтерском учете и налогообложении Информационные системы управления производственной компанией Математическое и имитационное моделирование Научно-исследовательская работа Правовые основы интеллектуальной собственности Преддипломная практика Предметно-ориентированные экономические информационные системы Проектный практикум

	Системы поддержки принятия решений Современный инструментарий бизнес-аналитики Цифровые финансы Эконометрика Экономика информационных систем Экономико-математическое моделирование Экономическая теория (продвинутый уровень) Электронная коммерция и цифровые рынки Электронные платежные системы
Образовательные технологии	- Лекция; Практическая работа, Лабораторная работа; Самостоятельная работа студента
Форма промежуточной аттестации	Экзамен