

АННОТАЦИЯ

дисциплины Б1.В.04 «Технический и фундаментальный анализ на валютном и фондовом рынках»

Объем трудоемкости: 3 зачетные единицы (108 часа, из них контактная работа – 38,3 ч., в том числе 38 часов аудиторной нагрузки: лекционных 6 ч., практических 32 ч.; ИКР – 0,3 ч.; 43 час. самостоятельной работы).

Цель дисциплины:

Состоит в изучении возможностей использования технического и фундаментально-го анализа для оценки результатов и эффективности финансово-хозяйственной деятельности, существующих финансово-экономических рисков, обоснования прогноза динамики основных финансово-экономических показателей организаций различных организационно-правовых форм.

Задачи дисциплины:

- 1) познание понятий и терминов технического и фундаментального анализа;
- 2) рассмотрение основ технического и фундаментального анализа с выделением основных гипотез и постулатов;
- 3) выявление основных факторов, определяющих «справедливую» цену финансовых активов с помощью основных финансово-экономических показателей, используемых в рамках фундаментального анализа на микро-, макро-, мезоуровне, на основе которых можно обосновать прогноз их динамики;
- 4) рассчитывать и интерпретировать коэффициенты и индикаторы, необходимые для определения справедливой стоимости финансовых инструментов, на основе проведенного анализа прогнозировать возможные изменения рыночной стоимости активов и выстраивать собственную стратегию для оценки текущей, кратко- и долгосрочной финансовой устойчивости организации, в том числе кредитной.
- 5) формирование практических навыков применения графических моделей прогнозирования на фондовом и валютном рынке.

Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Технический и фундаментальный анализ на валютном и фондовом рынках» относится к вариативной части Блока 1 «Дисциплины (модули)» учебного плана по направлению 38.04.08 «Финансы и кредит», «Банки и банковская деятельность», читается в семестре В 2 курса.

Дисциплина опирается на знания и навыки, приобретенные в результате изучения дисциплин: «Развитие рынка банковских услуг» «Банковский менеджмент», «Теория финансовых кризисов».

Знания, полученные при освоении дисциплины, применяются в процессе изучения дисциплин «Инновации в банках», «Банковские риски», при написании магистерской диссертации и в последующей практической деятельности.

Требования к уровню освоения дисциплины

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

№ п.п	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	уметь	владеть

№ п.п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	уметь	владеть
1	ПК - 4	способность провести анализ и дать оценку существующих финансово-экономических рисков, составить и обосновать прогноз динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро- и мезоуровне	- основные финансово-экономические показатели, используемые в рамках фундаментального и технического анализа на микро-, макро-, мезоуровне, на основе которых разрабатывается прогноз их динамики; - методики количественной оценки системных и несистемных рисков на фондовом рынке	- рассчитывать показатели, характеризующие существующие финансово-экономические риски, проводить их анализ и оценку	- навыками расчетов показателей риска операций на валютном и фондовом рынках
2	ПК - 5	способность на основе комплексного экономического анализа и финансового анализа дать оценку результатов и эффективности финансово-хозяйственной деятельности организаций различных организационно-правовых форм, включая финансово-кредитные, органов государственной власти и местного самоуправления	- показатели, характеризующие эффективность финансово-хозяйственной деятельности различных организаций, используемые в рамках сравнительного подхода фундаментального анализа	-сформировать набор показателей для оценки результатов и эффективности финансово-хозяйственной деятельности публичных акционерных обществ	- навыками оценки ценных бумаг различных организаций на основе результатов и эффективности их финансово-хозяйственной деятельности с использованием комплексного экономического анализа
3	ПК-6	способность дать оценку текущей, краткосрочной и долгосрочной финансовой устойчивости организации, в	- основные подходы к оценке ценных бумаг и других инвестиционных инструментов, включая основные методики проведе-	- рассчитывать и интерпретировать коэффициенты и индикаторы, необходимые для определения справедливой	- навыками использования трейдинговых программ для проведения инвестици-

№ п.п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	уметь	владеть
		том числе кредитной	ния фундаментального анализа на основе бухгалтерской отчетности и технического анализа на базе графической интерпретации рыночной конъюнктуры	стоимости финансовых инструментов; - на основе проведенного анализа прогнозировать возможные изменения рыночной стоимости активов и выстраивать собственную стратегию для оценки текущей, кратко- и долгосрочной финансовой устойчивости организации, в том числе кредитной	онных стратегий на фондовом рынке на основе индикаторов технического анализа

Основные разделы дисциплины

№ раздела	Наименование разделов	Количество часов			
		Всего	Аудиторная работа		Самостоятельная работа
			Л	ПЗ	
1	2	3	4	5	6
1.	Основные направления инвестиционного анализа на финансовом рынке	11	2	4	5
2.	Теоретические основы фундаментального анализа	12	2	4	6
3.	Фундаментальные корпоративные ценности	10	-	4	6
4.	Принципы и основы технического анализа	12	2	4	6
5.	Теория фондового рынка Доу и индексы Доу-Джонса	6	-	2	4
6.	Графический анализ финансового рынка	10	-	6	4
7.	Осцилляторы и интерпретация их сигналов	10	-	4	6
8.	Технический анализ и стратегии инвесторов	10	-	4	6
	<i>Всего</i>		6	32	43

Курсовые работы: не предусмотрены

Форма проведения аттестации по дисциплине: экзамен

Основная литература

1. Цибульникова, В.Ю. Фундаментальный анализ рынка ценных бумаг : учебное пособие / В.Ю. Цибульникова ; Министерство образования и науки Российской Федерации, Томский Государственный Университет Систем Управления и Радиоэлектроники (ТУ-СУР). - Томск : Эль Контент, 2013. - 226 с. : ил. - Библиогр.: 213-214. - ISBN 978-5-4332-0097-5 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=480526>

2. Найман, Э. Малая энциклопедия трейдера / Э. Найман ; ред. М. Савиной. - 15-е изд. - Москва : Альпина Паблишерз, 2016. - 458 с. : схем., табл. - Библиогр. в кн. - ISBN 978-5-9614-5167-2 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=279698>

Автор РПД

Пучкина Е.С.