

**АННОТАЦИЯ**  
**дисциплины Б1.В.03.**  
**«Технический и фундаментальный анализ финансовых рынков»**

Направление подготовки 38.04.08 – Финансы и кредит

Направленность (профиль) / специализация "Финансы в цифровой экономике"

Форма обучения - очная

**Объем трудоемкости:** 3 зачетные единицы (108 часа, из них – 36,3 ч. контактной работы, в том числе 36 часа аудиторной нагрузки: лекционных 6 ч., практических 30ч.; ИКР- 0,3 ч; 45 часов самостоятельной работы, 26,7 часов - контроль)

**Цель дисциплины:**

Цель дисциплины - сформировать у обучающихся современные компетенции в области использования технического и фундаментального анализа финансовых рынков для осуществления инвестиционной деятельности и разработки стратегии поведения в условиях существующего инфокоммуникационного обеспечения.

**Задачи дисциплины:**

1) изучить научные подходы к проведению технического и фундаментального анализа на финансовом рынке, формированию информационной базы исследования, отбору и верификации информации.

2) овладеть основами расчета и интерпретации коэффициентов и индикаторов, необходимые для определения справедливой стоимости финансовых инструментов, на основе проведенного анализа прогнозировать возможные изменения рыночной стоимости активов

3) изучить основные постулаты, гипотезы, методы проведения технического и фундаментального анализа на финансовом рынке

4) сформировать компетенции по проведению оценки стоимости финансовых инструментов с помощью графического анализа и методов фильтрации

5) выработать навыки использования трейдинговых программ, для анализа и систематизации информации по теме исследования, проведения фундаментального и технического анализа.

**Место дисциплины в структуре ООП ВО**

Настоящая дисциплина относится к дисциплинам вариативной части, обеспечивающим профессиональную подготовку магистра Блока 1 учебного плана по направлению подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит» направленность Финансы в цифровой экономике (квалификация (степень) «магистр»). Дисциплина предназначена для студентов первого года обучения магистерской программы «Финансы и кредит», читается в 1 семестре и занимает одно из ключевых мест в этом блоке магистерской программы.

Для ее успешного освоения слушатель должен владеть основами экономических знаний, а также элементарными навыками математической и компьютерной обработки данных. Материал курса базируется на содержании дисциплин бакалаврского уровня: «Инвестиции», «Экономический анализ», «Рынок ценных бумаг и биржевое дело» и тесно связан с дисциплинами магистерского уровня такими как «Финансовый анализ (продвинутый уровень)», «Биржевая торговля и биржевые инструменты», «Производные финансовые инструменты: анализ рынка, хеджирование и арбитраж» и др.

В свою очередь, данный курс служит фундаментом для успешного освоения таких дисциплин, как «Управление инвестиционным портфелем финансовых активов», «Биржевая торговля и биржевые инструменты», «Производные финансовые инструменты: анализ рынка, хеджирование и арбитраж», «Оценка стоимости компании», проведения НИР, под-

готовки магистерских диссертаций и в последующей практической деятельности магистрантов.

### Требования к уровню освоения дисциплины

Изучение данной учебной дисциплины направлено на формирование у обучающихся профессиональных компетенций

№ п.п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	уметь	владеть
1.	ПК-3	способностью разработать и обосновать финансово-экономические показатели, характеризующие деятельность коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно-правовых форм, включая финансово-кредитные, органов государственной власти и местного самоуправления и методики их расчета	- показатели, характеризующие эффективность финансово-хозяйственной деятельности различных коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно-правовых форм, включая финансово-кредитные используемые в рамках сравнительного подхода фундаментального анализа	-сформировать набор показателей для оценки результатов и эффективности финансово-хозяйственной деятельности публичных акционерных обществ, включая финансово-кредитные	- навыками оценки ценных бумаг с помощью финансово-экономических показателей, различных организаций на основе результатов эффективности их финансово-хозяйственной деятельности с использованием цифровых технологий
2.	ПК-4	способностью провести анализ и дать оценку существующих финансово-экономических рисков, составить и обосновать прогноз динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро- и	- основные финансово-экономические показатели, используемые в рамках фундаментального и технического анализа на микро, макро, мезуровне, на основе которых разрабатывается прогноз их динамики; - методики количественной оценки системных и несистемных	- рассчитывать показатели, характеризующие существующие финансово-экономические риски, проводить их анализ и оценку на основе обоснования прогноза динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро-	способностью провести анализ и дать оценку существующих финансово-экономических рисков и обоснования прогноза динамики основных финансово-экономических показателей с использованием цифровых и информационных технологий на микро-, макро- и

№ п.п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	уметь	владеть
		мезоуровне	рисков на фондовом рынке		мезоуровне
3.	ПК-19	способностью осуществлять сбор, обработку, анализ и систематизацию информации по теме исследования, выбор методов и средств решения задач исследования	- основные подходы к сбору информации о ценных бумагах и других инвестиционных инструментов, включая основные методики проведения инвестиционного анализа в условиях цифровизации	- осуществлять выбор методики для проведения фундаментального и технического анализа для решения поставленной задачи	- навыками использования трейдинговых программ, для анализа и систематизации информации по теме исследования

#### Основные разделы дисциплины:

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины.  
Разделы дисциплины, изучаемые в 1 семестре

№ раздела	Наименование разделов	Количество часов				
		Всего	Аудиторная работа			Самостоятельная работа
			Л	ПЗ	ЛР	
1	2	3	4	5	6	7
1.	Основные направления инвестиционного анализа на финансовом рынке в условиях цифровизации	12	1	4	-	7
2.	Теоретические основы фундаментального анализа	14	1	4		9
3.	Фундаментальные корпоративные ценности и методика проведения фундаментального анализа	20	2	8	-	10
4.	Принципы и основы технического анализа	16	1	6	-	9
5.	Графический анализ финансового рынка. Осцилляторы и интерпретация их сигналов	19	1	8	-	10
	<i>Итого по дисциплине:</i>	-	6	30	-	45

**Лабораторный практикум** - не предусмотрен.

**Курсовые проекты или работы:** не предусмотрены

**Форма проведения аттестации по дисциплине:** экзамен

#### Основная литература:

1. 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>

2. Рохлин, Д.Б. Основы стохастического анализа : учебное пособие : [16+] / Д.Б. Рохлин ; Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования «Южный федеральный университет». – Ростов-на-Дону ; Таганрог : Южный федеральный университет, 2019. – 190 с. – Режим доступа: по подписке. – URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=577901> (дата обращения: 21.06.2020). – Библиогр. в кн. – ISBN 978-5-9275-3132-5. – Текст : электронный.

3. Шапкин, А.С. Экономические и финансовые риски: оценка, управление, портфель инвестиций / А.С. Шапкин, В.А. Шапкин. – 9-е изд. – Москва : Дашков и К°, 2018. – 544 с. : ил. – Режим доступа: по подписке. – URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=496079> (дата обращения: 21.06.2020). – Библиогр.: с. 531-536. – ISBN 978-5-394-02150-3. – Текст : электронный.

4. Дамодаран, А. Инвестиционная оценка: инструменты и методы оценки любых активов / А. Дамодаран ; Д. Липинский, И. Розмаинский, А. Скоробогатов ; науч. ред. Е. Сквирская и др. – 5-е изд. – Москва : Альпина Паблишер, 2016. – 1339 с. : схем., табл. – Режим доступа: по подписке. – URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=279385> (дата обращения: 21.06.2020). – Библиогр.: с. 1277-1294. – ISBN 978-5-9614-0802-7. – Текст : электронный.

Автор РПД

Пучкина Е.С.