

**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 - заочная

**Объем трудоемкости:** 3 зачетные единицы (108 часа, из них – 12,3 ч. контактной работы, в том числе 12 часа аудиторной нагрузки: лекционных 2 ч., практических 10 ч.; 87 часов самостоятельной работы, 8,7 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, подготовки 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                                                                                                                         | - основные финансово-экономические показатели, используемые в рамках фундаментального и технического анализа на микро, макро, мезуровне, на основе которых разрабатывается прогноз их динамики; - методики                                                                     | - рассчитывать показатели, характеризующие существующие финансово-экономические риски, проводить их анализ и оценку на основе обоснования прогноза динамики основных финансово-экономических показателей на | способностью провести анализ и дать оценку существующих финансово-экономических рисков и обоснования прогноза динамики основных финансово-экономических показателей с использованием цифровых технологий             |

| № п.п. | Индекс компетенции | Содержание компетенции (или её части)                                                                                                                  | В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны                                                                                                                       |                                                                                                                      |                                                                                                              |
|--------|--------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        |                    |                                                                                                                                                        | знать                                                                                                                                                                             | уметь                                                                                                                | владеть                                                                                                      |
|        |                    | на микро-, макро- и мезоуровне                                                                                                                         | количественной оценки системных и несистемных рисков на фондовом рынке                                                                                                            | микро-, макро-                                                                                                       | информационных технологий на микро-, макро- и 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 инструментах, 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 | 17               | 1                 | 2  | -  | 14                     |
| 2.        | Теоретические основы фундаментального анализа                                            | 20               | -                 | 2  |    | 18                     |
| 3.        | Фундаментальные корпоративные ценности и методика проведения фундаментального анализа    | 20               | 1                 | 2  | -  | 17                     |
| 4.        | Принципы и основы технического анализа                                                   | 20               | -                 | 2  | -  | 18                     |
| 5.        | Графический анализ финансового рынка. Осцилляторы и интерпретация их сигналов            | 22               | -                 | 2  | -  | 20                     |
|           | <i>Итого по дисциплине:</i>                                                              | -                | 2                 | 10 | -  | 87                     |

**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.

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.