ЮЖНО-УРАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

УТВЕРЖДАЮ:
Заведующий выпускающей кафедрой

ЮУрГУ
Электронный документ, подписанный ПЭП, хранится в системе электронного документооборота Южно-Уральского государственного университета
СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПЭП
Кому выдан: Соловьева И. А.
Пользователь: solovevaia
Дата подписания: 11.05.2023

И. А. Соловьева

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины 1.Ф.М0.13.02 Биржевой трейдинг
для направления 38.04.08 Финансы и кредит
уровень Магистратура
магистерская программа Финансовые рынки и институты
форма обучения очная
кафедра-разработчик Экономика и финансы

Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит, утверждённым приказом Минобрнауки от 12.08.2020 № 991

Зав.кафедрой разработчика,
д.экон.н., доц.

ЮУрГУ
Электронный документ, подписанный ПЭП, хранится в системе электронного документооборота Южно-Уральского государственного университета
СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПЭП
Кому выдан: Соловьева И. А.
Пользователь: solovevaia
Дата подписания: 11.05.2023

И. А. Соловьева

Разработчик программы,
к.экон.н., доцент

ЮУрГУ
Электронный документ, подписанный ПЭП, хранится в системе электронного документооборота Южно-Уральского государственного университета
СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПЭП
Кому выдан: Кандауров Д. В.
Пользователь: kandaurovdv
Дата подписания: 10.05.2023

Д. В. Кандауров

Челябинск

1. Цели и задачи дисциплины

Учебный курс посвящен комплексному системному изучению особенностей функционирования рынка ценных бумаг, изучению механизмов анализа и прогнозирования рыночных трендов на мировых финансовых рынках и осуществлению сделок с финансовыми инструментами по результатам проведенного анализа. В рамках дисциплины «Биржевой трейдинг» анализируя широкий спектр проблем фондового рынка в российских условиях, систематизируются основные знания о механизме функционирования, технике операций на рынке ценных бумаг. Особое внимание уделено вопросам моделирования и прогнозирования динамики торгов на фондовых биржах, как основному механизму разработки финансовых инвестиционных стратегий. Значительное внимание уделяется методам анализа и прогнозирования рынка акций. Задачами дисциплины являются: –изучение методов биржевой торговли; –изучение рыночных циклов; –изучение методов анализа ситуации на рынке ценных бумаг; –построение прогнозных моделей рынка; –исследование индикаторов и осцилляторов рынка; –анализ и прогнозирование по ценовым фигурам тренда; –построение торговых стратегий.

Краткое содержание дисциплины

Биржевой трейдинг опирается на технический анализ и представляет собой вид деятельности по выработке и реализации решений о покупке и продажи финансовых активов на основе исторической информации о результатах торгов. В настоящее время все специалисты, работающие на финансовом рынке, так или иначе должны быть знакомы с принципами технического анализа и совершения сделок на финансовом рынке. Особую практическую значимость этот комплекс знаний, умений и навыков представляет для трейдеров и технических (количественных) аналитиков. Технический анализ на финансовых рынках развивается достаточно длительное время (с начала XX века), на протяжении своего развития постепенно менялись методы, применяемые аналитиками для принятия решений о покупке и продажи финансовых инструментов. Исторически, самым первым методом технического анализа является графический анализ. Позже аналитик начали прибегать к расчету специальных индикаторов и осцилляторов. Самым современным методом технического анализа можно считать количественный (эконометрический) анализ, в основе которого лежит построение статистических математических моделей движения цен. В настоящем курсе рассматриваются все три метода технического анализа, с использованием учебного биржевого счета студенты осваивают навыки биржевого трейдинга.

2. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины

Планируемые результаты освоения ОП ВО (компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине
ПК-5 Способен оказывать консалтинговые услуги по формированию целевого инвестиционного портфеля, направленного на совершенствование финансовой деятельности клиента (ПК-5)	Знает: основные разновидности стратегий трейдинга, основные источники информации о ценах на финансовые активы, об эмитентах и их финансовом положении Умеет: применять методы трейдинга в процессе формирования инвестиционного портфеля

	клиента; оценивать затраты на проведение финансовых операций Имеет практический опыт: корректировки трейдинговой стратегии с целью оптимизации целевого инвестиционного портфеля клиента

3. Место дисциплины в структуре ОП ВО

Перечень предшествующих дисциплин, видов работ учебного плана	Перечень последующих дисциплин, видов работ
Производственная практика (практика по профилю профессиональной деятельности) (2 семестр), Учебная практика (ознакомительная) (2 семестр)	Технический анализ финансовых рынков, Управление инвестиционным портфелем, Фундаментальный анализ рынков и экономических агентов, Производственная практика (научно-исследовательская работа) (4 семестр), Производственная практика (преддипломная) (4 семестр)

Требования к «входным» знаниям, умениям, навыкам студента, необходимым при освоении данной дисциплины и приобретенным в результате освоения предшествующих дисциплин:

Дисциплина	Требования
Учебная практика (ознакомительная) (2 семестр)	Знает: основные методы, формы и приемы учебного процесса в высшей школе, включая методы активного обучения; методы проведения самооценки; критерии приоритезации видов собственной деятельности на основе результатов самооценки, способы самосовершенствования за счет участия в учебной деятельности, основные методы, формы и приемы учебного процесса в высшей школе, включая методы активного обучения; приемы критического анализа методов и форм активного обучения, с точки зрения адаптации к особенностям, целям и задачам изучаемой дисциплины, основы составления бюджетов и финансовых планов, финансовой политики и стратегии брокерско-дилерских организаций на финансовом рынке, основные виды ценных бумаг: акции и облигации, основные отличия между ними, их роль в формировании диверсифицированного инвестиционного портфеля, основные виды брокерско-дилерских организаций и их отличия, основные формы организации финансовых служб финансовых институтов, реализующих различные брокерско-дилерские функции, основные виды финансовых планов и бюджетов участников финансового рынка, принципы установления обменных курсов иностранных валют, модели и методы оценки стоимости основных видов ценных бумаг, обращающихся на мировом финансовом рынке. Умеет:

	проводить самооценку, использовать выбранные критерии для установления приоритетов собственной деятельности и ее совершенствования за счет участия в учебном процессе, проводить критический анализ возможных проблемных ситуаций в процессе обучения студентов на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий, формировать бюджет и разрабатывать основные разделы стратегии развития участников рынка ценных бумаг, проводить финансовые расчеты при оценке эффективности инвестиций, используя теорию временной ценности денег, аннуитетов, простых и сложных процентов, применять методы финансово-аналитической работы при оценке направлений развития брокерско-дилерской организации, организовать брокерско-дилерскую деятельность в рамках конкретного типа финансовых институтов; оценивать доходность основных финансовых инструментов , основные сегменты финансового рынка и возможные риски участия в инвестиционных процессах, определять цели финансовых планов по инвестированию, выбирать инвестиционные инструменты, определять подходящую стратегию инвестирования на мировых финансовых рынках Имеет практический опыт: реализации различных методов, форм и приемов учебного процесса в высшей школе, использования умения проведения критического анализа проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий в разрабатываемых активных формах обучения, корректировки бюджетов и финансовых планов, внесения изменений в политику и стратегию развития институциональных инвесторов, оценки доходности инвестиций различных видов, контролирования результатов финансово-экономической деятельности брокерско-дилерских организаций, анализа норм правого регулирования деятельности брокерско-дилерской организаций в РФ и мире, расчета размера инвестиций, необходимых для достижения целей клиента, получения, интерпретации и документирования результатов исследования мировых финансовых рынков при формировании финансового плана клиента
Производственная практика (практика по профилю профессиональной деятельности) (2 семестр)	Знает: основы проектного управления, понятие проекта и его жизненного цикла, этапы жизненного цикла проекта и задачи каждого из них, методы управления проектом на каждом этапе его жизненного цикла, системный подход и его применение в критических ситуациях, методы моделирования стоимости финансовых инструментов, необходимые для формирования

	целевого инвестиционного портфеля, основное назначение финансового планирования на финансовых рынках Умеет: разработать оптимальный жизненный цикл проекта, характеристику его стадий, планировать задачи каждой стадии, строить дерево целей проекта , вырабатывать стратегию действий в профессиональной сфере при возникновении сложных ситуаций на финансовых рынках, использовать расчетные финансовые таблицы и калькуляторы, методы планирования на финансовых рынках, способы повышения точности прогнозов Имеет практический опыт: планирования проекта с использованием сетевых графиков и диаграммы Ганта, реализации упреждающих мероприятий для выхода из критических ситуаций на финансовых рынках, подбора производных ценных бумаг для целевого инвестиционного портфеля на основе сбора и анализа информации о рынке финансовых инструментов, финансового моделирования финансовых инструментов, составления бюджета и финансового плана по заданию клиента

4. Объём и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 з.е., 108 ч., 54,25 ч. контактной работы

Вид учебной работы	Всего часов	Распределение по семестрам в часах
		Номер семестра
		3
Общая трудоёмкость дисциплины	108	108
Аудиторные занятия:	48	48
Лекции (Л)	16	16
Практические занятия, семинары и (или) другие виды аудиторных занятий (ПЗ)	32	32
Лабораторные работы (ЛР)	0	0
Самостоятельная работа (СРС)	53,75	53,75
Подготовка к зачету	15	15
Подготовка к практическим занятиям	38,75	38.75
Консультации и промежуточная аттестация	6,25	6,25
Вид контроля (зачет, диф.зачет, экзамен)	-	зачет

5. Содержание дисциплины

№ раздела	Наименование разделов дисциплины	Объем аудиторных занятий по видам в часах			
		Всего	Л	ПЗ	ЛР

1	Графический анализ	24	8	16	0
2	Математическое моделирование динамики цен	24	8	16	0

5.1. Лекции

№ лекции	№ раздела	Наименование или краткое содержание лекционного занятия	Кол-во часов
1	1	Графики и трендовые индикаторы	2
2	1	Фигуры разворота	2
3	1	Консолидация, гэпы, уровни поддержки и сопротивления	2
4	1	Индикаторы и осцилляторы	2
5	2	Основы анализа временных рядов, случайные процессы	2
6	2	Авторегрессионные модели	2
7	2	Модели волатильности	2
8	2	Высокочастотная торговля	2

5.2. Практические занятия, семинары

№ занятия	№ раздела	Наименование или краткое содержание практического занятия, семинара	Кол-во часов
1	1	Графики и трендовые индикаторы	4
2	1	Фигуры разворота	4
3	1	Консолидация, гэпы, уровни поддержки и сопротивления	4
4	1	Тактики торговли на основе индикаторов и осцилляторов	4
5	2	Основы анализа временных рядов, случайные процессы	4
6	2	Авторегрессионные модели	4
7	2	Модели волатильности	4
8	2	Высокочастотная торговля акциями и фьючерсами	4

5.3. Лабораторные работы

Не предусмотрены

5.4. Самостоятельная работа студента

Выполнение СРС			
Подвид СРС	Список литературы (с указанием разделов, глав, страниц) / ссылка на ресурс	Семестр	Кол-во часов
Подготовка к зачету	Рынок ценных бумаг : учебник для вузов / Н. И. Берзон [и др.] ; под общей редакцией Н. И. Берзона. — 5-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 514 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-11196-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/488591	3	15
Подготовка к практическим занятиям	Рынок ценных бумаг : учебник для вузов /	3	38,75

	Н. И. Берзон [и др.] ; под общей редакцией Н. И. Берзона. — 5-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 514 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-11196-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/488591		

6. Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации

Контроль качества освоения образовательной программы осуществляется в соответствии с Положением о балльно-рейтинговой системе оценивания результатов учебной деятельности обучающихся.

6.1. Контрольные мероприятия (КМ)

№ КМ	Се-местр	Вид контроля	Название контрольного мероприятия	Вес	Макс. балл	Порядок начисления баллов	Учи-тыва-ется в ПА
1	3	Текущий контроль	Тест 1 - Графический анализ	1	10	Компьютерное тестирование в системе Электронный ЮУрГУ 2.0. Тест состоит из 10 вопросов, время, отводимое на тестирование - 10 минут. При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179) Правильный ответ на вопрос соответствует 1 баллу. Неправильный ответ на вопрос соответствует 0 баллов. Максимальное количество баллов - 10.	зачет
2	3	Текущий контроль	Тест 2 - Технические индикаторы	1	10	Компьютерное тестирование в системе Электронный ЮУрГУ 2.0. Тест состоит из 10 вопросов, время, отводимое на тестирование - 10 минут. При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179) Правильный ответ на вопрос соответствует 1 баллу. Неправильный ответ на вопрос соответствует 0 баллов. Максимальное количество баллов - 10.	зачет
3	3	Текущий контроль	Задание - Торговля по индикаторам	1	5	Студенту выдается задание - провести 3 сделки, используя индикаторы	зачет

						технического анализа, отчет о выполнении задания студент прикрепляет в электронный ЮУрГУ 2.0. При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179) Критерии оценивания: - задание выполнено в полном объеме, качественно оформлено - 5 баллов; - задание выполнено не полностью либо оформлено не качественно - 4 балла; - задание выполнено поверхностно, и не оформлено - 3 балла; - задание выполнено верно лишь частично, в части задания имеются грубые ошибки в расчетах – 2 балла; - задание не выполнено - 0 баллов. Максимальное количество баллов – 5 за задание.	
4	3	Текущий контроль	Задание - Алгоритмическая торговля с использованием технических индикаторов	1	5	Студенту выдается задание - создать торгового робота, используя индикаторы технического анализа, протестировать его работу, отчет о выполнении задания студент прикрепляет в электронный ЮУрГУ 2.0. При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179) Критерии оценивания: - задание выполнено в полном объеме, качественно оформлено - 5 баллов; - задание выполнено не полностью либо оформлено не качественно - 4 балла; - задание выполнено поверхностно, и не оформлено - 3 балла; - задание выполнено верно лишь частично, в части задания имеются грубые ошибки в расчетах – 2 балла; - задание не выполнено - 0 баллов. Максимальное количество баллов – 5 за задание.	зачет
5	3	Проме-жуточная аттестация	Экзамен (тест и задание)	-	20	Промежуточная аттестация включает решение теста и выполнения задания. Тест состоит из 10 вопросов, по 1 баллу за каждый правильный ответ. Задание: привести примеры использования 5 технических индикаторов (на выбор) для совершения сделок на валютном рынке (максимально число баллов - 10). Критерии оценивания (по каждому рассмотренному индикатору	зачет

						технического анализа): - верно описаны торговые сигналы технического индикатора (1 балл); - верно представлен пример использования технического индикатора, подтвержденный скриншотом из терминала Metatrader 5 (1 балл).	

6.2. Процедура проведения, критерии оценивания

Вид промежуточной аттестации	Процедура проведения	Критерии оценивания
зачет	На зачете происходит оценивание знаний, умений и приобретенного опыта обучающихся по дисциплине на основе полученных оценок за контрольно-рейтинговые мероприятия текущего контроля. Прохождение контрольного мероприятия промежуточной аттестации не является обязательным для студента. При недостаточной и/или не устраивающей студента величине рейтинга ему может быть предложено пройти контрольно-рейтинговое мероприятие промежуточной аттестации. На выполнение теста из 10 вопросов отводится 20 минут. На выполнение задания отводится 40 минут. Суммарное время для выполнения всех заданий экзамена составляет 60 минут. Максимальное количество баллов за промежуточную аттестацию – 20 (10 за тест и 10 за задание). В результате складывается совокупный рейтинг студента, который дифференцируется в оценку и проставляется в ведомость, зачетную книжку студента.	В соответствии с пп. 2.5, 2.6 Положения

6.3. Паспорт фонда оценочных средств

Компетенции	Результаты обучения	№ КМ				
		1	2	3	4	5
ПК-5	Знает: основные разновидности стратегий трейдинга, основные источники информации о ценах на финансовые активы, об эмитентах и их финансовом положении	+	+			+
ПК-5	Умеет: применять методы трейдинга в процессе формирования инвестиционного портфеля клиента; оценивать затраты на проведение финансовых операций	+	+	+	+	+
ПК-5	Имеет практический опыт: корректировки трейдинговой стратегии с целью оптимизации целевого инвестиционного портфеля клиента			+	+	+

Типовые контрольные задания по каждому мероприятию находятся в приложениях.

7. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

Печатная учебно-методическая документация

а) основная литература:

1. Дегтярева, О. И. Биржевое дело [Текст] учебник для вузов по специальности 080301 "Коммерция (Торговое дело)" О. И. Дегтярева ; Моск.

гос. ин-т междунар. отношений (ун-т) МИД РФ. - М.: Магистр : Инфра-М, 2011. - 623 с. ил., табл.

2. Рынок ценных бумаг и биржевое дело Учеб. для вузов О. И. Дегтярева, Н. М. Коршунов, Е. Ф. Жуков и др.; Под ред. О. И. Дегтяревой и др. - М.: ЮНИТИ, 2004. - 499,[2] с.

3. Рынок ценных бумаг [Текст] учебник для вузов по экон. специальностям Е. Ф. Жуков, Л. Т. Литвиненко, А. В. Печникова и др.; под ред. Е. Ф. Жукова. - 2-е изд., перераб. и доп. - М.: ЮНИТИ, 2007. - 463 с. ил.

4. Каримова, Т. Г. Рынок ценных бумаг Учеб. пособие Т. Г. Каримова; Под ред. Е. Д. Вайсман; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Экономика и финансы; ЮУрГУ. - Челябинск: Издательство ЮУрГУ, 2004. - 89, [1] с.

б) дополнительная литература:

1. Каримова, Т. Г. Рынок ценных бумаг Учеб. пособие Т. Г. Каримова; Под ред. Е. Д. Вайсман; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Экономика и финансы; ЮУрГУ. - Челябинск: Издательство ЮУрГУ, 2004. - 89, [1] с.

2. Селищев, А. С. Рынок ценных бумаг [Текст] учебник и практикум для вузов по экон. направлениям и специальностям А. С. Селищев, Г. А. Маховикова ; С.- Петерб. гос. экон. ун-т. - 3-е изд., перераб. и доп. - М.: Юрайт, 2016. - 483 с. ил., табл.

3. РЦБ аналит. журн. АОЗТ "Журн. "Рынок ценных бумаг" журнал. - М., 2008-2015

4. Швагер, Д. Технический анализ [Текст] Д. Швагер ; пер. с англ. А. Куницына, Б. Зуева. - 4-е изд. - М.: Альпина Бизнес Букс, 2007. - 805 с. ил.

в) отечественные и зарубежные журналы по дисциплине, имеющиеся в библиотеке:

Не предусмотрены

г) методические указания для студентов по освоению дисциплины:

1. Каримова, Т.Г. Финансовые рынки и финансовые институты. Методы исследования финансовых рынков [Электронный ресурс] : учеб. пособие / Т. Г. Каримова ; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Финансы, денежное обращение и кредит ; ЮУрГУ, Челябинск, 2016.

из них: учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студента:

1. Каримова, Т.Г. Финансовые рынки и финансовые институты. Методы исследования финансовых рынков [Электронный ресурс] : учеб. пособие / Т. Г. Каримова ; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Финансы, денежное обращение и кредит ; ЮУрГУ, Челябинск, 2016.

Электронная учебно-методическая документация

№	Вид литературы	Наименование ресурса в электронной форме	Библиографическое описание
1	Основная литература	Образовательная платформа Юрайт	Рынок ценных бумаг : учебник для вузов / Н. И. Берзон [и др.] ; под общей редакцией Н. И. Берзона. — 5-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 514 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-

			5-534-11196-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/488591 (дата обращения: 16.05.2022).
2	Методические пособия для самостоятельной работы студента	Образовательная платформа Юрайт	Алехин, Б. И. Рынок ценных бумаг : учебник и практикум для вузов / Б. И. Алехин. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 497 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-05683-9. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/491248 (дата обращения: 17.05.2022).

Перечень используемого программного обеспечения:

1. Microsoft-Windows(бессрочно)
2. Microsoft-Office(бессрочно)
3. -Python(бессрочно)

Перечень используемых профессиональных баз данных и информационных справочных систем:

1. ООО "Актион-пресс"-База данных "Финансовый директор"(28.02.2023)

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Вид занятий	№ ауд.	Основное оборудование, стенды, макеты, компьютерная техника, предустановленное программное обеспечение, используемое для различных видов занятий
Лекции	410 (1)	Компьютеры с доступом в интернет, проектор
Самостоятельная работа студента	305 (1)	Проектор, ноутбук
Практические занятия и семинары	410 (1)	Компьютеры с доступом в интернет, проектор
Экзамен	410 (1)	Компьютеры с доступом в интернет, проектор