

ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ
Кафедра учета и финансовых технологий

Рег. № _____

«_____» _____ 202_ г.

УТВЕРЖДАЮ:

И.о. декана факультета экономики и
управления

Волосский А.А.

(ФИО)

(подпись)

ФГОС 2020 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Б1.В.20 Фундаментальный и технический анализ

Шифр и наименование дисциплины

38.03.01 Экономика

Код и наименование направления подготовки

Финансовые рынки и цифровые финансовые технологии

Направленность (профиль)

Курс: _____ 4 _____

Семестр: _____ 7,8 _____

Факультет экономики
и управления

очная, очно-заочная

очная, заочная, очно-заочная

Объем дисциплины (модуля)

Вид занятий	Объем занятий [зачетных ед./часов]			Семестр
	очная	заочная	очно-заочная	
Общая трудоемкость по учебному плану	7/252		7/252	7,8
В том числе,				
Контактная работа	110		64	7,8
Занятия лекционного типа	50		30	7,8
Занятия семинарского типа	60		34	7,8
Самостоятельная работа, всего	115		161	7,8
В том числе:				
Курсовой проект / курсовая работа	КР		КР	7,8
Контрольная работа / реферат / РГР				
Форма контроля экзамен / зачет / зачет с оценкой	Экзамен		Экзамен	7,8

Новосибирск 2022

Рабочая программа составлена на основании требований Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования к содержанию и уровню подготовки выпускников по направлению подготовки

38.03.01 Экономика (уровень бакалавриата), утвержденное приказом
Минобрнауки России от 12 августа 2020 г. №954.

Программу разработал:

доцент кафедры учета и
финансовых технологий,
канд. экон. наук

(должность)

подпись

Матвиенко Сергей Николаевич

ФИО

1. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю), соотнесенные с результатами освоения образовательной программы

Дисциплина «Фундаментальный и технический анализ» в соответствии с требованиями ФГОС ВО направлена на формирование следующих компетенций (ПК-1, ПК-2):

Таблица 1. Связь результатов обучения с приобретаемыми компетенциями

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Запланированные результаты обучения
ПК-1. Способен разрабатывать планы мероприятий в части финансовой деятельности организации, обеспечивать их реализацию во взаимодействии с ее структурными подразделениями и иными заинтересованными лицами	ИПК-1.1. Разрабатывает прогнозы и планы в части финансовой деятельности организации.	знать: классификацию финансовых планов, их временной горизонт, формы реализации уметь: составлять финансовые планы стратегического, текущего и оперативного характера владеть: навыками формирования финансовых планов
ПК-2. Способен осуществлять отбор поставщиков финансовых услуг в соответствии с выделенными критериями.	ИПК-2.2. Определяет перечень поставщиков финансовых услуг, оценивает эффективность взаимодействия с ними. ИПК-2.3. Осуществляет консультирование физических и юридических лиц (в том числе на иностранном языке) в части доходности и рискованности вложений в ценные бумаги и иные финансовые инструменты с использованием различных способов инвестирования.	знать: критерии отбора поставщиков финансовых услуг уметь: оценивать эффективность взаимодействия с поставщиками услуг владеть: навыками отбора поставщиков финансовых услуг в соответствии с выделенными критериями

2. Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Дисциплина Б1.В.20 «Фундаментальный и технический анализ» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений.

Данная дисциплина опирается на курсы дисциплин: «Введение в специальность», «Финансы и кредит», «Оценка стоимости бизнеса» и является основой для последующего изучения дисциплин «Основы финансовых технологий бизнеса», «Финансовые рынки», «Современные платёжные системы и технологии».

3. Содержание дисциплины (модуля)

Распределение часов по темам и видам занятий представляется в таблице 2 по очной и очно-заочной формам обучения:

Таблица 2.1. Очная форма

№ п/п	Наименование разделов и тем	Количество часов				Формируе- мые ком- петенции
		Лекции (Л)	Вид занятия (ПЗ)	Самостоя- тельная работа (СР)	Всего по теме	
1	2	3	4	5	6	7
1	Рынок ценных бумаг как объект анализа	6	7	10	23	ПК-2,4
2	Методика фундаментального анализа акций	7	7	9	25	
3	Модели оценки справедливой стоимости ценных бумаг	6	7	10	23	
4	Оценка доходности и риска портфеля ценных бумаг	6	7	10	23	
5	Основы технического анализа рынка ценных бумаг	6	7	10	23	
6	Графики как инструмент технического анализа	6	7	10	23	
7	Методика технического анализа графиков движения рыночных цен	6	7	10	23	
8	Анализ фондовых индикаторов, волн и циклов	7	7	10	24	
	Курсовая работа			36	36	ПК-1,2
	Экзамен			27	27	ПК-1,2
	Всего	50	60	142	252	

Таблица 2.1. Очно-заочная форма

№ п/п	Наименование разделов и тем	Количество часов				Формируе- мые ком- петенции
		Лекции (Л)	Вид занятия (ПЗ)	Самостоя- тельная работа (СР)	Всего по теме	
1	2	3	4	5	6	7
1	Рынок ценных бумаг как объект анализа	2	8	13	23	ПК-1,2
2	Методика фундаментального анализа акций	4	10	16	30	
3	Модели оценки справедливой стоимости ценных бумаг	4	8	16	28	
4	Оценка доходности и риска портфеля ценных бумаг	4	8	16	28	
5	Основы технического анализа рынка ценных бумаг	4	8	16	28	
6	Графики как инструмент технического анализа	4	8	16	28	
7	Методика технического анализа графиков движения рыночных цен	4	8	16	28	
8	Анализ фондовых индикаторов, волн и циклов	4	8	16	28	
	Курсовая работа			36	36	ПК-1,2
	Экзамен			27	27	ПК-1,2
	Всего	30	34	188	252	

Учебная деятельность состоит из лекций, практических занятий, самостоятельной работы, контрольной работы.

3. Содержание отдельных разделов и тем

Тема 1. Рынок ценных бумаг как объект анализа

Понятие и сущность рынка ценных бумаг. Виды и классификация ценных бумаг.

Тема 2. Методика фундаментального анализа акций

Макроэкономический анализ. Отраслевой анализ. Фундаментальный анализ операций с акциями конкретного эмитента.

Тема 3. Модели оценки справедливой стоимости ценных бумаг

Модель капитализации дохода. Модель нулевого роста. Модель постоянного роста. Модель переменного роста. Оценка с учётом конечного срока владения. Модели, основанные на соотношении «цена-доход».

Тема 4. Оценка доходности и риска портфеля ценных бумаг

Расчёт доходности портфеля ценных бумаг. Оценка риска портфеля ценных бумаг.

Тема 5. Основы технического анализа рынка ценных бумаг

Зарождение технического анализа. Основные принципы технического анализа. Теория Доу.

Тема 6. Графики как инструмент технического анализа

Линейные графики. Графики в виде «баров». «Японские свечи». Графики типа «крестики-нолики». Графики объёма торгов.

Тема 7. Методика технического анализа графиков движения рыночных цен

Основные понятия, используемые при анализе графиков. Анализ линий тренда. Анализ моделей продолжения (консолидации). Анализ моделей разворота. Определение уровней поддержки и сопротивления. Анализ скользящих средних. Определение индекса относительной эффективности. Анализ разрывов.

Тема 8. Анализ фондовых индикаторов, волн и циклов

Основные фондовые индикаторы. Теории волн, циклов.

4. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины (модуля)

4.1. Список основной литературы

1. Дмитриева О.В. Бухгалтерский учёт, анализ и аудит операций с ценными бумагами: учебное пособие / О.В. Дмитриева. – М.: ИНФРА-М, 2020. – 268 с. – ISBN 978-5-16-015736-8. – Текст: электронный. – URL: <https://znanium.com/read?id=353826>

2. Галанов В.А. Рынок ценных бумаг: учебник / В.А. Галанов. – 2-е изд., перераб. и доп. – М.: ИНФРА-М, 2022. – 414 с. – (Высшее образование: Бакалавриат). – ISBN 978-5-16-012443-8. – Текст: электронный. – URL: <https://znanium.com/read?id=392010>

4.2. Список дополнительной литературы

1. Газалиев М.М. Рынок ценных бумаг: Учебное пособие для бакалавров / М.М. Газалиев, В.А. Осипов. – 4-е изд., стер. – М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К», 2022. – 154 с. – ISBN 978-5-394-95076-3. – Текст: электронный. – URL: <https://znanium.com/read?id=431841>

2. Чижик В.П. Рынок ценных бумаг: учебное пособие / В.П. Чижик. – М.: ФОРУМ: ИНФРА-М, 2020. – 448 с. – (Высшее образование: Бакалавриат). – ISBN 978-5-00091-173-0. – Текст: электронный. – URL: <https://znanium.com/read?id=367715>

4.3. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

Таблица 3. Перечень информационных ресурсов

№ п/п	Наименование	Адрес
1.	Информационно-правовой портал ГАРАНТ	http://www.garant.ru
2.	Справочно-правовая система КонсультантПлюс	http://www.consultant.ru
3.	Официальный сайт Центрального банка России	http://www.cbr.ru
4.	Практический журнал по управлению финансами компании «Финансовый директор»	https://www.fd.ru

4.4. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модулю) и самостоятельной работы

1. Фундаментальный и технический анализ: методические указания для проведения практических занятий и самостоятельной работы студентов / Новосиб. гос. аграр. ун-т. Фак-т экон. и упр.; сост. С.Н. Матвиенко. – Новосибирск, 2021. – 17 с.

4.5. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю),

включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем, наглядных пособий

Таблица 4. Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения

№ п/п	Наименование	Тип лицензии или правообладатель
1.	MS Windows 2010, MS Windows 8.1	Microsoft
2.	MS Office Prof 2007, MS Office Prof 2010 (Word, Excel, Access, PowerPoint)	Microsoft
3.	Браузер Google Chrome, Mozilla Firefox	Свободно распространяемая
4.	СПС Консультант Плюс	094/rdd

5. Описание материально-технической базы

Таблица 6. Перечень используемых помещений

№ аудитории	Тип аудитории	Перечень оборудования
НК-424	Лекционная аудитория: аудитория для занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации.	Учебная доска, видеопроектор, проекционный экран, 1 персональный компьютер преподавателя, колонки, учебная мебель, учебно-наглядные пособия.
НК-328	Компьютерный класс: аудитория для практических занятий, самостоятельной работы, дипломного проектирования (выполнения курсовых работ)	21 персональный компьютер, видеопроектор, интерактивная доска, доска учебная, веб-камера, колонки, учебная мебель

6. Порядок аттестации студентов по дисциплине

Для аттестации студентов по дисциплине используется традиционная система контроля и оценки успеваемости обучающихся.

Форма аттестации – экзамен.

Отметка **«отлично»** выставляется студенту, глубоко и прочно усвоившему теоретический программный материал, исчерпывающее, последовательно, грамотно и логически стройно его излагающему. При этом студент не затрудняется с ответом при видоизменении задания. Используя теоретические знания, студент свободно справляется с задачами и другими видами контроля знаний, владеет разносторонними навыками и приемами выполнения практических заданий. Задача решена правильно.

Отметка **«хорошо»** выставляется студенту, твердо знающему теоретический программный материал, грамотно и по существу излагающему его. Студент не допускает существенных неточностей в ответе на вопрос, правильно применяет теоретические знания при решении практических вопросов и заданий, владеет необходимыми навыками и приемами их выполнения. Задача решена правильно.

Отметка **«удовлетворительно»** выставляется студенту, который имеет недостаточно систематизированные теоретические знания программного материала, допускает неточности, нарушение последовательности при его изложении, и испытывает затруднения в выполнении практических заданий. Задача решена правильно.

Отметка **«неудовлетворительно»** выставляется студенту, который не знает значительной части теоретического программного материала, допускает существенные ошибки при его изложении, не справляется с выполнением практических заданий. Задача решена неправильно.

7. Согласование рабочей программы

Соответствует учебному плану, утвержденному Ученым советом ФГБОУ ВО Новосибирского ГАУ, протокол от «___» _____ 20__ №___

Рабочая программа обсуждена и утверждена
на заседании кафедры протокол от «___» _____ 20__ №___

И.о. заведующего кафедрой

(должность)

подпись

О.С. Шинделова

ФИО

Председатель учебно-
методического совета (комиссии)

(должность)

подпись

О.Г. Антошкина

ФИО

Рабочая программа обсуждена и соответствует учебному плану, утвержденному Ученым советом ФГБОУ ВО Новосибирского ГАУ, протокол от «___» _____ 20__ №___

Изменений не требуется/изменения внесены в раздел(-ы):

нужное подчеркнуть

Председатель учебно-
методического совета (комиссии)

(должность)

подпись

ФИО

Рабочая программа обсуждена и соответствует учебному плану, утвержденному Ученым советом ФГБОУ ВО Новосибирского ГАУ, протокол от «___» _____ 20__ №___

Изменений не требуется/изменения внесены в раздел(-ы):

нужное подчеркнуть

Председатель учебно-
методического совета (комиссии)

(должность)

подпись

ФИО