

Содержание тем

Тема 1. Операции на финансовых рынках

Понятие и цели инвестирования в финансовые инструменты. Архитектура финансового рынка: биржевой и внебиржевой сегменты, организаторы торговли, брокеры, дилеры, депозитарии, клиринговые организации и регулятор. Виды заявок и логика заключения сделки. Доходность, риск, ликвидность и волатильность. Стратегии пробоя и отбоя, трендовые и контртрендовые подходы. Арбитраж, хеджирование, сделки carry trade и корреляционные зависимости. Рыночные циклы и кризисы. Правовые и этические ограничения торговой деятельности, защита прав инвесторов, запрет использования инсайдерской информации и манипулирования рынком.

Тема 2. Финансовые инструменты и рыночные показатели

Акции, облигации, паи инвестиционных фондов, биржевые фонды, валютные инструменты, фьючерсы и опционы. Структурные продукты: назначение, виды, встроенные риски. Альтернативные инструменты и цифровые активы. Цена, доходность, дюрация, купон, дивидендная доходность, спред, ликвидность, волатильность и корреляция. Риск эмитента, процентный, валютный, рыночный, кредитный и операционный риски. Сопоставление инструментов по целям, горизонту, ограничениям и допустимому риску.

Тема 3. Методы анализа финансовых инструментов: технический и фундаментальный анализ

Источники финансовой информации и проверка качества данных. Макроэкономическая конъюнктура и ее влияние на финансовые рынки. Фундаментальный анализ: отчетность эмитента, мультипликаторы, денежные потоки, отраслевые и макроэкономические факторы. Технический анализ: типы графиков, уровни поддержки и сопротивления, тренды и трендовые системы, объемы, скользящие средние, индикаторы, осцилляторы и графические паттерны. Ограничения методов анализа, ложные сигналы, переобучение и необходимость проверки торговой гипотезы.

Тема 4. Инвестиционный портфель: правила и принципы формирования

Понятие и виды инвестиционных портфелей. Определение инвестиционной цели, горизонта, ограничений и риск-профиля. Диверсификация и корреляция активов. Соотношение риска и ожидаемой доходности. Распределение активов, ребалансировка, хеджирование. Управление капиталом: размер позиции, лимиты риска, стоп-приказы и отношение потенциальной прибыли к риску. Оценка портфеля по доходности, волатильности и просадке. Психологические ошибки инвестора и дисциплина исполнения торгового плана.

Тема 5. Торговые технологии в информационно-торговой системе QUIK

Виды торговых платформ и требования к безопасной работе. Назначение системы QUIK. Подключение к учебному контуру, интерфейс и настройка рабочего пространства. Таблицы котировок, стакан заявок, графики, индикаторы и информационные окна. Создание, изменение и снятие учебной заявки. Контроль позиции, денежных средств и лимитов. Формирование торгового плана и журнала операций. Разбор типовых ошибок. Защита учетных данных, проверка реквизитов операции и соблюдение правил информационной безопасности.

Содержание практических занятий

№ темы	Наименование темы и практического задания	Форма и содержание практического занятия
4	Тема 4. Инвестиционный портфель: правила и принципы формирования инвестиционного портфеля	Практический кейс «Портфель при заданном уровне риска». Слушатели анализируют характеристики набора активов, определяют ограничения, формируют структуру модельного портфеля, рассчитывают доли, обосновывают диверсификацию и правила ребалансировки. Результат: паспорт модельного портфеля и карта рисков.
5	Тема 5. Работа в системе QUIK	Практикум «От торгового сценария к учебной заявке». Слушатели настраивают таблицу котировок и график, определяют параметры учебной операции, формируют заявку в демонстрационном режиме, устанавливают ограничения риска и фиксируют результат в журнале операций. Результат: скрин-карта рабочего пространства и обоснованный торговый план.

Содержание самостоятельной работы слушателей

Основная цель самостоятельной работы слушателей - закрепление знаний, полученных в ходе лекционных и практических занятий, и подготовка материалов для практического применения изученных методов. Индивидуальная консультационная работа преподавателей со слушателями осуществляется в течение всего периода обучения.

№	Тема	Формы и методы проведения
5	Тема 5. Работа в системе QUIK	Изучение руководства пользователя; подготовка модельного торгового сценария; настройка учебного рабочего пространства; составление торгового плана с указанием инструмента, сигнала, точки входа, защитного ограничения, целевого ориентира и допустимого риска.