

Федеральное государственное образовательное бюджетное учреждение
высшего образования

**«ФИНАНСОВЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПРИ ПРАВИТЕЛЬСТВЕ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»
(Финансовый университет)**

Департамент финансовых рынков и банков

И.В. Бутурлин

ОСНОВЫ ТРЕЙДИНГА

Рабочая программа дисциплины

для студентов, обучающихся по направлению подготовки
38.03.01 «Экономика», профили «Финансовые рынки и банки»,
«Финансовые рынки и финтех»

Москва 2020

Федеральное государственное образовательное бюджетное учреждение
высшего образования
**«ФИНАНСОВЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПРИ ПРАВИТЕЛЬСТВЕ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»**
(Финансовый университет)

Департамент финансовых рынков и банков

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по развитию
образовательных программ
_____ Е.А. Каменева

23.12.2019

И.В. Бутурлин

ОСНОВЫ ТРЕЙДИНГА

Рабочая программа дисциплины

для студентов, обучающихся по направлению подготовки

38.03.01 «Экономика», профили «Финансовые рынки и банки», «Финансовые рынки
и финтех»

Рекомендовано Ученым советом Факультета финансовых рынков

имени профессора В.С. Геращенко

(протокол № 21 от 17 декабря 2019 г.)

Одобрено Учебно-научным Департаментом финансовых рынков и банков

(протокол № 9 от 04 декабря 2019 г.)

Москва 2020

УДК 336(073)
ББК 65.26
Б 93

Рецензент: Б.Б. Рубцов, доктор экономических наук, профессор Департамента финансовых рынков и банков

И.В. Бутурлин Основы трейдинга: Рабочая программа дисциплины для обучающихся по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика», профили «Финансовые рынки и банки», «Финансовые рынки и финтех». — М.: Финансовый университет, Департамент финансовых рынков и банков, 2020. — 36 с.

Дисциплина «Основы трейдинга» относится к модулю дисциплин по выбору, углубляющих освоение профиля для студентов, обучающихся по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика».

Рабочая программа дисциплины содержит перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, учебно-тематический план, программу, тематику семинарских занятий и вопросы для их проведения, фонд оценочных средств, учебно-методическое обеспечение дисциплины, методические указания по изучению дисциплины.

Илья Владимирович Бутурлин

ОСНОВЫ ТРЕЙДИНГА

Рабочая программа дисциплины

Компьютерный набор, верстка И.В.Бутурлин
Формат 60х90/16. Гарнитура *Times New Roman*
Усл. п.л. ____ . Изд. № ____ . Тираж ____ экз.
Заказ _____

©И.В.Бутурлин, 2020
© Финансовый университет, 2020

Содержание

1. Наименование дисциплины.....	4
2. Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы (перечень компетенций) с указанием индикаторов их достижения и планируемых результатов обучения по дисциплине	4
3. Место дисциплины в структуре образовательной программы.....	8
4. Объем дисциплины(модуля) в зачетных единицах и в академических часах с выделением объема аудиторной (лекции, семинары) и самостоятельной работы обучающихся	8
5. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) дисциплины с указанием их объемов (в академических часах) и видов учебных занятий	10
5.1. Содержание дисциплины.....	10
5.2. Учебно-тематический план	12
5.3. Содержание семинаров, практических занятий	15
6. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине	17
6.1. Перечень вопросов, отводимых на самостоятельное освоение дисциплины, формы внеаудиторной самостоятельной работы	17
6.2. Перечень вопросов, заданий, тем для подготовки к текущему контролю	18
7. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине	20
7.1. Перечень компетенций, формируемых в процессе освоения дисциплины	20
7.2. Типовые задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, владений	21
8. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины	Ошибка! Закладка не определена.
9. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины.....	Ошибка! Закладка не определена.
10. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины	31
11. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень необходимого программного обеспечения и информационных справочных систем.	35
12. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине	36

1. Наименование дисциплины

Дисциплина «Основа трейдинга».

2. Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы (перечень компетенций) с указанием индикаторов их достижения и планируемых результатов обучения по дисциплине

Код компетенции	Наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции ¹	Результаты обучения (владения ² , умения и знания), соотнесенные с компетенциями/индикаторами достижения компетенции
профиль «Финансовые рынки и банки», 2017г. приема			
ПKN-3	способность применять математические методы для решения стандартных профессиональных финансово-экономических задач, интерпретировать полученные математические результаты	-	Знать теоретические и методические основы применения математического инструментария в процессе формирования и использования финансовых ресурсов экономических субъектов и выявления тенденций их развития. Уметь использовать математические методы и результаты решения профессиональных финансово-экономических задач при формировании концепции развития финансов экономических субъектов Владеть навыками применения математических методов, для решения профессиональных финансово-экономических задач, стоящих перед экономическими субъектами.
СК-3	способность постановке целей и задач исследований, выбору оптимальных путей и методов их достижения	—	Знать: принципы целеполагания, методику постановки задач; Уметь: определять оптимальные пути решения и методы достижения цели; Владеть: практическими навыками по анализу и сравнительной оценке показателей эффективности производственной и хозяйственной деятельности фирмы
ПКП-2	способность готовить информационно-аналитическое обеспечение разработки стратегических, текущих и оперативных про-	-	Знать: инструменты управления, государственным и муниципальным финансами, финансами кредитных и некредитных организаций; методы разработки стратегических, текущих и оперативных планов. Уметь: проводить анализ

¹ Заполняется при реализации актуализированных ОС ВО ФУ и ФГОС ВО3++

² Владения формулируются только при реализации ОС ВО ФУ первого поколения и ФГОС ВО 3+

	гнозов, планов организаций-участников финансового рынка, прежде всего, кредитных организаций (банков и небанковских кредитных организаций), некредитных финансовых организаций, органов регулирования денежно-кредитной сферы и финансового рынка, финансовых департаментов компаний; осуществлять их мониторинг, анализировать и контролировать ход их выполнения		государственных и муниципальных финансов и их влияния на социально экономическое развитие; осуществлять финансовое планирование и прогнозирование деятельности предприятия, кредитной организации; обосновывать выбор источников краткосрочного и долгосрочного финансирования предприятия и кредитной организации; использовать современное программное обеспечение и математические методы для разработки и реализации бюджетов экономических и хозяйствующих субъектов. Владеть: навыками расчета показателей бюджетов государственных и муниципальных образований, государственных внебюджетных фондов, хозяйствующих субъектов; методами разработки стратегических, долгосрочных и краткосрочных планов; современными способами оценки эффективности деятельности некоммерческой, коммерческой и кредитной организации; методами разработки долгосрочной и краткосрочной финансовой политики организации
Профили: «Финансовые рынки и банки», 2018г., 2019г., 2020г. приема «Финансовые рынки и финтех», 2019г., 2020г. приема			
ПKN-3	Способность осуществлять сбор, обработку и статистический анализ данных, применять математические методы для решения стандартных профессиональных финансово-экономических за-	1.Проводит сбор, обработку и статистический анализ данных для решения финансово-экономических задач.	1.Знать: - методы анализа финансовых инструментов; Уметь: - проводить расчеты финансовых коэффициентов и показателей, используемых для фундаментального и технического анализа;

	дач, интерпретировать полученные результаты	2. Формулирует математические постановки финансово-экономических задач, переходит от экономических постановок задач к математическим моделям.	2. Знать: - источники информации для принятий решений на финансовом рынке. Уметь: - формулировать выводы на основе проведенных расчетов.
		3. Системно подходит к выбору математических методов и информационных технологий для решения конкретных финансово-экономических задач в профессиональной области.	3. Знать: - механизм осуществления торговых сделок, их типы и особенности проведения; - проводить сравнительный анализ процессов, происходящих на финансовом рынке с целью формирования наиболее эффективных инвестиционных решений
		4. Анализирует результаты исследования математических моделей финансово-экономических задач и делает на их основании количественные и качественные выводы и рекомендации по принятию финансово-экономических решений.	4. Знать: -- основные терминалы для совершения операций и анализа на финансовых рынках. Уметь: - разрабатывать, тестировать и использовать собственную торговую систему.
ПКП-2*	Способность готовить информационно-аналитическое обеспечение разработки стратегических, текущих и оперативных прогнозов, планов институтов финансового рынка; осуществлять их мониторинг, анализировать и контролировать ход их вы-	1. Владеет современными инструментами и методами анализа деятельности институтов финансового рынка.	1 Знать: - фундаментальные показатели хозяйствующих субъектов Уметь: - проводить отбор перспективных компаний на основании фундаментального анализа
		2. Демонстрирует освоение инструментов Финтех.	2.Знать: - макроэкономические показатели Уметь: - формировать инвестиционные портфели под различные цели и задачи

	полнения	3. Демонстрирует умение формировать информационно-аналитическое обеспечение разработки различных прогнозов и планов деятельности организаций.	3. Знать: - методы оценки инвестиционных портфелей Уметь: - разрабатывать стратегии хеджирования
		4. Владеет методами мониторинга, анализа и контроля за ходом выполнения планов деятельности организаций.	4. Знать: - риски финансового рынка Уметь: - идентифицировать и определять основные риски развития хозяйствующих субъектов
ПКП-1 **	Способность выполнять профессиональные обязанности по осуществлению текущей деятельности институтов финансового рынка в условиях цифровизации, разрабатывать и внедрять инновационные финансовые и кредитные продукты, базирующиеся на современных финансовых технологиях, осуществлять прогнозирование новых явлений в деятельности субъектов финансового рынка	1. Демонстрирует способность выполнять профессиональные обязанности в условиях цифровизации текущей деятельности институтов финансового рынка, финансовых департаментов компаний различных отраслей экономики	1. Знать - основные виды финансовых инструментов и их характеристики; Уметь: - анализировать и выбирать адекватные подходы к решению сложных практических задач в области цифровизации и финансовых технологий.
		2. Разрабатывает и внедряет на финансовом рынке инновационные финансовые и кредитные продукты, базирующиеся на современных финансовых технологиях	2. Знать: - методы анализа и оценки финансовых инструментов Уметь: - прогнозировать будущие тенденции развития на финансовых рынках
		3. Демонстрирует способность прогнозирования новых явлений на финансовых рынках.	3. Знать: - инновационные финансовые технологии и финансовые продукты Уметь: - разрабатывать инновационные продукты и услуги, базирующиеся на современных финансовых технологиях

* профиль «Финансовые рынки и банки», 2018г., 2019г., 2020г. приема

** профиль «Финансовые рынки и финтех», 2019г., 2020г. приема

3. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Основы трейдинга» относится к модулю дисциплин по выбору, углубляющих освоение профиля для студентов, обучающихся по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика», профили «Финансовые рынки и банки», «Финансовые рынки и финтех».

Для эффективного освоения данной учебной дисциплины студенты должны владеть знаниями в области финансов, денежного обращения, кредита, банковского дела, менеджмента, маркетинга, теории вероятностей и математической статистики; обладать знаниями и умениями в сфере информационных технологий.

Дисциплина «Основы трейдинга» дает студентам возможность сформировать систематизированное представление по основополагающим вопросам теории и практики управления активами и анализу финансовых рынков.

4. Объем дисциплины(модуля) в зачетных единицах и в академических часах с выделением объема аудиторной (лекции, семинары) и самостоятельной работы обучающихся

Направление подготовки «Экономика», профиль «Финансовые рынки и банки», 2017г. приема

Вид учебной работы по дисциплине	Всего (в з/е и часах)	Семестр 7/8 (в часах)
Общая трудоемкость дисциплины	108	108
Контактная работа - Аудиторные занятия	36/12	36/12
<i>Лекции</i>	18/4	18/4
<i>Семинары, практические занятия</i>	18/8	18/8
Самостоятельная работа	72/96	72/96
Вид текущего контроля	эссе	эссе
Вид промежуточной аттестации	Зачет	Зачет

очная форма обучения/заочная форма обучения

Направление подготовки «Экономика», профиль «Финансовые рынки и банки»,
2018г. приема

Вид учебной работы по дисциплине	Всего (в з/е и часах)	Семестр 6/8 (в часах)
Общая трудоемкость дисциплины	108	108
<i>Контактная работа - Аудиторные занятия</i>	32/10	32/10
<i>Лекции</i>	16/2	16/2
<i>Семинары, практические занятия</i>	16/8	16/8
<i>Самостоятельная работа</i>	76/98	76/98
Вид текущего контроля	Контрольная работа	Контрольная работа
Вид промежуточной аттестации	Зачет	Зачет

очная форма обучения/заочная форма обучения

Направление подготовки «Экономика», профили «Финансовые рынки и банки»,
«Финансовые рынки и финтех», 2019г., 2020г. приема

Вид учебной работы по дисциплине	Всего (в з/е и часах)	Семестр 6/7 (в часах)
Общая трудоемкость дисциплины	108	108
<i>Контактная работа - Аудиторные занятия</i>	34/12	34/12
<i>Лекции</i>	16/4	16/4
<i>Семинары, практические занятия</i>	18/8	18/8
<i>Самостоятельная работа</i>	74/96	74/96
Вид текущего контроля	Контрольная работа	Контрольная работа
Вид промежуточной аттестации	Зачет	Зачет

очная форма обучения/заочная форма обучения (для профиля «Финансовые рынки и банки»)

5. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) дисциплины с указанием их объемов (в академических часах) и видов учебных занятий

5.1. Содержание дисциплины

Тема 1. Основы операций на финансовых рынках

Понятие и цели инвестирования в финансовые инструменты. Основные виды стратегий инвесторов и компаний на фондовом рынке. Хеджирование. Арбитраж. Сделки «carry trade». Участники биржевой торговли, механизм совершения сделок, виды заявок и учет операций. Новые финансовые технологии – робоэдвайзинг, маркетплейсы и краудфандинг. Маржинальная торговля.

Финансовые риски трейдера и риск-менеджмент. Защита прав и законных интересов инвесторов

Тема 2. Основные теории и концепции анализа финансовых рынков

Понятие концепции анализа финансового рынка. Д. Мерфи «Технический анализ финансовых рынков». Б.Вильямс «Хозяева рынка». «Волновой принцип Эллиотта. Б. Грэхэм «Анализ финансовой отчетности компаний». «Портфельная теория Марковица». К.Коннолли «Покупка и продажа волатильности». Р. Уилсон «Корпоративные облигации. Структура и анализ». Питер Стаделмайер market profile

Тема 3. Финансовые инструменты: понятие и виды. Основные показатели.

Понятие финансового инструмента. Виды финансовых инструментов. Взаимосвязь финансовых рынков, процентных ставок и инфляции. Корреляция между финансовыми инструментами. Кризисы мирового финансового рынка. Глобализация и волатильность финансовых активов. Структурные продукты: понятие и виды. Деривативы. Опционные стратегии. Торговля волатильностью. Альтернативные инструменты для инвестирования – краудфандинг, криптовалюты, робоэдвайзеры.

Тема 4. Методы анализа финансовых инструментов. Технический и фундаментальный анализ

Способы отображения цены, виды графиков. Основные концепции технического анализа. Анализ цены, времени и объемов на финансовом рынке. Тренды и трендовые системы. Технические индикаторы. Осцилляторы. Паттерны.

Макроэкономическая конъюнктура и ее влияние на финансовые рынки. Экономический календарь. Индикаторы производственного сектора. Индикаторы инфляции. Индикаторы потребительского спроса. Индикаторы делового цикла. Циклы валютных рынков. Опережающие и запаздывающие фундаментальные показатели.

Анализ данных на финансовых рынках. Обработка и методы анализа данных на финансовых рынках. Сантимент и анализ новостного фона при принятии инвестиционных решений.

Тема 5. Инвестиционный портфель. Правила и принципы формирования инвестиционного портфеля.

Понятие и виды инвестиционных портфелей. Принципы построения и управления инвестиционным портфелем. Основные характеристики инвестиционных портфелей. Современная портфельная теория. Ребалансировка портфелей.

Тема 6. Управление инвестиционными портфелями Хедж-фондов, Негосударственных и инвестиционных фондов.

Понятие и виды инвестиционных портфелей. Принципы построения и управления инвестиционным портфелем. Инвестиционные портфели хедж-фондов и негосударственных пенсионных фондов. Требования к управлению портфелями.

Тема 7. Торговые платформы, Алгоритмическая торговля и построение торговых алгоритмов

Виды торговых платформ, их практическое использование. Наиболее распространенные торговые платформы - QUIK, TRANZAQ, Metatrader, NinjaTrader, MultiCharts

Техническое оснащение трейдера. Аналитические системы, их особенности.

Построение собственных МТС и финансовых инжиниринг на основе торговых и аналитических систем. Проведение исследования. Бэк-тестирование алгоритмических стратегий. Правила проведения исторического тестирования и моделирования стратегий. Трендовые и контртрендовые стратегии. Риск-менеджмент в алгоритмических стратегиях.

5.2. Учебно-тематический план

Направление подготовки «Экономика», профиль «Финансовые рынки и банки», 2017г. приема

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Трудоемкость в часах*					Само- стоя- тельная работа	Формы те- кущего контроля успеваемо- сти
		Всего	Аудиторная работа					
			Об- щая	Лек- ции	Семина- ры, прак- тические занятия	Занятия в интерак- тивных формах		
1	2	3	4	5	6	7	8	9
1.	Основы опера- ций на финансо- вых рынках	9/9	4/1	2/-	2/1	2/-	5/8	Устный опрос, дискуссия
2.	Основные тео- рии и концепции анализа финан- совых рынков	9/9	4/1	2/-	2/1	-/-	5/8	Устный опрос, дискуссия
3.	Финансовые ин- струменты: по- нятие и виды. Основные пока- затели.	25/26	6/3	2/1	4/2	2/1	19/23	Устный опрос, тестовый контроль, решение задач дискуссия
4.	Методы анализа финансовых ин- струментов. Технический и фундаменталь- ный анализ	16/16	6/2	4/1	2/1	2/1	10/14	Устный опрос, решение задач, контроль- ная работа
5.	Инвестицион- ный портфель. Правила и принципы фор- мирования ин- вестиционного портфеля.	21/23	4/2	2/1	2/1	2/1	17/21	Устный опрос, тестовый контроль, решение задач, дискуссия
6.	Управление ин-	16/13	8/2	4/1	4/1	-/-	8/11	Деловая иг-

	вестиционными портфелями Хедж-фондов, Негосударственных и инвестиционных фондов							ра Круглый стол по итогам изучения
7.	Торговые платформы, Алгоритмическая торговля и построение торговых алгоритмов	12/12	4/1	2/-	2/1	2/1	8/11	Деловая игра Круглый стол по итогам изучения
	В целом по дисциплине	108/108	36/12	18/4	18/8	10/5	72/96	Согласно учебному плану: контрольная работа
	Итого в %					29/42		

*очная форма обучения/заочная форма обучения

Направление подготовки «Экономика», профиль «Финансовые рынки и банки»,
2018г. приема

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Трудоемкость в часах*					Самостоятельная работа	Формы текущего контроля успеваемости
		Всего	Аудиторная работа					
			Общая	Лекции	Семинары, практические занятия	Занятия в интерактивных формах		
1	2	3	4	5	6	7	8	9
1.	Основы операций на финансовых рынках	8/9	3/1	2/-	2/1	2/1	5/8	Устный опрос, дискуссия
2.	Основные теории и концепции анализа финансовых рынков	8/9	3/1	2/-	2/1	-/-	5/8	Устный опрос, дискуссия
3.	Финансовые инструменты: понятие и виды. Основные показатели.	26/26	6/2	2/-	4/2	2/1	20/24	Устный опрос, тестовый контроль, решение задач, дискуссия
4.	Методы анализа финансовых инструментов. Технический и фундаментальный анализ	16/15	6/2	4/1	2/1	2/1	10/13	Устный опрос, решение задач, контрольная работа
5.	Инвестиционный портфель.	24/23	6/2	2/1	2/1	2/1	18/21	Устный опрос.

	Правила и принципы формирования инвестиционного портфеля.							тестовый контроль, решение задач, дискуссия
6.	Управление инвестиционными портфелями Хедж-фондов, Негосударственных и инвестиционных фондов	14/14	4/1	2/-	2/1	-/-	10/13	Деловая игра Круглый стол по итогам изучения
7.	Торговые платформы, Алгоритмическая торговля и построение торговых алгоритмов	12/12	4/1	2/-	2/1	2/1	8/11	Деловая игра Круглый стол по итогам изучения
	В целом по дисциплине	108/108	32/10	16/2	16/8	10/5	76/98	Согласно учебному плану: контрольная работа
	Итого в %					31/50		

*очная форма обучения/заочная форма обучения

Направление подготовки «Экономика»: профили «Финансовые рынки и банки», «Финансовые рынки и финтех», 2019г., 2020г. приема

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Трудоемкость в часах					Само- стоя- тельная работа	Формы те- кущего контроля успеваемо- сти
		Всего	Аудиторная работа					
			Об- щая	Лек- ции	Семина- ры, прак- тические занятия	Занятия в интерак- тивных формах		
1	2	3	4	5	6	7	8	9
1.	Основы опера- ций на финансо- вых рынках	9/9	4/1	2/-	2/1	2/-	5/8	Устный опрос, дискуссия
2.	Основные тео- рии и концепции анализа финан- совых рынков	7/9	2/1	-/-	2/1	-/-	5/8	Устный опрос, дискуссия
3.	Финансовые ин- струменты: по- нятие и виды. Основные пока- затели.	26/26	6/3	2/1	4/2	2/1	20/23	Устный опрос, тестовый контроль, решение задач дискуссия
4.	Методы анализа финансовых ин-	16/16	6/2	4/1	2/1	2/1	10/14	Устный опрос,

	струментов. Технический и фундаментальный анализ							решение задач, контрольная работа
5.	Инвестиционный портфель. Правила и принципы формирования инвестиционного портфеля.	22/23	4/2	2/1	2/1	2/1	18/21	Устный опрос, тестовый контроль, решение задач, дискуссия
6.	Управление инвестиционными портфелями Хедж-фондов, Негосударственных и инвестиционных фондов	16/13	8/2	4/1	4/1	-/-	8/11	Деловая игра Круглый стол по итогам изучения
7.	Торговые платформы, Алгоритмическая торговля и построение торговых алгоритмов	12/12	4/1	2/-	2/1	2/1	8/11	Деловая игра Круглый стол по итогам изучения
	В целом по дисциплине	108/108	34/12	16/4	18/8	10/5	74/96	Согласно учебному плану: контрольная работа
	Итого в %					29/42		

*очная форма обучения/заочная форма обучения (для профиля «Финансовые рынки и банки»)

5.3. Содержание семинаров, практических занятий

Наименование тем (разделов) дисциплины	Перечень вопросов для обсуждения на семинарских, практических занятиях, рекомендуемые источники из разделов 8,9 (указывается раздел и порядковый номер источника)	Формы проведения занятий
Основы операций на финансовых рынках	Понятие и цели инвестирования в финансовые инструменты. Основные виды стратегий инвесторов и компаний на фондовом рынке. Хеджирование. Арбитраж. Сделки «carry trade». Участники биржевой торговли, механизм совершения сделок, виды заявок и учет операций. Новые финансовые технологии – робоэдвайзинг, маркетплейсы и краудфандинг. Маржинальная торговля. Финансовые риски трейдера и риск-	1. Обсуждение вопросов темы 2. Обсуждение результатов самостоятельной работы в форме научной дискуссии

	<p>менеджмент. Защита прав и законных интересов инвесторов.</p> <p>Рекомендуемые источники: раздел 8.1: 1-7 раздел 8.2: 1-2; раздел. 8.3: 1; 9</p>	
<p>Основные теории и концепции анализа финансовых рынков</p>	<p>Понятие концепции анализа финансового рынка. Д. Мерфи «Технический анализ финансовых рынков». Б.Вильямс «Хозяева рынка». «Волновой принцип Эллиотта. Б. Грэхэм «Анализ финансовой отчетности компаний». «Портфельная теория Марковица». К.Коннолли «Покупка и продажа волатильности». Р. Уилсон «Корпоративные облигации. Структура и анализ». Питер Стаделмайер market profile</p> <p>Рекомендуемые источники: раздел 8.1: 1-7; раздел 8.2: 1-4; раздел. 8.3: 1; 9</p>	<p>1. Обсуждение вопросов темы</p> <p>2. Решение тестовых заданий</p> <p>3. Обсуждение результатов самостоятельной работы в форме научной дискуссии</p>
<p>Финансовые инструменты: понятие и виды. Основные показатели.</p>	<p>Понятие финансового инструмента. Виды финансовых инструментов. Взаимосвязь финансовых рынков, процентных ставок и инфляции. Корреляция между финансовыми инструментами. Кризисы мирового финансового рынка. Глобализация и волатильность финансовых активов. Структурные продукты: понятие и виды. Деривативы. Опционные стратегии. Торговля волатильностью. Альтернативные инструменты для инвестирования – краудфандинг, криптовалюты, робот-эдвайзеры.</p> <p>Рекомендуемые источники: раздел 8.1: 1-7 раздел 8.2: 1-4; раздел. 8.3: 1; 9</p>	<p>1. Обсуждение вопросов темы</p> <p>2. Решение тестовых заданий</p> <p>3. Обсуждение результатов самостоятельной работы в форме научной дискуссии</p>
<p>Методы анализа финансовых инструментов. Технический и фундаментальный анализ</p>	<p>Способы отображения цены, виды графиков. Основные концепции технического анализа. Анализ цены, времени и объемов на финансовом рынке. Тренды и трендовые системы. Технические индикаторы. Осцилляторы. Паттерны.</p> <p>Макроэкономическая конъюнктура и ее влияние на финансовые рынки. Экономический календарь. Индикаторы производственного сектора. Индикаторы инфляции. Индикаторы потребительского спроса. Индикаторы делового цикла. Циклы валютных рынков. Опережающие и запаздывающие фундаментальные показатели.</p> <p>Анализ данных на финансовых рынках. Обработка и методы анализа данных на финансовых рынках. Сантимент и анализ новостного фона при принятии инвестиционных решений.</p> <p>Рекомендуемые источники: раздел 8.1: 1-7; раздел 8.2: 1-4; раздел. 8.3: 1; 9</p>	<p>1. Обсуждение вопросов темы</p> <p>2. Решение тестовых заданий</p> <p>3. Обсуждение результатов самостоятельной работы в форме научной дискуссии</p> <p>4. Контрольная работа</p>

Инвестиционный портфель. Правила и принципы формирования инвестиционного портфеля.	Понятие и виды инвестиционных портфелей. Принципы построения и управления инвестиционным портфелем. Основные характеристики инвестиционных портфелей. Современная портфельная теория. Ребалансировка портфелей. Рекомендуемые источники: раздел 8.1: 1-7; раздел 8.2: 1-4; раздел. 8.3: 1; 9	1. Обсуждение вопросов темы 2. Решение тестовых заданий 3. Обсуждение результатов самостоятельной работы в форме научной дискуссии
Управление инвестиционными портфелями Хедж-фондов, Негосударственных и инвестиционных фондов	Понятие и виды инвестиционных портфелей. Принципы построения и управления инвестиционным портфелем. Инвестиционные портфели хедж-фондов и негосударственных пенсионных фондов. Требования к управлению портфелями. Рекомендуемые источники: раздел 8.1: 1-7; раздел 8.2: 1-4; раздел. 8.3: 1; 9	1. Обсуждение вопросов темы 2. Деловая игра 3. Круглый стол по итогам проведения деловой игры.
Торговые платформы, Алгоритмическая торговля и построение торговых алгоритмов	Виды торговых платформ, их практическое использование. Наиболее распространенные торговые платформы - QUIK, TRANZAQ, Metatrader, NinjaTrader, MultiCharts Техническое оснащение трейдера. Аналитические системы, их особенности. Построение собственных МТС и финансовых инжиниринг на основе торговых и аналитических систем. Проведение исследования. Бэк-тестирование алгоритмических стратегий. Правила проведения исторического тестирования и моделирования стратегий. Трендовые и контртрендовые стратегии. Риск-менеджмент в алгоритмических стратегиях. Рекомендуемые источники: раздел 8.1: 1-7; раздел 8.2: 1-4; раздел. 8.3: 1; 9	1. Обсуждение вопросов темы 2. Деловая игра 4. Круглый стол по итогам проведения деловой игры.

6. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

6.1. Перечень вопросов, отводимых на самостоятельное освоение дисциплины, формы внеаудиторной самостоятельной работы

Наименование тем (разделов) дисциплины	Перечень вопросов, отводимых на самостоятельное освоение	Формы внеаудиторной самостоятельной работы
Основы операций на финансовых рынках	Функции и роль финансовых инструментов. Анализ применения новых технологий на финансовых рынках.	1. Подготовка к обсуждению вопросов темы в форме дискуссии
Финансовые инструменты: понятие и виды. Основные пока-	1. Обоснование выбора финансовых инструментов под следующие цели инвестирования и торговли: - альтернатива банковскому депозиту; - структурные продукты с 100 % защитой депозита; - инве-	1. Подготовка к обсуждению вопросов темы в форме дискуссии. 2. Подготовка к тесто-

затели.	стирование в венчурные проекты; инвестирование в недвижимость.	вому контролю.
Методы анализа финансовых инструментов. Технический и фундаментальный анализ	1. Методы технического анализа. Недостатки 2. Методы фундаментального анализа. Недостатки	1. Изучение литературы и подготовка к семинарскому занятию. 2. Подготовка к контрольной работе. 3. Обсуждение вопросов темы в форме дискуссии. 4. Подготовка и обсуждение методов технического и фундаментального анализа, поиск аргументов в пользу одного и другого метода
Инвестиционный портфель. Правила и принципы формирования инвестиционного портфеля.	1 Основные риски, возникающие при формировании инвестиционного портфеля. 2. Сравнительная характеристика современных портфельных теории.	1. Подготовка к обсуждению вопросов темы в форме дискуссии. 2. Подготовка к тестовому контролю. 3. Решение задач.
Торговые платформы, Алгоритмическая торговля и построение торговых алгоритмов	1. Системный трейдинг. Классификация автоматизированных торговых системы и принципы построения.	1. Подготовка к проведению деловой игры. 2. Подготовка к круглому столу по итогам проведения деловой игры.

6.2. Перечень вопросов, заданий, тем для подготовки к текущему контролю

Критерии балльной оценки различных форм текущего контроля успеваемости содержатся в соответствующих методических рекомендациях Департамента финансовых рынков и банков.

Примерная тематика докладов и презентаций

1. Биржевые кризисы: причины и их последствия.
2. Арбитраж на рынке ценных бумаг.
3. Влияние Интернет-технологий на развитие рынка ценных бумаг.
4. Инструменты с фиксированной доходностью: особенности развития в России.
5. Государственные ценные бумаги: сущность и особенности функционирования.

6. Дивидендная стратегии на финансовых рынках
7. Доверительное управление на рынке ценных бумаг.
8. Инвестиционные компании и фонды: роль и функции на рынке ценных бумаг.
9. Защита прав инвесторов в России.
10. Коллективные инвестиционные схемы - инвестиционные фонды различных типов и форм организации: опыт организации и функционирования в Российской Федерации.
11. Основы технического анализа ценных бумаг.
12. Основы фундаментального анализа ценных бумаг.
13. Первичное размещение ценных бумаг (IPO).
14. Криптовалюты
15. Робоедвайзинг
16. Краудфинансы
17. Современные портфельные теории.
18. Опционные стратегии
19. Хеджирование операций с ценными бумагами.
20. ADR и GDR на международных финансовых рынках. Временная структура процентных ставок, теории временной структуры процентных ставок.

Примерный вариант контрольной работы

1. Понятие и функции Биржи на финансовом рынке.
2. Какие ключевые параметры используются в фундаментальном анализе для сравнения и отбора ценных бумаг?
 - I. EPS;
 - II. P/E;
 - III. NAV;
 - IV. Текущий курс акции;
 - V. Коэффициент бета.

7. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

7.1. Перечень компетенций, формируемых в процессе освоения дисциплины

Перечень компетенций, формируемых в процессе освоения дисциплины, приведен в разделе 2 «Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы (перечень компетенций) с указанием индикаторов их достижения и планируемых результатов обучения по дисциплине».

Балльная оценка текущего контроля успеваемости студента в семестре составляет максимально 40 баллов. Балльная оценка в зачетно-экзаменационную сессию не превышает 60 баллов.

Распределение максимальных баллов по видам работ:

<i>№ п/п</i>	<i>Вид отчетности</i>	<i>Максимальная сумма баллов.</i>
1	Работа в семестре	40
2	Зачет	60
3	Итого:	100

При проведении промежуточной аттестации по дисциплине учитываются:

1) посещение студентом занятий и работа студента на занятиях (участие в дискуссии, разбор практических ситуаций);

2) работа студента во внеаудиторное время (изучение основной и дополнительной литературы, интернет-ресурсов, работа с электронными образовательными ресурсами), выполнение заданий преподавателя, написание контрольной работы.

Текущий контроль осуществляется в ходе учебного процесса, консультирования студентов, проверки выполнения ими самостоятельных заданий, проверки контрольных и тестовых заданий, проведения деловой игры и круглого стола по ее итогам. Методические рекомендации по подготовке к проведению деловой игры размещены на портале.

Промежуточный контроль проводится в форме зачета.

7.2. Типовые задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, владений

Примеры оценочных средств для проверки компетенций, формируемых дисциплиной «Основы трейдинга»

Типовые тестовые задания

1.1. Что понимается под операционным риском? (выберите правильный ответ/ответы):

А. Риск возникновения убытков, вызванных ошибками, сбоями или несовершенством внутренних процессов и систем, ошибками, непрофессионализмом или нелояльностью сотрудников, а также вследствие внешних событий (действий)

В. Риск возникновения убытков, вызванных ошибками, сбоями или несовершенством внутренних процессов и систем

С. Риск возникновения убытков, вызванных ошибками, сбоями или несовершенством внутренних процессов и систем

1.2. К какому типу рисков относится возникновение убытков вследствие неспособности обеспечить исполнение собственных обязательств в полном объеме? (выберите правильный ответ/ответы):

А. Кредитному

В. Рыночному

С. Потери ликвидности

1.3. Менеджер управлял портфелем в течение трех месяцев. В начале периода в портфель инвестировали 50 млн. руб. Через три месяца его стоимость выросла до 60 млн. руб. Определить доходность управления портфелем из задачи в расчете на год на основе эффективного процента. (выберите правильный ответ/ответы):

А. 105,38%

В. 107,36%

С. 115%

1.4. Для формирования портфеля инвестор использовал собственные средства и также получил кредит сроком на год в размере 300 тыс. руб. под 9,5% годовых. Инвестор приобрел акции двух видов: акции А на сумму 450 тыс. руб. с ожидаемой доходностью 25,6% и акции В на сумму 650 тыс. руб. с ожидаемой доходностью 30,5%. Определить ожидаемую доходность портфеля инвестора за год.

А. 24,43%

В. 35,62%

С. 30,43%

Примеры оценочных средств для проверки каждой компетенции, формируемой дисциплиной

Профиль «Финансовые рынки и банки», 2017г. приема

<u>Компетенция</u>	<u>Типовые задания</u>									
ПKN-3 способность применять математические методы для решения стандартных профессиональных финансово-экономических задач, интерпретировать полученные математические результаты	<p>Задание</p> <p>Рассчитать EPS (доход на акцию), P/E (рентабельность собственного капитала) акции. Чистая прибыль компании составила 2 млн. рублей, выплачены дивиденды по привилегированным акциям – 1 млн. руб., количество обыкновенных акций – 500 000 штук, цена одной акции – 10 рублей.</p>									
СК-3 способность постановке целей и задач исследований, выбору оптимальных путей и методов их достижения	<p>Задание</p> <p>Портфель инвестора состоит из двух активов: А и В. Инвестор планирует только два исхода событий в будущем, характеристики которых приведены в таблице.</p> <table><tr><td>Вероятность</td><td>Доходность актива А</td><td>Доходность актива В</td></tr><tr><td>Исход 1</td><td>0,2 35%</td><td>45%</td></tr><tr><td>Исход 2</td><td>0,8 -5%</td><td>-10%</td></tr></table> <p>Определить ожидаемую доходность портфеля инвестора, если активы находятся в портфеле в равных долях.</p>	Вероятность	Доходность актива А	Доходность актива В	Исход 1	0,2 35%	45%	Исход 2	0,8 -5%	-10%
Вероятность	Доходность актива А	Доходность актива В								
Исход 1	0,2 35%	45%								
Исход 2	0,8 -5%	-10%								
ПКП-2 способность готовить информационно-аналитическое обеспечение разработки стратегических, текущих и оперативных прогнозов, планов организа-	<p>Задание</p> <p>Что общего и в чем различие между процессами централизации и концентрации капитала и производства? Как банковский кредит и эмиссия</p>									

ций-участников финансового рынка, прежде всего, кредитных организаций (банков и небанковских кредитных организаций), некредитных финансовых организаций, органов регулирования денежно-кредитной сферы и финансового рынка, финансовых департаментов компаний; осуществлять их мониторинг, анализировать и контролировать ход их выполнения	ценных бумаг влияют на эти процессы?
---	--------------------------------------

Профили: «Финансовые рынки и банки», 2018г., 2019г., 2020г. приема
«Финансовые рынки и финтех», 2019г., 2020г. приема

<u>Компетенция</u>	<u>Типовые задания</u>
<p>ПКН-3</p> <p>Способность осуществлять сбор, обработку и статистический анализ данных, применять математические методы для решения стандартных профессиональных финансово-экономических задач, интерпретировать полученные результаты</p>	<p>1. Проводит сбор, обработку и статистический анализ данных для решения финансово-экономических задач.</p> <p style="text-align: center;">Задание</p> <p>Приведите примеры конкретных финансовых инструментов, обращающихся на российском рынке, классифицируйте их по разным классификационным признакам, определите их риск и доходность за последние 10 лет</p> <p>2. Формулирует математические постановки финансово-экономических задач, переходит от экономических постановок задач к математическим моделям.</p> <p style="text-align: center;">Задание</p> <p>Стандартное отклонение доходности первого актива равно 10%, второго – 17%. В каком диапазоне может располагаться значение ковариации доходностей данных активов?</p> <p>3. Системно подходит к выбору математических методов и информационных технологий для решения конкретных финансово-экономических задач в профессиональной области.</p> <p style="text-align: center;">Задание</p> <p>Доходность бумаги X за три года составила соот-</p>

	<p>ветственно 10%, 12%, 15%. Доходность бумаги Y: 7%, 8%, 11%. Определить корреляцию доходностей бумаг.</p> <p>4. Анализирует результаты исследования математических моделей финансово-экономических задач и делает на их основании количественные и качественные выводы и рекомендации по принятию финансово-экономических решений.</p> <p style="text-align: center;">Задание</p> <p>Цена спот акции компании N – 100 руб. Инвестор продает два опциона колл с ценой исполнения 105 руб. по 1,5 руб. каждый и покупает один опцион колл с ценой исполнения 100 руб. за 4 руб. Постройте график зависимости финансового результата инвестора от спот-цены акции к моменту экспирации. Определите, какой максимальный размер прибыли может получить инвестор.</p>
<p>ПКП-2*</p> <p>Способность готовить информационно-аналитическое обеспечение разработки стратегических, текущих и оперативных прогнозов, планов институтов финансового рынка; осуществлять их мониторинг, анализировать и контролировать ход их выполнения</p>	<p>1. Владеет современными инструментами и методами анализа деятельности институтов финансового рынка.</p> <p style="text-align: center;">Задание</p> <p>Какие требования предъявляются к компаниям - профессиональным участникам рынка ценных бумаг в области:</p> <ul style="list-style-type: none"> • квалификации персонала; • финансовой устойчивости; • раскрытия информации; • соблюдения норм профессиональной этики? <p>2. Демонстрирует освоение инструментов Финтех.</p> <p style="text-align: center;">Задание</p> <p>В чем отличие платформа по краудфандингу от макретплейса</p> <p>3. Демонстрирует умение формировать информационно-аналитическое обеспечение разработки различных прогнозов и планов деятельности организаций.</p>

	<p align="center">Задание</p> <p>Определите с помощью инструментов технического анализа тренд на рынке золота</p> <p>4. Владеет методами мониторинга, анализа и контроля за ходом выполнения планов деятельности организаций.</p> <p align="center">Задание</p> <p>Какие американские акции обладают большей капитализацией и почему?</p>
<p>ПКП-1 **</p> <p>Способность выполнять профессиональные обязанности по осуществлению текущей деятельности институтов финансового рынка в условиях цифровизации, разрабатывать и внедрять инновационные финансовые и кредитные продукты, базирующиеся на современных финансовых технологиях, осуществлять прогнозирование новых явлений в деятельности субъектов финансового рынка</p>	<p>1. Демонстрирует способность выполнять профессиональные обязанности в условиях цифровизации текущей деятельности институтов финансового рынка, финансовых департаментов компаний различных отраслей экономики.</p> <p align="center">Задание</p> <p>Разработайте стратегию развития брокерского отдела в условиях полного перехода к онлайн торговле.</p> <p>2. Разрабатывает и внедряет на финансовом рынке инновационные финансовые и кредитные продукты, базирующиеся на современных финансовых технологиях</p> <p align="center">Задание</p> <p>Создайте структурные продукты со 100% защитой капитала, включающие в себя ETF на нефть и золото</p> <p>3. Демонстрирует способность прогнозирования новых явлений на финансовых рынках.</p> <p align="center">Задание</p> <p>Какие фундаментальные показатели свидетельствуют о развороте тренда на рынке акций?</p>

* профиль «Финансовые рынки и банки», 2018 и далее годов приема

** профиль «Финансовые рынки и финтех», 2019 и далее годов приема

Примерный перечень вопросов для зачета.

1. Эволюция технологий финансового рынка.
2. Масштабы и структура мирового финансового рынка.
3. Классификация и виды стратегий на финансовых рынках.

4. Хеджирование.
5. Арбитраж.
6. Сделки «carry trade».
7. Взаимосвязь финансовых инструментов, процентных ставок и инфляции.
8. Участники валютного рынка и их интересы.
9. Классификация участников мирового финансового рынка.
10. Порядок осуществления операций на валютном рынке.
11. Брокеры и их функции.
12. Биржевые котировки, стакан заявок, виды сделок и заявок.
13. Комиссии и налогообложение операций на валютном рынке.
14. Маржинальное кредитование.
15. Основные торговые стратегии участников валютного рынка.
16. Принципы управления капиталом и рисками.
17. Макроэкономическая статистика и ее влияние на валютные рынки. Экономический календарь.
18. Роль рейтинговых агентств.
19. Индикаторы производственного сектора. Индикаторы инфляции. Индикаторы потребительского спроса. Индикаторы делового цикла.
20. Циклы финансовый рынков.
21. Опережающие и запаздывающие фундаментальные показатели.
22. Тренды и трендовые системы.
23. Технические индикаторы.
24. Осцилляторы.
25. Способы отображения цены, виды графиков.
26. Основные концепции технического анализа.
27. Анализ цены, времени и объемов на валютном рынке.
28. Корреляции валют.

Пример ситуационной задачи:

ЗАДАЧА

Краткосрочные облигации со сроком обращения 91 день размещены по цене 97,2 %. Какова доходность к погашению данных облигаций? Год считать за 365 дней.

8. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

8.1 Нормативно-правовые акты

1. Конституция Российской Федерации принята 12.12.1993
2. Гражданский кодекс Российской Федерации от 26.01.1996 № 14-ФЗ
3. Налоговый кодекс Российской Федерации от 31.07.1998 №146-ФЗ
4. Федеральный закон «О валютном регулировании и валютном контроле» от 10.12.2003 №173-ФЗ
5. Федеральный закон «Об организованных торгах» от 21.11.2011 №325-ФЗ
6. Федеральный закон «О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)» от 10.07.2002 №86-ФЗ
7. Указ Президента РФ «О национальных целях и стратегических задачах развития Российской Федерации на период до 2024 года» от 07.05.2018 №204

8.2. Основная литература

1. Галанов, В. А. Рынок ценных бумаг : учебник / В.А. Галанов. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : ИНФРА-М, 2019. — 414 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). — ЭБС ZNANIUM.com. — URL: <https://znanium.com/catalog/document?id=338170> (дата обращения: 04.06.2020). — Текст : электронный.
2. Сребник, Б.В. Рынок ценных бумаг : Учебное пособие для студ., обуч. по спец. "Финансы и кредит" / Б.В. Сребник ; Финуниверситет. — Москва : Кнорус, 2016. — 288 с. — Текст: непосредственный. — То же. — 2020. — ЭБС BOOK.ru. — URL: <https://book.ru/book/932207> (дата обращения: 04.06.2020). — Текст : электронный.

3. Банковские риски: Учебник для студ., обуч. по спец. "Финансы и кредит" / Финансовый университет ; под ред. О.И. Лаврушина, Н.И. Валенцевой. - 3-е изд., перераб. и доп. - Москва: Кнорус, 2013, 2016 - 292 с. - (Бакалавриат и магистратура). — Текст: непосредственный. — То же. — 2019. — ЭБС BOOK.ru. — URL: <https://www.book.ru/book/931065> (дата обращения: 16.09.2019). — Текст : электронный.
4. Шарп, У. Ф. Инвестиции : учебник : пер. с англ. / У.Ф. Шарп, Г.Д. Александер, Д.В. Бэйли. — Москва : ИНФРА-М, 2020. — XII, 1028 с. — (Университетский учебник: Бакалавриат). — ЭБС ZNANIUM.com. — URL: <https://znanium.com/catalog/document?id=353472> (дата обращения: 04.06.2020). — Текст : электронный.

8.3. Дополнительная литература

1. Сребник, Б.В. Финансовые рынки: профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг : Учебное пособие / Б.В. Сребник, Т.Б. Вилкова. — Москва : ИНФРА-М, 2014. — 366 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). — Текст: непосредственный. — То же. — ЭБС ZNANIUM.com. — URL: <https://znanium.com/catalog/document?id=134454> (дата обращения: 04.06.2020). — Текст : электронный.

9. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины

1. Банк России [Электронный ресурс]. — Режим доступа: <http://www.cbr.ru>.
2. Московская биржа [Электронный ресурс]. — Режим доступа: <http://www.moex.ru>.
3. Информационное агентство СИБОНДЗ [Электронный ресурс]. — Режим доступа: <http://www.cbonds.info/ru/>.
4. Интернет-страница Базельского комитета по банковскому надзору -

<http://www.bis.org>

5. Интернет-страница Международного валютного фонда - <http://www.imf.com>
6. Министерство финансов РФ [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.minfin.ru>.
7. Официальный сайт Президента Российской Федерации [Электронный ресурс].- Режим доступа: www.kremlin.ru
8. Официальный сайт Правительства Российской Федерации. [Электронный ресурс].- Режим доступа: www.gov.ru
9. Официальный сайт Государственной Думы Российской Федерации. [Электронный ресурс].- Режим доступа: www.duma.gov.ru
10. Официальный сайт Минэкономразвития России. [Электронный ресурс].- Режим доступа: www.economy.gov.ru
11. Официальный сайт Российской газеты. [Электронный ресурс].- Режим доступа: www.rg.ru
12. Официальный сайт компании «Консультант Плюс». [Электронный ресурс].- Режим доступа: www.consultant.ru
13. Справочная правовая система «Гарант». [Электронный ресурс].- Режим доступа: www.garant.ru
14. Сайт научной электронной библиотеки. [Электронный ресурс].- Режим доступа: www.elibrary.ru
15. Сайт Корпоративный менеджмент [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.cfin.ru>.
16. Сайт Ассоциации российских банков [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://arb.ru>.
17. Сайт SWOT-анализ. Программы для стратегического планирования [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.swot-analysis.ru>.

18. Справочная правовая система «Консультант Плюс» [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.consultant.ru>.
19. Электронная библиотека Финансового университета (ЭБ) <http://elib.fa.ru/>
20. Электронно-библиотечная система BOOK.RU <http://www.book.ru>
21. Электронно-библиотечная система «Университетская библиотека ОНЛАЙН» <http://biblioclub.ru/>
22. Электронно-библиотечная система Znanium <http://www.znanium.com>
23. Электронно-библиотечная система издательства «ЮРАЙТ» <https://www.biblio-online.ru/>
24. Деловая онлайн-библиотека Alpina Digital <http://lib.alpinadigital.ru/>
25. Научная электронная библиотека eLibrary.ru <http://elibrary.ru>
26. Электронная библиотека <http://grebennikon.ru>
27. Национальная электронная библиотека <http://нэб.рф/>
28. Электронная библиотека диссертаций Российской государственной библиотеки <https://dvs.rsl.ru/>
29. Информационный ресурс, содержащий информацию о зарегистрированных юридических лицах и индивидуальных предпринимателях («СПАРК»)
30. Электронная библиотека Организации экономического сотрудничества и развития OECD iLibrary <http://www.oecd-ilibrary.org/>
31. База данных электронной структурированной информации по частным и публичным компаниям России, Украины, Казахстана RUSLANA <https://ruslana.bvdep.com/>
32. База данных электронной структурированной информации по банкам Orbis Bank Focus <https://orbisbanks.bvinfo.com/>
33. Пакет баз данных компании EBSCO Publishing, крупнейшего агрегатора

научных ресурсов ведущих издательств мира <http://search.ebscohost.com>

34. Электронные продукты издательства Elsevier. Коллекции: Business, management and Accounting; Economics, Econometrics and Finance
<http://www.sciencedirect.com>

35. Базы данных научных журналов издательства Emerald (Accounting, Finance & Economics Collection; Business, Management & Strategy Collection)
<http://www.emeraldgroupublishing.com/products/collections/>

36. Коллекция научных журналов Oxford University Press
<https://academic.oup.com/journals/>

37. Интерактивная финансовая информационная система компании Bloomberg

38. Система Thomson Reuters Eikon

10. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Самостоятельная работа студентов по дисциплине «Основы трейдинга» включает в себя выполнение следующих видов заданий: изучение федеральных законов и нормативных актов, относящихся к инвестиционной и деятельности на рынке ценных бумаг, инструкций, положений и писем Банка России по изучаемым вопросам; подготовку докладов по проблемным и дискуссионным вопросам в сфере развития финансовых рынков и инвестиций, решение задач, способствующих приобретению практических навыков по разработке инвестиционных стратегий в банках и фондах, подготовка к проведению деловой игры на тему формирования инвестиционных портфелей, выполнение контрольной работы.

Целью выполнения различных форм самостоятельной работы является подготовка будущего специалиста к творческой деятельности научного, практического или методологического характера, а также формирование навыков творческого представления полученных результатов. Отличительными особенностями подготовки заключений по результатам принятого решения по ситуационной задаче являются

ся: высокая степень самостоятельности, умение логически обрабатывать материал, сравнивать, сопоставлять и обобщать материал, классифицировать материал по тем или иным признакам, излагать свое отношение к описываемым явлениям и событиям, давать собственную оценку полученным результатам.

Оценка выполненного задания осуществляется в процессе текущего контроля успеваемости обучающихся.

Текущий контроль успеваемости осуществляется путем регулярной проверки выполнения обучающимися в течение семестра различных заданий, включенных в программу дисциплины.

К выполнению заданий для самостоятельной работы предъявляются следующие требования: задания должны исполняться самостоятельно и представляться в установленный срок, а также соответствовать установленным требованиям по оформлению.

Студентам следует:

- руководствоваться графиком самостоятельной работы, определенным РПД;
- выполнять все плановые задания, выдаваемые преподавателем для самостоятельного выполнения, и разбирать на семинарах и консультациях неясные вопросы;
- при подготовке к зачету параллельно прорабатывать соответствующие теоретические и практические разделы дисциплины, фиксируя неясные моменты для их обсуждения на плановой консультации.

Методические рекомендации по подготовке научного доклада

Одной из форм самостоятельной работы студента является подготовка научного доклада, для обсуждения его на семинарском занятии.

Цель научного доклада - развитие у студентов навыков аналитической работы с научной литературой, анализа дискуссионных научных позиций, аргументации собственных взглядов. Подготовка научных докладов также развивает творческий потенциал студентов.

Темы докладов определяются преподавателем и распределяются между студентами с учетом их интересов. Научный доклад готовится под руководством преподавателя, который ведет практические (семинарские) занятия.

Рекомендации студенту:

- перед началом работы по написанию научного доклада с преподавателем согласовывается структура доклада, выделяются вопросы, на которые следует обратить особое внимание, по проблемным и дискуссионным теоретическим вопросам согласовать литературу, на основе которой будут выстраиваться основные положения доклада, а также обсудить ключевые вопросы, которые следует раскрыть в докладе;
- представить доклад научному руководителю в письменной форме;
- выступить на семинарском занятии с 10-15 минутной презентацией своего научного доклада, ответить на вопросы студентов группы.

Требования:

- к оформлению научного доклада: шрифт — Times New Roman, размер шрифта -14, межстрочный интервал -1,5, размер полей- 2,5 см, отступ в начале абзаца -1,25 см, форматирование по ширине; листы доклада скреплены скоросшивателем. На титульном листе указывается наименование учебного заведения, название кафедры, наименование дисциплины, тема доклада, ФИО студента;
- к структуре доклада - оглавление, введение (указывается актуальность, цель и задачи), основная часть, выводы автора, список литературы (не менее 5 позиций). Объем согласовывается с преподавателем. В конце работы ставится дата ее выполнения и подпись студента, выполнившего работу.

Общая оценка за доклад учитывает содержание доклада, его презентацию, а также ответы на вопросы.

Методические рекомендации по подготовке к контрольной работе

Целью выполнения контрольной работы является осуществление текущего контроля успеваемости обучающихся и выявление вопросов, требующих дополнительного рассмотрения. Контрольная работа включает два теоретических вопроса и

одно практическое задание, проводится в письменной форме на семинарском занятии. Задания формируются преподавателем, ведущим семинарские занятия.

К выполнению контрольной работы предъявляются требования: задания должны выполняться студентами самостоятельно

При подготовке к контрольной работе студентам следует:

- повторить теоретический материал (материалы лекций, учебной литературы), а также все задания в рамках классной и самостоятельной работы, при наличии неясных вопросов следует их разбирать в рамках, в том числе, консультаций.

При наличии вопросов, которые не были рассмотрены ранее на семинаре или консультации, следует их задать преподавателю до начала контрольной работы.

На *лекциях* студенты получают знания по основным теоретическим и практическим аспектам риск-менеджмента в кредитных организациях, рассматриваются дискуссионные вопросы, акцентируется внимание на существующих проблемных моментах. Материалы лекций, рекомендуемое учебно-методическое обеспечение по темам служат основой для подготовки студентов к семинарам и практическим занятиям.

Целью проведения *семинаров и практических занятий* являются: углубление и расширение знаний по вопросам дисциплины; обучение студентов навыкам самостоятельной работы; приобретение опыта выступления перед аудиторией и работы в малой группе.

На семинарах и практических занятиях обсуждаются основные вопросы изучаемой дисциплины; проводятся научные дискуссии, при этом студенты должны четко формулировать свой ответ, используя профессиональную терминологию, аргументировать свою позицию при анализе как теоретических, так и прикладных проблем внедрения финансовых технологий.

В рамках семинаров и практических занятий также осуществляется решение практико-ориентированных заданий, обсуждение результатов самостоятельной работы. Решение заданий нацелено на формирование у студентов практических навыков оценки и управления банковскими рисками.

По результатам обсуждения в ходе семинара и практического занятия подводятся итоги, преподаватель обращает внимание студентов на типичные ошибки, рекомендует изучение дополнительной литературы. В ходе семинаров и практических занятий осуществляется контроль за степенью усвоения пройденного материала, формируемыми компетенциями.

Подготовка к семинарам и практическим занятиям осуществляется по вопросам, предусмотренным планами семинаров и практических занятий рабочей программы дисциплины. Подготовка к семинарам и практическим занятиям предполагает использование материалов лекций; изучение нормативных правовых актов, основной и дополнительной литературы.

Задания для самостоятельной работы студентов позволяют оценить уровень усвоения полученных знаний, их осмысления и умения использовать в профессиональной деятельности. Задания для самостоятельной работы являются неотъемлемой составной частью учебного процесса. В рамках самостоятельной работы предусматривается изучение рекомендованных нормативных правовых актов, литературы и интернет-ресурсов, составление аналитических таблиц и схем, подготовка докладов. Результаты самостоятельной работы должны носить самостоятельный, творческий характер.

11. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень необходимого программного обеспечения и информационных справочных систем.

11. 1. Комплект лицензионного программного обеспечения:

1. Windows, Microsoft Office.
2. Антивирус ESET Endpoint Security
- 3.ППП GPSS World

и др.

11.2. Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы

Например,

1. Информационно-правовая система «Гарант»
2. Информационно-правовая система «Консультант Плюс»
3. Электронная энциклопедия: <http://ru.wikipedia.org/wiki/Wiki>
4. Система комплексного раскрытия информации «СКРИН» -<http://www.skrin.ru/>

и др.

11.3. Сертифицированные программные и аппаратные средства защиты информации:

Не используются

12. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине

Образовательный процесс по учебной дисциплине «Банкинг в цифровой экономике» осуществляется в учебных аудиториях, оборудованных системами дистанционного проектирования и техническим средствами обучения, требует доступа к ресурсам Библиотечно-информационного комплекса Финансового университета, другим полнотекстовым электронным библиотекам и электронным коллекциям (BOOK.ru, Znanium.com, eLIBRARY.ru и др.), Интернет-ресурсам.