

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации  
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Северо-Осетинский государственный университет  
имени Коста Левановича Хетагурова»**

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

**«Валютный дилинг»**

Направление: 38.03.01 ЭКОНОМИКА

Профиль Мировая экономика

Квалификация (степень выпускника) – бакалавр

Форма обучения - очная

**Владикавказ 2020**

Рабочая программа составлена в соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика» высшего образования (бакалавриат), утвержденный приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от «12» ноября 2015 г. No 1327; учебным планом подготовки бакалавров, утвержденным ученым советом ФГБОУ ВО «Северо-Осетинский государственный университет» от 30.04.2020г. протокол № 11).

Составитель –Цогоева М.И.

Рабочая программа обсуждена на заседании кафедры международных экономических отношений (протокол № 7 от «25» марта 2020г.)

Одобрена советом факультета международных отношений  
(протокол № 8 от «27» марта 2020г )

## 1.1 Структура, и общая трудоемкость дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетных единиц (108 часов).

	Очная форма обучения
Курс	4
Семестр	7
Лекции	36
Практические(семинарские) занятия	
Лабораторные занятия	36
Консультации	
Самостоятельная работа	36
Курсовая работа	
экзамен	
Зачет	зачет
Общее количество часов	108

### 1. Цели и задачи дисциплины

"Валютный дилинг" – курс по выбору дисциплин профиля Мировая экономика направление

#### 1.1. Цель преподавания дисциплины

Курс «Валютный дилинг» является прикладной, практической дисциплиной, где рассматривается принцип осуществления дилинговых сделок с валютой.

Целью преподавания данной дисциплины является получение студентами навыков самостоятельного анализа международного валютного рынка на основе фундаментального, технического и психологического анализов рынков.

Основная цель изучения данного курса заключается в овладении методологией комплексного исследования тенденций на международном валютном рынке на основе имеющейся статистической информации и использования статистических и технических приемов и методов ее обработки. Тематический план курса предполагает, что студенты к началу работы над ним завершили или завершают общепрофессиональных дисциплин и знакомы с организацией биржевых торгов и механизмов функционирования валютных и фондовых рынков

#### 1.1. Задачи изучения дисциплины.

В результате изучения курса студент должен **знать**:

- основные источники, форму представления и характер первичной статистической информации по фореку;
- условия и границы применения методов технического анализа в исследовании тенденций на фореку;
- основные разновидности технических индикаторов рынка и принципы их построения;
- наиболее распространенные программы технического анализа и их аналитические возможности.

После прохождения курса студент должен **уметь**:

- графически представлять тенденции валютных курсов с использованием биржевых чартов и анализировать получаемые графики;
- строить линии тренда, определять уровни поддержки и сопротивления;
- распознавать разворотные модели и модели продолжения тенденции;
- комплексно анализировать результаты, получаемые на основе различных осцилляторов и скользящих средних, и выявлять торговые сигналы.

- приобретение знаний в области практики валютного дилинга, изучение особенностей заключения дилинговых сделок,
- **Владеть**
  - навыков фундаментального анализа рынков, изучение основных торговых тактик на валютном рынке.
  - техническим анализом: знать, уметь строить и использовать графические, математические модели, основные индикаторы, правила управления риском и капиталом, необходимые для успешной торговли.
  - Психологического анализа валютного рынка

При изучении валютного дилинга на международном валютном рынке FOREX / ФОРЕКС используются современные операционные системы и информационные интерактивные технологии Internet.

## 2. Место дисциплины в структуре ОПОП

Б1.В.ДВ.13.01 Валютный дилинг является дисциплиной по выбору части профессионального цикла учебного плана ОПОП по направлению 38.03.01. Экономика, профиль Мировая экономика.

Связь с другими дисциплинами Учебного плана

Перечень действующих дисциплин с указанием разделов (тем)	Перечень компетенций
Международные валютно-финансовые и кредитные отношения	ОК-3; ОПК-1; ОПК-2; ОПК-3; ПК-1; ПК-2; ПК-3; ПК-6; ПК-7; ПК-10; ПК-11; ПК-12

Знания, навыки и умения, приобретенные в процессе изучения дисциплины в ходе лекций, семинарских занятий и самостоятельной работы, должны всесторонне использоваться студентами на завершающем этапе обучения, а также в процессе дальнейшей профессиональной деятельности при решении широкого класса прикладных задач финансово-экономического характера.

## 3. Требования к результатам освоения дисциплины

В совокупности с другими дисциплинами дисциплина «Технический анализ финансовых рынков» обеспечивает формирование следующих компетенций у студента: ОПК-3; ПК-1; ПК-8;

ОПК-3	Способностью выбрать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, проанализировать результаты расчетов и обосновать полученные выводы	Начальный этап (знания)	<b>Знать:</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>- базовые инструментальные средства необходимые для обработки экономических данных;</li> <li>- понятия и возможность выбрать основные инструментальные средства обработки финансовых и экономических данных;</li> <li>- основные виды инструментальных средств;</li> <li>- знать основные экономические показатели для выявления экономического роста российской рыночной экономики.</li> </ul>
		Продвинутый этап (умения)	<b>Уметь:</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>- анализировать финансовую, производственную и экономическую информацию, необходимую для обоснования полученных выводов;</li> <li>- обосновывать все виды экономических рисков и анализировать проведённые рас-четы;</li> <li>- проводить обработку экономических данных, связанные с профессиональной задачей;</li> <li>- собирать финансовую и экономическую информацию и</li> </ul>

			выбирать для этого оптимальные инструментальные средства.
		Завершающий этап (навыки)	<b>Владеть:</b> - методами выбора инструментальных средств для обработки экономических данных; - вариантами расчетов экономических показателей; - системой выводов для обоснования полученных результатов при расчетах экономических данных.
		Продвинутый этап (умения)	<b>Уметь:</b> - оперативно находить нужную информацию в управленческих и рекомендательных документах; - грамотно использовать информацию найденную в управленческих и рекомендательных документах; - с позиций управленческо-правовых норм анализировать конкретные ситуации, возникающие в повседневной практике; - анализировать и оценивать организационно-управленческие решения; - принимать адекватные решения при возникновении критических, спорных ситуаций.
		Завершающий этап (навыки)	<b>Владеть:</b> - навыками применения организационно-управленческих решений в текущей профессиональной деятельности.
ПК-1	Способностью собирать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов	Начальный этап (знания)	<b>Знать:</b> - основные экономические и социально-экономические показатели, применяемые для характеристики хозяйствующего субъекта экономики; - основные варианты расчетов экономических показателей; - показатели, характеризующие рост производительности труда и рост заработной платы предприятий в рыночной экономике.
		Продвинутый этап (умения)	<b>Уметь:</b> - проводить обоснование правильности выбора сбора экономических и социально-экономических показателей; - анализировать экономические и социально-экономические показатели; - системно анализировать социально-экономические показатели; - делать выводы и обосновывать полученные конечные результаты; - подготовить после анализа экономических и социально-экономических показателей доклад, статью, курсовую работу, выпускную квалификационную работу, презентацию и т.д.. - пользоваться основными выводами при написании и опубликовании статьи и доклада.
		Завершающий этап (навыки)	<b>Владеть:</b> - навыками работы с аналитическими данными, полученными при обосновании деятельности хозяйствующего субъекта; - экономическими основами профессиональной деятельности.
ПК-8	Способностью использовать для	Начальный этап (знания)	<b>Знать:</b> - основные методы решения аналитических и

	<p>решения аналитических и исследовательских задач</p> <p>современные технические средства и информационные технологии</p>		<p>исследовательских задач;</p> <p>- современные технические средства и информационные технологии, используемые при решении исследовательских задач.</p>
		Продвинутый этап (умения)	<p><b>Уметь:</b></p> <p>- пользоваться современными техническими средствами и информационными технологиями.</p>
		Завершающий этап (навыки)	<p><b>Владеть:</b></p> <p>- навыками и современными техническими средствами для самостоятельного, методически правильного решения аналитических и исследовательских заданий и задач.</p>

### 3.Содержание и учебно-методическая карта дисциплины

Номер недели	Наименование тем (вопросов), изучаемых по данной дисциплине	Занятия		Самостоятельная работа		Формы контроля	Количество баллов		Литература	Компетенции
		Л	Пр	Содержание	Часы		Min	Max		
1.	Сущность и особенности дилинговых сделок. Торговые платформы дилинговых сделок	2	2	Обзор торговых площадок, брокеров, предоставляющие возможность доступа на интернет площадки в г.Владикавказе		Опрос, доклады, выступления, презентация, решение задач	0	40	[1], [3], [5],	ПК-8
2	Фундаментальный анализ	-	-	Изучение основной и дополнительной литературы Изучение основных источников информации.	4	Вопросы на зачет		40	[1], [3],	ПК-8
3	Психологический анализ рынка	2	2	Изучение основных источников информации	2	Опрос, рефераты, выступления, деловая игра. презентация,		40	[1], [3],	ПК-8
4	Основные постулаты технического анализа	2		Изучение основной и дополнительной литературы Изучение основных источников информации.	2	Опрос, доклады, выступления, презентация,	0	40	[3] [8], [1], [6] [2] [7], [4], [5]	ПК-8
5	Основные виды графиков используемых в техническом анализе	2	2	Изучение основной и дополнительной литературы Полный графический анализ валютной пары за 30 периодов. Начало ведения торгового дневника.	8	Опрос, доклады, выступления, презентация, расчетно-аналитические и расчетно-графические задания,	0	40	[3] [8], [1], [6] [2] [9], [4], [5]	ПК-8

6-7	Японские свечи (japanesecandlesticks).	4	4	Изучение основной и дополнительной литературы	4	Опрос, доклады, выступления, презентация, расчетно-аналитические и расчетно-графические задания,	0	40	[3] [8], [1], [6] [2] [9], [4], [5]	ПК-8
8	Тренды: сущность, виды и их использование в практике валютного дилинга	2	2	Изучение основной и дополнительной литературы Ведение торгового дневника. Анализ записей в торговом дневнике с точки зрения теории поведенческих финансов.	4	Опрос, доклады, выступления, презентация, решение задач		40	[1], [2], [3] [4], [8],	ОПК-3
9	Основные фигуры технического анализа	2		Изучение основной и дополнительной литературы Ведение торгового дневника. Выявление повторяющихся ситуаций на рынке. Поиск фигур на реальных графиках	4	Опрос, доклады, выступления, презентация, решение задач	0	40	[3] [8], [1], [6] [2] [9], [4], [5]	ПК-8
9-10	Числа Фибоначчи и возможности их применения в техническом анализе	4	4	Изучение основной и дополнительной литературы Ведение торгового дневника.	4	Опрос, доклады, выступления, презентация,	0	40	[3] [8], [1], [6] [2] [4], [5]	ОПК-3 ПК-8
2	Волновая теория Эл्लота	2	2	Изучение основной и дополнительной литературы Ведение торгового дневника.	4	Опрос, выступления, презентация	0	40	[[3] [8], [1], [6] [2] [4], [5]	ОПК-3 ПК-8
11	Скользящие средние (moving average) и их использования в техническом анализе	2	2	Детальный анализ одного технического индикатора. Перечень	4	Опрос, выступления, презентация	0	40	[3] [8], [1], [6]	ПК-1 ПК-7 ПК-9



				индикаторов для анализа предлагается преподавателем. Ведение торгового дневника.		расчетно-аналитические и расчетно-графические задания,			[2] [4], [5]	
13	Каналы изменения цен	2	2	Детальный анализ одного технического индикатора. Перечень индикаторов для анализа предлагается преподавателем. Ведение торгового дневника.	5	Опрос, выступления, презентация	1	40	[3] [8], [1], [6] [2] [4], [5]	ПК-1
14-15	Осцилляторы	4	4	Детальный анализ одного технического индикатора. Перечень индикаторов для анализа предлагается преподавателем. Ведение торгового дневника.	5	Опрос, выступления, презентация	0	40	[3] [8], [1], [6] [2] [4], [5]	ПК-1
16-17	MACD .	2	2	Детальный анализ одного технического индикатора. Перечень индикаторов для анализа предлагается преподавателем. Ведение торгового дневника.	5	Опрос, выступления, презентация	0	40	[3] [8], [1], [6] [2] [4], [5]	ПК-1
18	Стохастики	4	4	Детальный анализ одного технического индикатора. Перечень индикаторов для анализа предлагается преподавателем. Ведение торгового дневника.	5	Опрос, выступления, презентация	0	40	[3] [8], [1], [6] [2] [4], [5]	ОПК-3
	ИТОГО	36	36		58		0	40) выводится средний балл)		

#### 4.Содержание дисциплины, способы и методы учебной деятельности преподавателя

*Методы обучения* - система последовательных, взаимосвязанных действий, обеспечивающих усвоение содержания образования, развитие способностей студентов, овладение ими средствами самообразования и самообучения; обеспечивают цель обучения, способ усвоения и характер взаимодействия преподавателя и студента; направлены на приобретение знаний, формирование умений, навыков, их закрепление и контроль.

№/п.	Тема	Вид занятия	Количество часов	Активные формы	Интерактивные формы
1.	Сущность и особенности дилинговых сделок. Торговые платформы дилинговых сделок	Практическое занятие, лекция	4	Презентация лекционного материала	Интернет-экскурсия, компьютерное моделирование
2..	Фундаментальный анализ				
3..	Психологический анализ рынка	Практическое занятие, лекция	4	Презентация лекционного материала Моделирование кластеров и блока проблемных вопросов	Деловая игра
4.	Основные постулаты технического анализа	Практическое занятие, лекция	4	Моделирование кластеров и блока проблемных вопросов	Практическое занятие в диалоговом режиме
5.	Основные виды графиков используемых в техническом анализе	Практическое занятие, лекция	4	Презентация лекционного материала	Практическое занятие в диалоговом режиме
6.	Японские свечи (japanesecandlesticks).	Практическое занятие, лекция	4	Презентация лекционного материала	Практическое занятие в диалоговом режиме
7.	Тренды: сущность, виды и их использование в практике валютного дилинга	Практическое занятие, лекция	4	Презентация лекционного материала	Практическое занятие в диалоговом режиме

8.	Основные фигуры технического анализа	Практическое занятие, лекция	4	Презентация лекционного материала	Практическое занятие в диалоговом режиме
9.	Числа Фибоначчи и возможности их применения в техническом анализе	Практическое занятие, лекция	4	Презентация лекционного материала Моделирование кластеров и блока проблемных вопросов	Практическое занятие в диалоговом режиме
10.	Волновая теория Эллиота	Практическое занятие, лекция	4	Презентация лекционного материала	Практическое занятие в диалоговом режиме
11.	Скользящие средние (moving average) и их использования в техническом анализе	Практическое занятие, лекция	4	Презентация лекционного материала	Практическое занятие в диалоговом режиме
12.	Каналы изменения цен	Практическое занятие, лекция	4	Презентация лекционного материала	Практическое занятие в диалоговом режиме
13.	Осцилляторы	Практическое занятие, лекция	4	Презентация лекционного материала	Практическое занятие в диалоговом режиме
14.	MACD .	Практическое занятие, лекция	4	Презентация лекционного материала	Практическое занятие в диалоговом режиме
15.	Стохастики	Практическое занятие, лекция		Презентация лекционного материала	Практическое занятие в диалоговом режиме

## 2. Содержание дисциплины, способы и методы учебной деятельности преподавателя

При изучении курса применяют следующие **активные методы обучения**:

- имитационные: неигровые – анализ конкретных ситуаций на рынке, индивидуальный тренинг; игровые – деловая игра, ролевая игра;
- неимитационные методы обучения: учебная дискуссия, самостоятельная работа с книгой, практические занятия, обсуждение проблемных статей;
- информационно-развивающие методы: лекция, рассказ, беседа, объяснение;
- проблемно-поисковые методы обучения: эвристическая беседа, учебная дискуссия, проблемная лекция, метод Case-study (анализ конкретных практических ситуаций).

Для активизации процесса обучения применяется следующий **прием обучения** - демонстрация слайдов.

## Содержание курса «Валютный дилинг»

Вид занятия, тема и краткое содержание

### **Сущность и особенности дилинговых сделок. Торговые платформы дилинговых сделок**

Сущность валютного дилинга.

Развитие дилинга.

Особенности дилинговых сделок: кредитное плечо, маржа, стоп-лос, Тайк-профит

Программное обеспечение дилинга. Ведущие торговые площадки. Метатрейдер.

Открытие демо и торгового счета. Интернет -экскурсии на ведущие торговые площадки

### **Фундаментальный анализ.**

Влияние макроэкономических показателей на валютные рынки. (на самостоятельное изучение)

### **Психологический анализ рынка: психология трейдера, типы трейдеров.**

Построение торговой стратегии на основе психологического анализа финансовых рынков

### **Основные понятия технического анализа**

Сущность и основные постулаты технического анализа

Цели и методы технического анализа

История развития технического анализа

### **Основные виды графиков используемых в техническом анализе**

График пиков, поминутный, почасовой, дневной, понедельный, помесечный, погодовой графики. Линейные чарты с арифметической и логарифмической шкалами. Точечные диаграммы (крестики-нолики), их особенности и основные направления анализа. Гистограммы (биржевые графики)

Тиковый график (tick chart) .

Линейный график (line chart)

График баров (bar chart).

График крестики-нолики (point and figure chart).

Ренко (renko)

Каги (kagi).

График объемов и открытого интереса

### **Японские свечи (japanesecandlesticks).**

1. Свечи, история возникновения, графическая запись, достоинства и недостатки свечной теории.

2. Оценка психологии торговой сессии на основе дневной свечи.

3. Линии поддержки и сопротивления, нижнее и верхнее спружинивание.

4. Совокупность свечей, принцип формирования свечных моделей.

5. Основные и вспомогательные сигналы разворота.

1. Принцип изменения полярности.

2. Разворотные модели:

1) Завеса из темных облаков

2) Утренняя и вечерняя звезда

3) Утренняя и вечерняя звезда доджи

4) Брошенный младенец

5) Крест харами

6) Три Будды

<p>7) Три горы</p> <p>8) Три реки</p> <p>9) Три наступающих белых солдата</p> <p>10) Три черные вороны</p> <p>11) Две взлетевшие вороны</p> <p>12) Свеча тасуки</p> <p>13) Молот</p> <p>14) Повешенный</p> <p>15) Бычье и медвежье поглощение</p> <p>16) Три метода</p> <p>17) Три звезды</p>
<p><b>Тренды: сущность, виды и их использование в практике валютного дилинга</b></p> <p>Краткосрочные, среднесрочные и долгосрочные тренды. Бычий тренд. Медвежий тренд. Боковой тренд. Определяющие тренд факторы. Уровень поддержки. Уровень сопротивления. Объективные и психологические факторы установления уровней поддержки и сопротивления. Реакции тренда на уровни поддержки и сопротивления. Торговые сигналы. Линии тренда. Трендовые каналы. Значимость тренда. Угол наклона тренда. Откаты тренда. Использование коэффициентов Фибоначчи в оценке откатов. Линии скорости.</p>
<p><b>Основные фигуры технического анализа</b></p> <p>Модели разворота. Ключевые обратные фигуры. Плечиковая модель. Тройная вершина и тройное дно. Двойная вершина и двойное дно. Бриллиант. Кастрюли, тарелки, соусники. Модели продолжения. Поднимающиеся и падающие треугольники. Сужающиеся и расширяющиеся треугольники. Прямоугольники, клинья, флаги. Особенности идентификации обратных фигур.</p>
<p><b>Числа Фибоначчи и возможности их применения в техническом анализе</b></p> <p>Последовательность Фибоначчи, Золотое сечение Фибоначчи, использование последовательности Фибоначчи в техническом анализе. Дуги, лучи и уровни Фибоначчи.</p>
<p><b>Волновая теория Эллиота</b></p> <p>Сущность волновой теории. Виды волн, Правила чередования. Особенности использования в техническом анализе</p>
<p><b>Скользящие средние (moving average) и их использования в техническом анализе</b></p> <p>Сущность и виды скользящих средних. Выбор периода осреднения. Преимущества и недостатки средних малых и больших порядков. Простое скользящее среднее - simple moving average, SMA Взвешенные скользящие средние (weighted moving average – WMA) Exponential moving average - экспоненциальное скользящее среднее Особенности использования анализа скользящих средних в техническом анализе валютных рынков</p>
<p><b>Каналы изменения цен</b></p> <p>Конверты скользящих средних (moving average envelopes) Полоса Боллинджера (Bollinger Band - BB).</p>

**Осцилляторы**

Понятие осциллятора. Границы применения осцилляторов. Общие правила анализа осцилляторов. Перекупленный и перепроданный рынки. Инерционный осциллятор (момент). Нормированный инерционный осциллятор. Осциллятор нормы изменения (rate of change). Индекс силы (force index). Индекс относительной силы (relative strength index).

Основные стандарты построения осцилляторов на скользящих средних.

**MACD .**

Линия MACD. Сигнальная линия. Индикатор MACD и его интерпретация.

Гистограмма MACD. Правила торговли по гистограмме MACD. Медвежьи и бычьи дивергенции. Двойные и тройные дивергенции.

**Стохастики**

Сущность и виды стохастиков

%r (процентный диапазон Уильямса)

Особенности анализа стохастиков:

Stochastic slow и stochastic fast

**Практические занятия по курсу «Валютный дилинг»**

**Практическое занятие 1.** Основные понятия технического анализа. Торговые площадки

1. Сущность валютного дилинга.

2. Развитие дилинга.

3. Особенности дилинговых сделок: кредитное плечо, маржа, стоп-лос, Тайк-профит

4. Программное обеспечение дилинга.

5. Ведущие торговые площадки. Метатрейдер. Открытие демо и торгового счета.

Презентации программ

**Практическое занятие 2.** Психологический анализ рынка

Сущность и особенности проведения психологического анализа финансовых рынка на различных торговых площадках. Психологический портрет трейдера

Построение собственной торговой стратегии на основе психологического анализа.

**Практическое занятие 3.** Построение торговой системы на основе одной графической модели (студент самостоятельно выбирает для анализа одну или две модели).

**Практическое занятие 4.** Построение механической торговой системы с применением основных положений метода «крестики-нолики» (студент самостоятельно выбирает для анализа финансовый инструмент).

**Практическое занятие 5.** Построение механической торговой системы с применением основных положений метода «японские свечи» (студент самостоятельно выбирает для анализа финансовый инструмент).

**Практическое занятие 6.** Построение торговой системы на основе метода скользящих средних (студент самостоятельно выбирает для анализа один или два вида скользящих средних).

**Практическое занятие 7.** Построение механической торговой системы с применением основных положений волновой теории Эллиота (студент самостоятельно выбирает для анализа финансовый инструмент).

**Практическое занятие 8.** Построение механической торговой системы с применением границ Боллинджера (студент самостоятельно выбирает для анализа финансовый инструмент).

**Практическое занятие 9.** Построение механической торговой системы на основе осциллятора (студент самостоятельно выбирает для анализа один или два осциллятора).

**Практическое занятие 10.** Построение механической торговой системы с применением осцилляторов (студент самостоятельно выбирает для анализа финансовый инструмент).

**Практическое занятие 11.** Построение механической торговой системы с применением чисел стохастиков (студент самостоятельно выбирает для анализа финансовый инструмент).

**Практическое занятие 12.** Построение механической торговой системы с применением индикатора MACD (студент самостоятельно выбирает для анализа финансовый инструмент).

**Практическое занятие 13.** Построение комплексной механической торговой (студент самостоятельно выбирает для анализа финансовый инструмент и 3 индикатора).

**Практическое занятие 14.** Итоговый тест

## **1. Методические рекомендации по выполнению практического задания по курсу «Валютный дилинг»**

### **Общие положения.**

Целью выполнения практического задания по разделу «Технический анализ» является углубленное освоение студентом материала учебного курса в процессе самостоятельной работы над различными информационными источниками, самостоятельный выбор аналитических инструментов, освоение навыков построения механических торговых систем и методов анализа полученных результатов.

По результатам выполняется отчёт о выполнении практического задания, который должен содержать подробное системное раскрытие в письменном виде содержания пройденной темы с использованием эмпирических данных по российским компаниям и фондовому рынку. При выполнении практического задания студент должен изучить научную литературу, рекомендованную в программе, другие дополнительные литературные источники, включая учебники, монографии, научные статьи, законодательные акты и др., в том числе интернет-ресурсы, а также освоить аналитическую программу «MetaStock 7.0», или «Metatrader». Вместе с отчетом студент должен представить реальный график, подтверждающий основные выводы по практической

### **Структура и содержание отчёта о выполнении практического задания.**

Отчёт о выполнении практического задания состоит из оглавления, введения, научного обзора, методической и практической частей, выводов и списка использованных источников. Объем отчёта – 5-7 страниц машинописного текста 12 кегля с интервалом 1,5.

Во **введении** студент даёт общую характеристику тем аналитическим инструментам, которые выбраны им для исследования, а также тем ценным бумагам, на которых будут апробированы выбранные автором инструменты. При выборе инструментов не рекомендуется пользоваться инструментами, рассмотренными в лекционном курсе, то есть студенту предлагается самостоятельно выбрать, изучить и использовать при построении механической торговой системы любые неизученные инструменты, используемые сегодня аналитиками и трейдерами при анализе тенденций на финансовых рынках.

В **научном обзоре** даётся обоснование выбранных инструментов для дальнейшего построения механической торговой системы, анализируются их сильные и слабые стороны, а также возможные области их применения и возможные ограничения. Здесь же исследуются особенности применения выбранных инструментов на российских финансовых рынках. Мнения различных авторов должны подтверждаться ссылками на первоисточники (автор, наименование работы, номер страницы).

В **методической части** приводится описание торговой системы, построенной с использованием выбранных аналитических инструментов. Описываются выбранные инструменты, приводится их расчётная формула и обосновываются характеристики параметров. Например, обосновывается временной период для скользящих средних значений и тип скользящего среднего, для осцилляторов – временной период, выбор и обоснование уровней перекупленности и перепроданности и т.д. В этой же части даётся описание

стандартных действий трейдера при различных моделях поведения используемых инструментов – определение условий и времени входа и выхода из торговли, использование фильтров.

В **практической части** проводится апробация разработанной торговой системы на одном или нескольких выбранных рынках и анализ полученных результатов. При выборе рынка ценной бумаги необходимо предварительно проанализировать поведение цен на данную бумагу на соответствующей бирже – ММВБ или РТС. Данные для анализа берутся из архива соответствующей биржи максимально близко ко времени написания реферата. При **анализе результатов** допускается использование архивных данных более ранних периодов. При анализе результатов рекомендуется использовать автоматический тестер, встроенный в программу

**Выводы** должны быть конкретными и основываться на результатах теоретического анализа выбранных инструментов и практического применения этих инструментов в построенной студентом механической торговой системе. Все данные анализа сопровождаются материалами тестирования (таблицами, графиками, диаграммами) с комментариями студента.

Задание оценивается по 40-балльной шкале

30-40- баллов- отчет по практическому заданию полностью отвечает требованиям. Выводы самостоятельны и аргументированы. Доказательная база прилагается

20-30-отчет в целом отвечает требованиям. Вместе с тем имеет место незавершенность исследования. Доказательная база не огульна

10-20. отчет поверхностен. Выводы не логичны

0-10. отчет выполнен не самостоятельно. Нелогичен, не аргументирован. Нет выводов

#### 2.4. Самостоятельная работа студента

Темы, разделы, вынесенные на самостоятельную подготовку, вопросы к практическим и лабораторным занятиям; тематика рефератной работы; курсовые работы и проекты, контрольные, рекомендации по использованию литературы и ЭВМ и др.

Перечень тем для подготовки презентации

1. История создания Форекс
2. Участники Форекс
3. Режим работы Форекс
4. Особенности регулирования
5. Основные валюты торгуемые на форекс
6. Спекулянты –основные участники рынка Форекс
7. Хеджирование: сущность и особенности функционирования.
8. Информационные источники функционирования Форекс
9. Информационно-аналитическая служба Рейтерс
10. Информационно-аналитическая служба Доу-Джонс
11. ЦБ Японии.
12. Федеральная Резервная система
13. Влияние кризиса на Форекс
14. Особенности торговли Доллар-Евро
15. Особенности торговли Доллар-Иена
16. Особенности торговли Доллар-Фунт стерлингов
17. Особенности торговли Иена-Евро
18. Экзотические валюты и их роль на Форекс
19. Д.Сорос- и его роль на мировом финансовом рынке
20. Деятельность Уоррена Баффета.
21. Спекулянты и роль в функционировании Форекс
22. Интернет-трейдинг на форекс



Самостоятельная работа студентов заключается в углубленном изучении некоторых тем, сбора статистической информации, относящейся к теме, и представление преподавателю презентации о выполненной теме.

**Перечень тем рефератов по теме «Управление капиталом при торговле валютой.  
Психология торговли»**

1. Пробой средней: основные правила
2. Интуиция на форекс (интуитивная тактика торговли)
3. Пример использования торговой тактики скользящих ценовых каналов
4. Основы тактики «Святой Грааль»
5. Трейдинг-стоп и его применение в практике валютного дилинга
6. Часовая стратегия торговли
7. Сигналы открытия позиции (фракталы Вильсона)
8. Основные принципы размещения остановок Stop Loss и Take Profit
9. Психология и торговая система
10. Психологический настрой валютного трейдера.
11. Основные причины неудач в торговле на валютном рынке.
12. Торговля валютой по правилам: психологический аспект.
13. Управление риском при торговле на форекс.
14. Управление деньгами.
15. Профессионализм в торговле на форекс.
16. Модели рыночного успеха.
17. Управление эмоциями при торговле на форекс.
18. Поведенческие модели трейдера.
19. Моральный дух трейдера.
20. Особенности национальной торговли.
21. Гармоничная торговля.
22. Планирование своих потерь.
23. Влияние индивидуальности в торговле.

**5.1. Примерные тестовые задания по курсу «Валютный дилинг» для оценки освоения компетенций ОПК-3. ПК-1. ПК-8**

Определите, верны или неверны следующие утверждения.

Технический анализ является строго количественной научной теорией.

- 1) верно
- 2) неверно

Определите, верны или неверны следующие утверждения. Фундаментальный анализ дает более точные прогнозы движения цен, чем технический анализ

- 1) верно
- 2) неверно

Определите, верны или неверны следующие утверждения. Гистограммы - это графики, которые дают аналитику больше информации, чем линейные графики

- 1) верно
- 2) неверно

Определите, верны или неверны следующие утверждения. Все виды графиков, используемые в техническом анализе, учитывают фактор времени

- 1) верно
- 2) неверно

Определите, верны или неверны следующие утверждения. Чем чаще тренд наталкивается на одну и ту же линию сопротивления или поддержки, тем слабее этот тренд становится

- 1) верно

2) неверно

Определите, верны или неверны следующие утверждения. Скользящие средние более наглядно показывают направленность движения рынка по сравнению с обычным графиком цены

1) верно

2) неверно

Определите, верны или неверны следующие утверждения. В теории Доу рассматриваются только ценовые тренды и не

рассматриваются другие индикаторы рынка, например, объемы торгов

1) верно

2) неверно

8. Определите, верны или неверны следующие утверждения Понятия перекупленного и перепроданного рынка используются при анализе скользящих средних и осцилляторов

1) верно

2) неверно

9. Подтверждением появления фигуры «голова и плечи» служит рост объемов торговли при снижении цены и их уменьшение при движении рынка вверх

1) верно

2) неверно

10. Скользящая средняя, рассчитываемая за более короткий период (например, за неделю), является более чувствительной, чем скользящая средняя, рассчитываемая за более длительный период (например, за месяц)

1) верно

2) неверно

11. Если линия скользящей средней находится ниже ценового графика, то тренд является «медвежьим»

1) верно

2) неверно

12. При пересечении графика цены с графиком скользящей средней тренд меняет свое направление

1) верно

2) неверно

13. Осцилляторы используются для анализа как трендовых, так и нетрендовых рынков

1) верно

2) неверно

14. Назначение осцилляторов - улавливать колебания цен в короткие отрезки времени

1) верно

2) неверно

Вопросы по 3 балла

В техническом анализе используются:

1. трендовые методы

2. финансовый анализ эмитента

3. осцилляторы

4. макроэкономический анализ

5. скользящие средние

При расчете экспоненциальной скользящей средней используется история цен

1. за определенный период

2. за все время существования

Технический анализ изучает

- 1.сущность экономических явлений
2. +поведение цены финансового инструмента
3. микро- и макроэкономические факторы, оказывающие влияние на эмитентов
4. В техническом анализе используются графики

- 1.одномерные
2. двухмерные
3. трехмерные
4. многомерные

Цена закрытия и цена открытия фиксируются на графиках

- 1.линейных
2. гистограммах
3. «японские свечи»
4. «крестики-нолики»

Технический анализ используется в мировой практике

- 1.не более 10 лет
2. не менее 1000 лет
3. не более 50 лет
4. не менее 100 лет

Тело «японской свечи» черное. Это свидетельствует о том, что

- 1.цена закрытия выше цены открытия
2. цена закрытия ниже цены открытия
3. цена закрытия равна цене открытия

8. Тело «японской свечи» белое. Это свидетельствует о том, что

- 1.цена закрытия выше цены открытия
2. цена закрытия ниже цены открытия
3. цена закрытия равна цене открытия

9. Подтверждением фигуры «голова и плечи» является

- 1.рост объема торговли при снижении цены
2. рост объема торговли при повышении цены
3. уменьшение объема торговли при снижении цены
4. уменьшение объема торговли при повышении цены

10. Линия скользящей средней находится ниже ценового графика. Это свидетельствует о том, что тренд является

- 1.восходящим
2. нисходящим
3. боковым

11. Линия скользящей средней находится выше ценового графика. Это свидетельствует о том, что тренд является

- 1.восходящим
2. нисходящим
3. боковым

12. Недельная скользящая средняя по сравнению с квартальной скользящей средней является

- 1.более чувствительной

2. менее чувствительной
3. такой же

13. Более чувствительная скользящая средняя на графике проходит выше менее чувствительной скользящей средней. Это свидетельствует о том, что тренд

- 1.восходящий
2. нисходящий
3. боковой

14. Экспоненциальная скользящая средняя является

- 1.Средней арифметической
2. Средней взвешенной
3. Средней геометрической

Тесты по 2 балла

1 Технический анализ

1. Фигуры на графике цены финансового актива, свидетельствующие о том, что направление тренда останется без изменения
2. Одно из направлений анализа ценных бумаг, основанное на прогнозировании цен на ценные бумаги, исходя из отчетных данных о котировках и объемах сделок
3. График средней цены актива за несколько предыдущих базовых периодов, устраняющий краткосрочные колебания цен, мешающих разглядеть основной тренд
4. Одно из направлений анализа ценных бумаг, основанное на прогнозировании цен на валюту, исходя из отчетных данных о котировках и объемах сделок

2.Теория Доу

1. Один из принципов технического анализа, утверждающий, что в движении цены финансовых активов учитываются все факторы, влияющие на ситуацию на рынке
2. Самая ранняя теория технического анализа, в основе которой лежит учение о трендах
3. Один из принципов технического анализа, утверждающий, что цены на финансовые активы движутся направленно

3. Чартисты

1. Специалисты, утверждающие, что цены на финансовые активы движутся направленно
2. Специалисты финансового рынка, проводящие технический анализ
3. Специалисты финансового рынка, изучающие прогнозы о дальнейшем движении цены при анализе нетрендовых рынков

4. Уровень поддержки

1. Момент смены направления ценового тренда
2. Фигуры на графике цены финансового актива, свидетельствующие о том, что направление тренда останется без изменения
3. Психологический уровень цены финансового актива, который рассматривают как выгодный для покупки, рассчитывая на повышение цен
4. Психологический уровень цены на финансовый актив, который рассматривают как выгодный для продажи

5. Уровень сопротивления

1. Фигуры на графике цены финансового актива, свидетельствующие о том, что направление тренда останется без изменения
2. Психологический уровень цены финансового актива, который рассматривают как выгодный

для покупки, рассчитывая на повышение цен

3. Психологический уровень цены на финансовый актив, который рассматривают как выгодный для продажи

6. Фигуры разворота тренда

1. Фигуры на графике цены финансового актива, свидетельствующие о том, что направление тренда останется без изменения
2. Фигуры на ценовых графиках, свидетельствуют о том, что тренд изменит свое направление
3. Ситуация на рынке, которая свидетельствует о возможной перемене тренда
4. Ситуация на рынке, которая свидетельствует о продолжении действующего тренда

7. Фигуры подтверждения тренда

1. Фигуры на графике цены финансового актива, свидетельствующие о том, что направление тренда останется без изменения
2. Фигуры на ценовых графиках, свидетельствуют о том, что тренд изменит свое направление
3. Ситуация на рынке, которая свидетельствует о возможной перемене тренда
4. Ситуация на рынке, которая свидетельствует о продолжении действующего тренда

8. Экспоненциальная скользящая средняя относится к классу:

1. Осцилляторов
2. Стохастиков
3. средних
4. Трендовых индикаторов

9. Осцилляторы

1. Один из статистических методов, используемых в техническом анализе, позволяющий получать прогнозы о дальнейшем движении цены при анализе нетрендовых рынков
2. График средней цены актива за несколько предыдущих базовых периодов, устраняющий краткосрочные колебания цен, мешающих разглядеть основной тренд
3. Один из статистических методов, используемых в техническом анализе, позволяющий получать прогнозы о о возможных точках выхода из рынка

10. Опережающие сигналы не могут дать

1. средние
2. Стохастики
3. Осцилляторы

11. К стохастикам нельзя отнести:

1. ROC
2. %K
3. %D

12. К осцилляторам нельзя отнести:

1. ROC
2. Momentum
3. RSI
4. MACD
5. Процент Лари Уильямсона

13. Анализ дивергенции не используют на графике

1. ROC

2. Momentum
3. RSI
4. MACD
5. Процента Лари Уильямсона
6. Moving average

14. Параметр времени не учитывается на графике:

- 1) крестики-нолики
- 2) линейном
- 3) отрезков

15. Наиболее информативен график:

- 1) крестики-нолики
- 2) линейном
- 3) отрезков
- 4) японских свечей

16. К фигурам разворота тренда не относятся:

1. Треугольники
2. Голова-плечи-вверх
3. Тройная вершина
4. бриллиант

17. К фигурам продолжения тренда не относят:

1. Треугольник
2. Флаг
3. Вымпел
4. бриллиант

18. Для определения величины и времени отката используют:

1. Числа Фиббоначи
2. Терию Доу
3. Волны Элиота

19. Расхождение ценового графика и индикатора называется

1. Дивергенцией
2. Конвергенцией
3. Откатом
4. Распадом

20. Сужение и расхождения анализируют на графиках:

1. Momentum
2. RSI
3. MACD
4. Границах Боллинджера.

21. Momentum вычисляют по формуле:

1.  $C - C_n$
2.  $C / C_n$
3.  $CU / CD$

22. ROC вычисляют по формуле:

1.  $C - C_n$
2.  $C / C_n$

3. CU / CD

23. Дивергенции "быков"

1. цены падают до нового минимума, а RSI дает более высокий минимум, чем при предыдущем падении цен.
2. цены поднимаются до нового максимума, а RSI дает более низкий максимум, чем при предыдущем подъеме цен.
3. цены поднимаются до нового максимума, а RSI дает более высокий минимум, чем при предыдущем падении цен.
4. цены падают до нового минимума, а RSI дает более низкий максимум, чем при предыдущем подъеме цен.

24. Дивергенция «медведей»

1. цены падают до нового минимума, а RSI дает более высокий минимум, чем при предыдущем падении цен.
2. цены поднимаются до нового максимума, а RSI дает более низкий максимум, чем при предыдущем подъеме цен.
3. цены поднимаются до нового максимума, а RSI дает более высокий минимум, чем при предыдущем падении цен.
4. цены падают до нового минимума, а RSI дает более низкий максимум, чем при предыдущем подъеме цен.

25. Дивергенция быков – сигнал к:

1. Покупке
2. Продаже

26. Дивергенция медведей – сигнал к:

1. Покупке
2. Продаже

28. Зона выше 70 (80) называется

1. зоной перекупленности (Overbought),
2. зоной перепроданности (Oversold).
3. Зоной Over

29. Зона ниже 30 (20)

1. зоной перекупленности (Overbought),
2. зоной перепроданности (Oversold).
3. Зоной Over

30. Согласно теории Элиота тенденция всегда будет развиваться по

1. 8-волновому циклу
2. 5-волновому циклу
3. 3-волновому циклу

31. Все волны делятся на:

1. Импульсные
2. Корректирующие
3. Развития
4. Прогрессивные
5. Верно 1 и 2.
6. Верно 1,2,3 и 4

32. 1,3,5 волны по теории Элиота-:

1. Импульсные
2. Корректирующие
3. Развития
4. Прогрессивные

33. Волны 2 и 4 согласно теории Элиота

1. Импульсные
2. Корректирующие
3. Развития

#### 4. Прогрессивные

*Вставьте пропущенные слова или числа*

График, используемый в техническом анализе и представляющий собой совокупность отрезков, характеризующих колебание цен за период, называется

Рынок считается , когда кривая осциллятора находится возле верхней границы полосы

3. Рынок считается , когда кривая осциллятора находится возле нижней границы полосы

График, используемый в техническом анализе и представляющий собой прямоугольники с отрезками, характеризующие колебание цен за период, называется

График, используемый в техническом анализе, который не учитывает фактор времени, называется .....

На гистограмме цена закрытия фиксируется отрезком

Тело «японской свечи» черное в том случае, когда цена закрытия цены открытия

8. На точечной диаграмме крестик обозначает цены, а нолик - ее

### 2.5. Рекомендации к написанию рефератов:

1. Рассмотреть ключевые категории и понятия по исследуемой проблеме и дать их сущностную характеристику.
2. Показать, какую эволюцию претерпели исследуемые явления и процессы экономической действительности в ходе развития мирового хозяйства.
3. Оценить современное состояние проблемы со всеми присущими ей сложностями и противоречиями, подтвердив свою точку зрения статистическим материалом.
4. Выявить основные тенденции развития анализируемого явления с учетом экономических реалий начала XXI в.
5. Сделать самостоятельный вывод по результатам своего исследования.
6. Для подтверждения достоверности основных выводов приводить сноски на первоисточник

**Структура реферата.** Эссе состоит из введения, основной части (которую целесообразно структурировать по главам, вопросам или параграфам), заключения (2—3 абзаца), сноска и списка литературы.

**Объем работы** 10-12 страниц текста формата А4 (не считая титульного листа и списка литературы). Шрифт — Times New Roman 12, интервал — 1,5.

#### **Критерии оценки реферата**

- способность студента к поиску информации, характеризующей современное состояние объекта исследования (особое внимание обращается на наличие современного статистического материала, поэтому поощряется использование электронных источников информации);
- навыки анализа проблемы, умение вычленить главное, сущностное и через это установить внутренние связи различных элементов исследуемого явления;
- умение связать исследуемые процессы с современной российской экономической действительностью;
- способность делать обоснованные самостоятельные выводы;
- аккуратность оформления и своевременность представления работы.

#### **Инновационные способы и методы, используемые в образовательном процессе**

Основаны на использовании современных достижений науки и информационных технологий. Направлены на повышение качества подготовки путем развития у студентов творческих способностей и самостоятельности (методы проблемного обучения, исследовательские методы, тренинговые формы, рейтинговые системы обучения и контроля знаний и др.). Нацелены на активизацию творческого потенциала и самостоятельности



студентов и могут реализовываться на базе инновационных структур (научных лабораторий, центров, предприятий и организаций и др.).

### ***Оснащённость учебного процесса***

#### **Лекционные аудиторные занятия:**

- помещение УДЦ на 10 учебных мест;
- учебная доска;
- проекционное оборудование (проекционный экран, проектор и аудиосистема);
- лекционно-методический материал в форме презентаций (по необходимости).

#### **Практические аудиторные занятия:**

- помещение УДЦ на 10 компьютеризированных рабочих места;
- популярный торговый терминал “MetaTrader5” с возможностью совершения полноценных торговых сделок, необходимый для постепенной выработки и последующего оттачивания своих индивидуальных навыков сценарного трейдинга на аудиторных практических занятиях в онлайн-режиме;
- пакет дополнительных программных инструментов для торгового терминала “MetaTrader5”, необходимый для совершения сценарного трейдинга;
- уникальный торговый тренажёр “ForexTester2” с возможностью совершения полноценных торговых сделок, произвольно регулируемой скоростью подачи исторических котировок, а также с уникальной возможностью совершения откатов в прошлое, необходимый для постепенной выработки и последующего оттачивания слушателями своих индивидуальных навыков сценарного трейдинга на аудиторных практических занятиях в офлайн-режиме;
- пакет дополнительных программных инструментов для торгового симулятора “ForexTester2”, необходимый для совершения сценарного трейдинга;
- Интернет-связь для скачивания и установки необходимых компьютерных программ, on-line трейдинга и электронной почты.

#### **Самостоятельные практические занятия (домашняя работа):**

- персональный компьютер студента (либо один из общедоступных компьютеров университета);
- торговый терминал “MetaTrader5”, необходимый для самостоятельных практических занятий в онлайн-режиме и выполнения отчётов о проделанной практической аудиторной работе;
- пакет дополнительных программных инструментов для торгового терминала “MetaTrader5”, необходимый для совершения сценарного трейдинга;
- торговый тренажёр “ForexTester2”, необходимый для самостоятельных практических занятий в офлайн-режиме и выполнения отчётов о проделанной практической аудиторной работе;
- пакет дополнительных программных инструментов для торгового тренажёра “ForexTester2”, необходимый для совершения сценарного трейдинга;
- Интернет-связь для скачивания и установки необходимых компьютерных программ, on-line трейдинга и отправки отчётов о проделанной практической аудиторной работе;
- текстовый редактор типа “MSOfficeWord” для оформления отчётов о проделанной практической аудиторной работе.

**Показатели и критерии оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания**

<b>Уровень сформированности компетенций</b>			
<b>«Минимальный уровень не достигнут» (менее 55 баллов)</b> Компетенции не сформированы.  Знания отсутствуют, умения и навыки не сформированы.	<b>«Минимальный уровень» (56-70 баллов)</b> Компетенции сформированы.  Сформированы базовые структуры знаний.  Умения фрагментарны и носят репродуктивный характер.  Демонстрируется низкий уровень самостоятельности практического навыка.	<b>«Средний уровень» (71-85 баллов)</b> Компетенции сформированы.  Знания обширные, системные.  Умения носят репродуктивный характер, применяются к решению типовых заданий.  Демонстрируется достаточный уровень самостоятельности устойчивого практического навыка.	<b>«Высокий уровень» (86-100 баллов)</b> Компетенции сформированы.  Знания твердые, аргументированные, всесторонние.  Умения успешно применяются к решению как типовых, так и нестандартных творческих заданий.  Демонстрируется высокий уровень самостоятельности, высокая адаптивность практического навыка
<b>Описание критериев оценивания</b>			
Обучающийся демонстрирует: - существенные пробелы в знаниях учебного материала; - допускаются принципиальные ошибки при ответе на основные вопросы билета, отсутствует знание и понимание основных понятий и категорий; - непонимание сущности дополнительных вопросов в рамках заданий билета; - отсутствие умения выполнять практические задания, предусмотренные программой дисциплины; - отсутствие готовности (способности) к	Обучающийся демонстрирует: - знания теоретического материала; - неполные ответы на основные вопросы, ошибки в ответе, недостаточное понимание сущности излагаемых вопросов; - неуверенные и неточные ответы на дополнительные вопросы; - недостаточное владение литературой, рекомендованной программой дисциплины; - умение без грубых ошибок решать практические задания, которые следует выполнить.	Обучающийся демонстрирует: - знание и понимание основных вопросов контролируемого объема программного материала; - твердые знания теоретического материала. - способность устанавливать и объяснять связь практики и теории, выявлять противоречия, проблемы и тенденции развития; - правильные и конкретные, без грубых ошибок, ответы на поставленные вопросы; - умение решать	Обучающийся демонстрирует: - глубокие, всесторонние и аргументированные знания программного материала; - полное понимание сущности и взаимосвязи рассматриваемых процессов и явлений, точное знание основных понятий в рамках обсуждаемых заданий; - способность устанавливать и объяснять связь практики и теории; - логически последовательные, содержательные,

дискуссии и низкую степень контактности.		практические задания, которые следует выполнить; - владение основной литературой, рекомендованной программой дисциплины; - наличие собственной обоснованной позиции по обсуждаемым вопросам. Возможны незначительные оговорки и неточности в раскрытии отдельных положений вопросов билета, присутствует неуверенность в ответах на вопросы	конкретные и исчерпывающие ответы на все задания билета, а также дополнительные вопросы экзаменатора; - умение решать практические задания; - свободное использование в ответах на вопросы материалов рекомендованной основной и дополнительной литературы.
<b>Оценка «неудовлетворительно» / не зачтено</b>	<b>Оценка «удовлетворительно» / «зачтено»</b>	<b>Оценка «хорошо» / «зачтено»</b>	<b>Оценка «отлично» / «зачтено»</b>

### 3.1. Информационно-методические

#### Основная литература

1. Кузьмин В. Р.. Технический анализ финансовых рынков [Электронный ресурс] / М.: Лаборатория книги, 2015. - 101 с. - <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=96492>
2. Акелис С. Технический анализ от А до Я. – М.: Евро, 2010. 364 с.
3. Вайн С. Инвестиции и трейдинг: Формирование индивидуального подхода к принятию инвестиционных решений. — М. : Альпина Паблишер, 2010. — 643 с.
4. Мерфи Д. Дж. Технический анализ финансовых рынков: полный справочник по методам и практике трейдинга. — М. : Вильямс, 2016. — 496 с.
5. Найман, Э. Л. Путь к финансовой свободе: Профессиональный подход к трейдингу и инвестициям. — М. : Альпина Паблишер, 2015. — 498 с.

#### Дополнительная литература

6. Технический анализ: Курс для начинающих. Серия: Reuters для финансистов. Пер. с англ. — М. : Альпина Паблишер, 2012. — 185 с.
7. Элдер А. Как играть и выигрывать на бирже: Психология Технический анализ Контроль над капиталом: Пер с англ Изд 5. Характеристика: для Специалистов; др. ISBN: 978-5-9614-0827-0. Издательство: Альпина Бизнес Букс – Москва. Год: 2016
8. Швагер Дж. Технический анализ Полный курс: Пер с англ Изд 6. Характеристика: для Специалистов; др. ISBN: 978-5-9614-1014-3. Издательство: Альпина Бизнес Букс – Москва. Год: 2009
9. Стив Нисон «Японские свечи: графический анализ финансовых рынков». Москва, «Диалог», 2003

#### Информационные источники данных

- [" ABC".](#)
- [" AFXpress".](#)
- [" Associated Press".](#)

[" Austria Presse Agentur".](#)  
[" Barron's".](#)  
[" BBC".](#)  
[" Bild".](#)  
[" Bloomberg".](#)  
[" Briefing.com".](#)  
[" Business Finance Marketplace".](#)  
[" BusinessWeek".](#)  
[" Canada NewsWire".](#)  
[" CBSMarketWatch".](#)  
[" CCNMatthews".](#)  
[" Chicago Tribune".](#)  
[" CNNfn".](#)  
[" Daily Telegraph".](#)  
[" Deutsche Presse-Agentur".](#)  
[" Deutsche Welle".](#)  
[" dpa-AFX".](#)  
[" Dow Jones".](#)  
[" Economic Times".](#)  
[" Economist".](#)  
[" Euromoney".](#)  
[" Financial Times".](#)  
[" Forbes".](#)  
[" Fortune".](#)  
[" Frankfurter Allgemeine Zeitung".](#)  
[" Guardian Unlimited".](#)  
[" Handelsblatt".](#)  
[" Individual Investor Online".](#)  
[" Korea Economic Daily".](#)  
[" Kyodo News".](#)  
[" La Tribune".](#)  
[" Lefigaro".](#)  
[" Los Angeles Times".](#)  
[" MarketNews International".](#)  
[" MSNBCBusiness".](#)  
[" Morningstar".](#)  
[" Motley Fool".](#)  
[" NeuePresse".](#)  
[" New York Times".](#)  
[" New Zealand Herald".](#)  
[" Newsday.com".](#)  
[" Nikkei net Interactive".](#)  
[" Reuters".](#)  
[" SmartMoney".](#)  
[" Spiegel".](#)  
[" Sunday Times".](#)  
[" Thetstreet.com".](#)  
[" Times".](#)  
[" USA TODAY".](#)  
[" Wall Street Journal".](#)  
[" Washington Post".](#)  
[" Washington Times".](#)  
[" Yahoo! Finance](#)

### **Источники информации, пресса, информационные агентства:**

- 1) аналитика, российский фондовый рынок - <http://www.finam.ru/>
- 2) журнал для трейдеров "Forex Magazine". Есть архив с самого начала издания - <http://www.fxmag.ru/>
- 3) журналы по инвестициям "MFD.RU" (есть форум) - <http://www.mfd.ru/>
- 4) "The Wall Street Journal" (online версия) - <http://online.wsj.com/>
- 5) "Pensions & Investments" - <http://www.pionline.com/>
- 6) "Investment Newsletters" (здесь в т.ч. приводятся и советы "гуру" инвестиций) - [http://www.newsletters.forbes.com/DRHM/servlet/ControllerServlet?Action=DisplayHomePage&SiteID=es\\_764&Locale=en\\_US&pgm=127100](http://www.newsletters.forbes.com/DRHM/servlet/ControllerServlet?Action=DisplayHomePage&SiteID=es_764&Locale=en_US&pgm=127100)
- 7) "American Banker Online" (основан в 1980 г, имеется форум) - <http://www.americanbanker.com/pagedisplay.html?pagename=semlandingpage>
- 8) корпоративный журнал Сбербанка России "Прямые инвестиции" - <http://www.sbrf.ru/ruswin/sbjr/annonce.htm>
- 9) новости Dow Jones - <http://www.djnewswires.com>
- 10) новости от "Reuters" - <http://www.reuters.com/>
- 11) "CQG International" - <http://www.cqg.com/>
- 12) "Bloomberg" - <http://www.bloomberg.com/>
- 13) "CNN" - <http://www.cnn.com/>
- 14) Британское издание "The Financial Times" - <http://www.ft.com/>
- 15) "New York Times" - <http://www.nytimes.com/>
- 16) "The Economist" - <http://www.economist.com/>
- 17) "Fortune" - <http://www.fortune.com/>
- 18) "K2Kapital" - <http://www.k2kapital.com/>
- 19) ИА "Прайм-ТАСС" - <http://www.prime-tass.ru/>
- 20) ИА "Финмаркет" - <http://www.finmarket.ru/>
- 21) ИА "Росбизнесконсалтинг" - <http://www.rbc.ru/>
- 22) "AK&M" - <http://www.akm.ru/rus/default3.stm>
- 23) ИА "Инфо-Арт" - <http://infoart.iip.net/index.htm>
- 24) новости от "Forex Rate" - <http://www.forexrate.co.uk/>
- 25) новости от "Forbes" - <http://www.forbes.com/>
- 26) Британское издание "Independent": <http://www.independent.co.uk/>
- 27) Британское издание "The Times": <http://www.timesonline.co.uk/>
- 28) РИА "Новости": <http://www.rian.ru/>
- 29) "КоммерсантЪ": <http://www.kommersant.ru/>
- 30) Нью-Йоркское издание "The Daily News": <http://www.nydailynews.com/>
- 31) Британское издание "The Telegraph": <http://www.telegraph.co.uk/>
- 32) Иностранная пресса о России и не только: <http://inopressa.ru/>
- 33) экспресс-оценка финансового состояния банков - <http://www.banks-rate.ru/>

### **Российские и зарубежные банки. Центральные банки:**

- 43) Сбербанк РФ - <http://sbrf.ru/>
- 38) Национальный банк "ТРАСТ" - <http://www.trust.ru/>
- 39) Банк "Сосьете Женераль Восток" (BSGV) - <http://www.bsgv.ru/>
- 40) "Росбанк" - <http://www.rosbank.ru/>
- 41) "Ренессанс Кредит" - <http://www.rencredit.ru/>
- 42) Российский Сельскохозяйственный Банк - <http://www.rshb.ru/>
- 43) "Bank of America" - <https://www.bankofamerica.com/index.jsp>
- 44) "Barclays" - <http://group.barclays.com/Home>
- 45) "Chase Manhattan Bank" - <https://www.chase.com/>
- 46) "Citibank" - <http://www.citibank.com/us/index.htm>
- 47) Резервный Банк Австралии - <http://www.rba.gov.au/>
- 48) Национальный банк Австралии (NAB (National Australia Bank)) - <http://www.nab.com.au/>

- 49) Европейский Центральный Банк (European Central Bank (ECB)) - <http://www.ecb.int/home/html/index.en.html>
- 50) Национальный банк Канады (Bank of Canada (BOC)) - <http://www.bankofcanada.ca/en/index.html>
- 51) Национальный банк Новой Зеландии (National Bank of New Zealand (NBNZ)) - <http://www.nationalbank.co.nz/>
- 52) Банк Франции - <http://www.banque-france.fr/home.htm>
- 53) "Bundesbank" (Германия) - <http://www.bundesbank.de/index.en.php>
- 54) "Deutsche Bank" (Германия) - [http://www.db.com/index\\_e.htm](http://www.db.com/index_e.htm)
- 55) Банк Японии (Bank of Japan (BOJ)) - <http://www.boj.or.jp/en/>
- 56) Центральный банк России - <http://www.cbr.ru/>
- 57) "SARB" ЮАР (South Africa) - <http://www.resbank.co.za/>
- 58) "Riksbank" (Швеция) - <http://www.riksbank.com/>
- 59) "SNB" (Швейцарский Национальный Банк) - <http://www.snb.ch/en>
- 60) "UBS" (Швейцария) - <http://www.ubs.com/>
- 61) Bank of England (BOE) (Банк Англии) - <http://www.bankofengland.co.uk/>
- 62) Federal Reserve Bank of New York - <http://www.ny.frb.org/>
- 63) U.S. Federal Reserve Bank (FRB)- <http://www.federalreserve.gov/>
- 64) U.S. Department of Commerce - <http://www.commerce.gov/>
- 65) Bank for International Settlements (BIS) - <http://www.bis.org/forum/research.htm>
- 66) Bank of China (BOC) (Национальный банк Китая) - <http://www.boc.cn/en/index.html>
- 66) Bank of Italy (Банк Италии) - [http://www.bancaditalia.it/:internal&action=\\_setlanguage.action?LANGUAGE=en](http://www.bancaditalia.it/:internal&action=_setlanguage.action?LANGUAGE=en)
- 67) The Banco de España (Банк Испании) - <http://www.bde.es/homee.htm>
- 68) "Промсвязьбанк" - <http://www.psbank.ru/>

#### **Источники официальной статистики:**

- 69) "FedStats" Federal Interagency Council on Statistical Policy (Федеральное бюро Статистики США) - <http://www.fedstats.gov/>
- 70) Белый Дом США - <http://www.whitehouse.gov/>
- 71) "United Nations" (Организация Объединённых Наций) - <http://www.un.org/>
- 72) "STAT-USA" - <http://www.stat-usa.gov/>
- 73) Bureau of Economic Analysis (BEA) (Бюро экономического анализа) - <http://www.bea.gov/>
- 74) International Monetary Fund (IMF) (Международный Валютный Фонд (МВФ)) - <http://www.imf.org/external/index.htm>
- 75) The World Bank (Всемирный Банк) - <http://www.worldbank.org/>
- 76) Bank for International Settlements (BIS) (Банк Международных Расчётов) - <http://www.bis.org/>

#### **Биржи:**

- 77) London Stock Exchange (LSE) - <http://www.londonstockexchange.com/home/homepage.htm>
- 78) London International Financial Futures and Options Exchange (LIFFE) - <http://www.euronext.com/landing/landingInfo-21514-EN.html>
- 79) London Metal Exchange (LME) - <http://www.lme.co.uk/>
- 80) American Stock Exchange (AMEX) - [http://www.nyse.com/attachment/amex\\_landing.htm](http://www.nyse.com/attachment/amex_landing.htm)
- 81) NASDAQ - <http://www.nasdaq.com/>
- 82) New York Stock Exchange (NYSE) - <http://www.nyse.com/>
- 83) New York Board Of Trade (NYBOT) - <https://www.theice.com/homepage.jhtml>
- 84) New York Mercantile Exchange (NYMEX) - <http://www.nymex.com/index.aspx>
- 85) Chicago Board Options Exchange (CBOE) - <http://www.cboe.com/>
- 86) Chicago Mercantile Exchange (CME) - <http://www.cmegroup.com/>

- 87) Chicago Stock Exchange (CHX)- <http://www.chx.com/>
- 88) EUREX - <http://www.eurexchange.com/index.html>
- 89) Deutsche Börse Group - [http://deutsche-boerse.com/dbag/dispatch/en/kir/gdb\\_navigation/home?](http://deutsche-boerse.com/dbag/dispatch/en/kir/gdb_navigation/home?)
- 90) Swiss Exchange - <http://www.six-swiss-exchange.com/index.html>
- 91) Bourse de Paris - <http://www.bourse.fr/>
- 92) EQUIDUCT TRADING - <http://www.equiduct-trading.com/home/home.asp>
- 93) Tokyo Stock Exchange - <http://www.tse.or.jp/english/index.html>
- 94) Australian Stock Exchange (ASX) - <http://www.asx.com.au/>

#### **Российские финансовые рынки (торговые площадки):**

- 95) Фондовая Биржа РТС - <http://www.rts.ru/>
- 96) Московская фондовая биржа (МФБ) - <http://www.mse.ru/>
- 97) Московская межбанковская валютная биржа (ММВБ) - <http://www.micex.ru/>
- 98) Санкт-Петербургская Валютная Биржа (СПВБ) - <http://www.spdex.ru/>
- 99) Фондовая биржа "Санкт-Петербург" - <http://www.spbex.ru/>
- 100) Сибирская Межбанковская Валютная Биржа (СМВБ) - <http://www.sice.ru/>
- 101) ММВБ-Поволжье <http://www.micex-pfo.ru/>
- 102) Самарская валютная межбанковская биржа (СВМБ) <http://www.sciex.ru/>
- 103) Центральная российская универсальная биржа (ЦРУБ) <http://www.birja.ru/>

#### **Экономические календари:**

- 104) CMC Monthly Economic Diary - [http://www.cmcplc.com/reports/diary/current\\_diary.html](http://www.cmcplc.com/reports/diary/current_diary.html)
- 105) Marketnews Calendar - <http://global-view.com/globalcalc.htm>
- 106) Canada Data Releases and Calendar - <http://www.statcan.ca/english/Release/release99.htm>
- 107) Euro-zone Release Calendar and data - <http://europa.eu.int/en/comm/eurostat/serven/part6/6relcal.htm>
- 108) GVI Holiday Calendar - <http://global-view.com/Holidaysc.htm>
- 109) Copp Clark Market Calendar - <http://www.coppclark.com/legalinfo.aspx>

#### **Разное:**

- 110) U.S. Securities and Exchange Commission (SEC)  
(Американская Комиссия по Биржам и Рынку Ценных Бумаг) - <http://www.sec.gov/>
- 111) U.S. Commodity Futures Trading Commission  
(Федеральная Комиссия по Товарным и Фьючерсным рынкам США) - <http://cftc.gov/>
- 112) Национальная фьючерсная ассоциация (National Futures Association) - <http://www.nfa.futures.org/>
- 113) Рейтинговое агентство MOODYs - [http://www.moodys.com/cust/default\\_alt.asp](http://www.moodys.com/cust/default_alt.asp)
- 114) Архив котировок Форекс - <http://www.adcforex.ru/>
- 115) Сайт А. Элдера - <http://www.elder.com/>

#### **Информационные источники данных**

- " ABC".
- " AFXpress".
- " Associated Press".
- " Austria Presse Agentur".
- " Barron's".
- " BBC".
- " Bild".
- " Bloomberg".
- " Briefing.com".
- " Business Finance Marketplace".
- " BusinessWeek".

" Canada NewsWire".  
" CBSMarketWatch".  
" CCNMatthews".  
" Chicago Tribune".  
" CNNfn".  
" Daily Telegraph".  
" Deutsche Presse-Agentur".  
" Deutsche Welle".  
" dpa-AFX".  
" Dow Jones".  
" Economic Times".  
" Economist".  
" Euromoney".  
" Financial Times".  
" Forbes".  
" Fortune".  
" Frankfurter Allgemeine Zeitung".  
" Guardian Unlimited".  
" Handelsblatt".  
" Individual Investor Online".  
" Korea Economic Daily".  
" Kyodo News".  
" La Tribune".  
" Lefigaro".  
" Los Angeles Times".  
" MarketNews International".  
" MSNBCBusiness".  
" Morningstar".  
" Motley Fool".  
" NeuePresse".  
" New York Times".  
" New Zealand Herald".  
" Newsday.com".  
" Nikkei net Interactive".  
" Reuters".  
" SmartMoney".  
" Spiegel".  
" Sunday Times".  
" Thetstreet.com".  
" Times".  
" USA TODAY".  
" Wall Street Journal".  
" Washington Post".  
" Washington Times".  
" Yahoo! Finance

## **5.2. Вопросы к зачету по курсу «Валютный дилинг» для оценки освоения компетенций ОПК-3, ПК-1. ПК-8**

1. Сущность валютного дилинга
2. Сущность и основные постулаты технического анализа
3. Сущность и особенности функционирования Форекс
4. Цели и методы технического анализа
5. История развития технического анализа



6. Тиковый график (tick chart). Линейный график (line chart).
7. График баров (bar chart). Японские свечи (japanese candlesticks).
8. График крестики-нолики (pointandfigurechart). Ренко (renko) . Каги (kagi).
9. График объемов и открытого интереса
10. Технические индикаторы.
11. Комбинации японских свечей
12. Сущность и виды тренда
13. Линии поддержки и сопротивления
14. Фигуры разворота тренда
15. Фигуры продолжения тренда
16. Уровни Фибоначчи
17. Волновая теория Эллиота.
18. Сущность и виды скользящих средних
19. Простое скользящее среднее - simple moving average, SMA
20. Взвешенные скользящие средние (weighted moving average – WMA)
21. Exponential moving average - экспоненциальное скользящее среднее
22. Особенности использования анализа скользящих средних в техническом анализе валютных рынков
23. Конверты скользящих средних (moving average envelopes)
24. Полоса боллинджера (Bellinger Band - BB).
25. Сущность и общие правила анализа осцилляторов.
26. Momentum
27. скоростьизменения (the rate of change - ROC)
28. RSI (индекс относительной силы)
29. Индикатор MACD и гистограмма MACD
30. Сущность и виды стохастиков
31. %R(процентный диапазон Уильямса)
32. Особенности анализа стохастиков:
33. Stochastic slow и stochastic fast

## 9. Материально-техническое обеспечение дисциплины (модуля)

Компьютерный класс, доступ к сети Интернет (во время самостоятельной работы), оргтехника, электронная база данных библиотеки СОГУ, лекционные аудитории; кабинет, оснащенный интерактивной доской, проектором.

### Состав лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства.

№ п/п	Наименование	№ договора (лицензия)
1.	Windows 7 Professional	№ 4100072800 Microsoft Products (MPSA) от 04.2016 г.
2.	Office Standard 2016	№ 4100072800 Microsoft Products (MPSA) от 04.2016 г.
3.	Антивирусное программное обеспечение KasperksyTotalSecurity	№17Е0-180222-130819-587-185 от 26.02. 2018 до 14.03.2019 г, продлена до 2021 г.
4.	Система поиска текстовых заимствований «Антиплагиат.ВУЗ»	№795 от 26.12.2020 (действителен до 30.12.2021 г.) с ЗАО «Анти-Плагиат» продлена до 2021 г.
5.	Программа для ЭВМ	Разработка СОГУ Свидетельство о

	«Банк вопросов для контроля знаний»	государственной регистрации программы для ЭВМ №2015611829 от 06.02.2015г. (бессрочно)
6.	Консультант плюс	№430-2017/614 от 11.01.2017г. ООО "Фаст-Информ" (бессрочно)
7.	СПС «Гарант»	договор 01.2020г. - 12.2021г.
8.	Cisco Webex - Система проведения вебинаров	№ Д83-2020 от 10.08.2020 - 10.08.2021г. с ООО Айстек