

Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования «Российский университет дружбы народов»

Экономический факультет
Рекомендовано МССН

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

«Основы трейдинга»

Рекомендуется для направления

38.03.01 Экономика

профиль «Финансы и кредит»

2018 г.

1. Цели и задачи дисциплины:

Дисциплина «Основы трейдинга» играет важную роль в овладении методами принятия обоснованных решений в области управления ценными бумагами и формировании у студентов навыков финансового мышления. **Основной целью** дисциплины является освоение студентами знаний и практических навыков в идентификации, измерении и управлении ценными бумагами.

Исходя из цели, в процессе изучения дисциплины предполагается решить следующие **задачи**:

- дать необходимые базовые современные теоретические знания по основам современной теории управления ценными бумагами;
- научить использовать на практике методы стратегического, оперативного управления;
- ознакомить студентов с основными моделями управления портфелем;
- изучить основные элементы и методы, стратегии управления ценными бумагами;
- дать базовые знания в области диверсификации рисков;
- овладеть знаниями в области анализа и управления рисками на рынке ценных бумаг;
- научить студентов основным методикам расчета и управления рисками на рынке ценных бумаг.

2. Место дисциплины в структуре ОП ВО:

Дисциплина «Основы трейдинга» относится к *вариативной* части блока 4 учебного плана.

В таблице № 1 приведены предшествующие и последующие дисциплины, направленные на формирование компетенций дисциплины в соответствии с матрицей компетенций ОП ВО.

Таблица № 1

Предшествующие и последующие дисциплины, направленные на формирование компетенций

№ п/п	Шифр и наименование компетенции	Предшествующие дисциплины	Последующие дисциплины (группы дисциплин)
1	УК-2 Способен определять круг задач в рамках поставленной цели и выбирать оптимальные способы их решения, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	Статистика Деньги, кредит, банки Управление капиталом	Нет последующих дисциплин
2	ОПК-4 Способен предлагать экономически и финансово обоснованные организационно - управленческие решения в профессиональной деятельности	Педагогика и психология Моделирование бизнес-процессов Стратегии консолидации бизнеса	Нет последующих дисциплин

3	<p>ПКО 7.3 Способен на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитывать финансовые и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность экономических субъектов</p>	<p>Управление банковскими рисками Управление капиталом организации</p>	<p>Нет последующих дисциплин</p>

3. Требования к результатам освоения дисциплины:

УК-2. Способен определять круг задач в рамках поставленной цели и выбирать оптимальные способы их решения, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений

ОПК-4 Способен предлагать экономически и финансово обоснованные организационно - управленческие решения в профессиональной деятельности

ПКО 7.3 Способен на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитывать финансовые и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность экономических субъектов

По окончании изучения дисциплины «Основы трейдинга» студент должен иметь представления о теоретических основах формирования и управления портфелем ценных бумаг, должен обучиться прикладным навыкам и эмпирическими методам, необходимым для реальной деятельности на фондовом рынке.

владеть:

- методологией анализа операций с ценными бумагами с точки зрения сравнения, оценки финансового результата и вероятности получения дохода;
- осуществлять расчеты по всем видам операций с ценными бумагами на биржах;

знать:

- механизмы управления риском портфеля;
- основные модели оценки риска портфеля;
- основные методы расчета показателя VaR (дельта - нормальный, исторического моделирования, Монте – Карло);
- основные методы хеджирования с помощью производных инструментов;

уметь:

- управлять основными рисками на рынке ценных бумаг;
- производить оценку доходности финансовых активов;
- проводить оценку доходности портфелей и отдельных финансовых инструментов;

4. Объем дисциплины и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетные единицы.

Вид учебной работы	Всего часов	Семестр
		8
Аудиторные занятия (всего)	20	20
В том числе:	-	-
<i>Лекции</i>		
<i>Практические занятия (ПЗ)</i>	20	20
<i>Семинары (С)</i>		
<i>Лабораторные работы (ЛР)</i>		
Самостоятельная работа (всего)	88	88
Общая трудоемкость ед.	час	108
	зач.	3

5. Содержание дисциплины

5.1. Содержание разделов дисциплины

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела (темы)
1.	Характеристика основных платформ для торговли	Основные платформы. NT, MT4, MT5, TOS, Volfix. Установка терминала. Содержание терминала. Создание списка торгуемых инструментов.
2.	Индикаторы и осцилляторы.	Роль индикаторов в торговле. Характеристика основных индикаторов (Bollinger Bands, Moving Average, MACD, SAR, Alligator)
3.	Инструменты для торговли	Базовый актив, дата поставки, исполнение. Уровни, линии тренда. Короткие и длинные позиции. Таймфреймы как часть торговой системы.
4.	Виды торговых приказов	Рыночные и лимитированные приказы. Приказы на фиксацию прибыли и лимитирование убытка. Принцип аукциона. Проскальзывание и причины его происхождения.
5.	Виды стратегий	Методы входа в позицию : сигналы , точки входа. Применение показателей волатильности рынка. Определение дельты. Методы входа в позицию. Удержание открытой позиции.
6.	Использование ленты принтов	Характеристика ленты принтов и «стакана цен» (Level1). Поиск скрытого покупателя. Торговля в балансе. Фрактальный анализ.
7.	Метод VSA (Volume Spread Analysis)	Характеристика метода . Чтение барного графика цен. Значение объемов торгов и его связь с графиком цен. Виды паттернов: определение точек входа в позицию и выхода из нее.
8.	Отбор активов для торговли	Использование профессиональных сайтов для анализа и отбора активов: Finviz, Portfoliovizualizer, Barcharts,

		Tradingview. Использование отчетности и conferens coll для принятия решений. Значение Screeners.
9.	Оценка эффективности портфеля	Оценка инвестиционных стратегий. Цели взаимных фондов. Вычисление доходности фонда. Эффективность с поправкой на риск. Доходность на единицу риска / Дифференциальная доходность (Альфа) / Сравнение критериев эффективности.

5.2. Разделы дисциплин и виды занятий

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Лекц.	Практ. зан.	СРС	Всего час.
1.	Характеристика основных платформ для торговли		2	9	11
2.	Индикаторы и осцилляторы.		2	9	11
3.	Инструменты для торговли		2	9	11
4.	Виды торговых приказов		2	9	11
5.	Виды стратегий		2	9	11
6.	Использование ленты принтов		2	9	11
7.	Метод VSA (Volume Spread Analysis)		2	10	12
8.	Отбор активов для торговли		2	12	14
9.	Оценка эффективности портфеля		4	12	14
	Итого:		20	88	108

6. Лабораторный практикум

Не предусмотрен

7. Практические занятия (семинары)

№ п/п	№ раздела дисциплины	Тематика практических занятий (семинаров)	Трудоемкость (час.)
1.	Характеристика основных платформ для торговли	Основные платформы.NT, MT4, MT5, TOS, Volfix. Установка терминала. Содержание терминала. Создание списка торгуемых инструментов.	2
2.	Индикаторы и осцилляторы.	Роль индикаторов в торговле. Характеристика основных индикаторов (Bollinger Bands, Moving Average, MACD, SAR, Alligator)	2
3.	Инструменты для торговли	Базовый актив, дата поставки, исполнение. Уровни, линии тренда. Короткие и длинные позиции. Таймфреймы как часть торговой системы.	2
4.	Виды торговых приказов	Рыночные и лимитированные приказы. Приказы на фиксацию прибыли и	2

		лимитирование убытка. Принцип аукциона. Проскальзывание и причины его происхождения.	
5.	Виды стратегий	Методы входа в позицию : сигналы , точки входа. Применение показателей волатильности рынка. Определение дельты. Методы входа в позицию. Удержание открытой позиции.	2
6.	Использование ленты принтов	Характеристика ленты принтов и «стакана цен» (Level1). Поиск скрытого покупателя. Торговля в балансе. Фрактальный анализ.	2
7.	Метод VSA (Volume Spread Analysis)	Характеристика метода . Чтение барного графика цен. Значение объемов торгов и его связь с графиком цен. Виды паттернов: определение точек входа в позицию и выхода из нее.	2
8.	Отбор активов для торговли	Использование профессиональных сайтов для анализа и отбора активов: Finviz, Portfoliovizualizer, Barcharts, Tradingview. Использование отчетности и conferens coll для принятия решений. Значение Screeners.	2
9.	Оценка эффективности портфеля	Оценка инвестиционных стратегий. Цели взаимных фондов. Вычисление доходности фонда. Эффективность с поправкой на риск. Доходность на единицу риска / Дифференциальная доходность (Альфа) / Сравнение критериев эффективности	4
	ИТОГО		20

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины:

Занятия проводятся в компьютерном классе (27 ауд), в которой имеется необходимое оборудование, в т.ч. 21 рабочее место: сист.блок Celeron /2600 MHz/1280 MB/ 40 GB/DVD ROM/ LCD monitor 17"+ 1 проектор + Точка доступа WiFi

9. Информационное обеспечение дисциплины

Наименование электронно-библиотечной системы, предоставляющей возможность круглосуточного дистанционного индивидуального доступа для каждого обучающегося из любой точки, в которой имеется доступ к сети Интернет, адрес в сети Интернет:

1. Электронно-библиотечная система РУДН – ЭБС РУДН <http://lib.rudn.ru/MegaPro/Web>
2. Университетская библиотека онлайн <http://www.biblioclub.ru>
3. ЭБС Юрайт <http://www.biblio-online.ru>
4. НЭБ Elibrary <http://elibrary.ru>
5. Консультант студента www.studentlibrary.ru
6. ЭБС «Лань» <http://e.lanbook.com/>
7. ЭБС Юрайт <http://www.biblio-online.ru>

Русскоязычные Интернет-ресурсы:

www.erp-online.ru – О ERP-системах
www.fd.ru – Журнал "Финансовый директор"
www.finam.ru – Финансовая информация
www.finanaliz.ru – Финансовый анализ
www.finrisk.ru – Финансовые риски
www.forexpf.ru – Финансовая информация для рынка FOREX
www.fxclub.org – FOREX клуб
www.mfd.ru – Финансовая информация
www.mirfin.ru – Мир финансов
www.micex.ru – Московская межбанковская валютная биржа
www.pmf.ru/iafd/index.html – Информационное агентство "Финансовый дом"
www.prime-tass.ru – Агентство экономической информации
www.rts.ru – Российская торговая система
www.rusbonds.ru – Рынок облигаций
www.sandp.ru – Компания Standard&Poor's

10. Учебно-методическое обеспечение дисциплины:

а) основная литература

1. Блохина Т.К. Рынок ценных бумаг. Практикум /Т.К. Блохина. – М.: РУДН, 2017.
2. Блохина Т.К. Мировые финансовые рынки: учебник / Т.К. Блохина. - М.: Проспект, 2016.
3. Галанов А.В. Рынок ценных бумаг: учебник / А.В. Галанов – М.: Инфра-М, 2018.

б) дополнительная литература

1. Анализ ценных бумаг [Текст] / Грэхем Бенджамин, Додд Дэвид; Пер. с англ. - 3-е изд. - М. : Вильямс, 2012. - 880 с. : ил. - ISBN 978-5-8459-1552-8
2. Gavin Holmes/: Trading in the Shadow of the Smart Money
3. Инвестиции [электронный ресурс] : Учебное пособие. Специальность 080105 – "Финансы и кредит" / О. А. Ашихмина, И. А. Марьина. - электронные текстовые данные. - М. : Изд-во РУДН, 2011. - 149 с. - ISBN 978-5-20904057-6.

11. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

Для успешного освоения дисциплины "Основы трейдинга" необходимо лекционные материалы дополнять самостоятельным изучением специальной литературы. Решение задач и кейсов по курсу является неотъемлемым условием овладения навыками финансового анализа и принятия финансовых решений.

Текущий контроль успеваемости осуществляется путем оценки выполнения заданий по курсу. Промежуточная аттестация проводится в форме теста. Итоговое испытание проводится в устной форме.

12. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине (модулю)

Материалы для оценки уровня освоения учебного материала дисциплины «Основы трейдинга» (оценочные материалы), включающие в себя перечень компетенций с указанием этапов их формирования, описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания, типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы, методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы

формирования компетенций, разработаны в полном объеме и доступны для обучающихся на странице дисциплины в ТУИС РУДН.

Программа составлена в соответствии с требованиями ОС ВО РУДН.

Разработчик:

к.э.н., доцент

Финансы и кредит

Г.Ф. Абрамов

Руководитель программы:

д.э.н., профессор

Финансы и кредит

А.Я. Быстряков

Заведующий кафедрой

Финансы и кредит

А.Я. Быстряков

