

Федеральное государственное образовательное  
бюджетное учреждение высшего образования

**«ФИНАНСОВЫЙ УНИВЕРСИТЕТ  
ПРИ ПРАВИТЕЛЬСТВЕ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»**

**(Финансовый университет)**

**Краснодарский филиал Финуниверситета**

Кафедра «Экономика и финансы»

СОГЛАСОВАНО

АО «НЭСК»

Начальник финансового управления



«15» февраля 2024 г.

Г.И. Купин

УТВЕРЖДАЮ

Директор Краснодарского филиала  
Финуниверситета, к.э.н., доцент



«20» февраля 2024 г.

Э.В. Соболев

Пименов Геннадий Геннадиевич

**ОСНОВЫ ТРЕЙДИНГА**

**Рабочая программа дисциплины**

для студентов, обучающихся по направлению подготовки  
38.03.01 Экономика, ОП "Экономика и финансы",  
профиль «Финансы и банковское дело» очно-заочной формы обучения

*Рекомендовано Ученым советом Краснодарского филиала Финуниверситета  
(протокол № 12 от 20.02.2024 г.)*

*Одобрено кафедрой «Экономика и финансы»  
(протокол № 7 от 23.01.2024 г.)*

**Краснодар 2024**

**УДК 336.7(073) А16**  
**ББК 65.262.1**  
**П32**

**Рецензент:** кандидат экономических наук, доцент кафедры «Экономика и финансы» Радченко М.В.

**Пименов Г.Г.**

Основы трейдинга. Программа дисциплины для студентов, обучающихся по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика», ОП " Экономика и финансы, профиль «Финансы и банковское дело» очно-заочной формы обучения. — Краснодар: Краснодарский филиал Финуниверситета, кафедра «Экономика и финансы», 2024 г. — 36 с.

Дисциплина «Основы трейдинга» входит в вариативную часть основной образовательной программы для подготовки бакалавров по направлению «Экономика», профиль «Финансы и банковское дело», очно-заочная форма обучения.

Рабочая программа дисциплины содержит перечень результатов освоения дисциплины, место дисциплины в структуре ОП, объем дисциплины в зачетных и академических часах, содержание дисциплины и форм текущего контроля успеваемости, перечень учебно-методического обеспечения, основной и дополнительной учебной литературы, программного обеспечения и информационных справочных систем, фонд оценочных средств, методические указания, описание материально-технической базы.

*Учебное издание*

**Пименов Геннадий Геннадиевич**

## **ОСНОВЫ ТРЕЙДИНГА**

**Рабочая программа дисциплины**

*Формат 60×90/17. Гарнитура Times New Roman*

*Усл. п.л. 2,6. Изд. № \_\_\_\_\_ от \_\_\_\_\_. Тираж 100 экз.*  
*Заказ № \_\_\_\_\_*

*Отпечатано в Краснодарском филиале Финуниверситета*

© Пименов Г.Г. 2024  
© Краснодарский филиал Финуниверситета, 2024

## 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.....	6
4	Объем дисциплины в зачетных единицах и в академических часах с выделением объема аудиторной (лекции, семинары) и самостоятельной работы обучающихся.....	7
5	Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) дисциплины с указанием их объемов (в академических часах) и видов учебных занятий.....	7
5.1	Содержание дисциплины.....	7
5.2	Учебно-тематический план.....	10
5.3	Содержание семинаров, практических занятий.....	11
6	Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине.....	13
6.1	Перечень вопросов, отводимых на самостоятельное освоение дисциплины, формы внеаудиторной самостоятельной работы...	13
6.2	Перечень вопросов, заданий, тем для подготовки к текущему контролю.....	15
7	Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине.....	17
8	Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины.....	22
9	Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины.....	24
10	Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины.....	26
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 Б1.В.03.ДВ.02.01 «Основы трейдинга».

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

Дисциплина «Основы трейдинга» обеспечивает формирования следующих компетенций направления 38.03.01 «Экономика»:

Таблица 1 – Компетенции, формируемые в результате изучения дисциплины «Основы трейдинга»

Код компетенции	Наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции	Результаты обучения (умения и знания), соотнесенные с индикаторами достижения компетенции
<i>Профессиональные компетенции профиля (ПКП)</i>			
ПКП-1	Способность выполнять профессиональные обязанности в процессе текущей деятельности институтов финансового рынка, финансовых департаментов компаний, эффективно организовывать их деятельность, обладая навыками решения проблем банковского дела, финансов, экономики и бизнес-аналитики	1. Демонстрирует способность выполнять профессиональные обязанности в процессе текущей деятельности финансовых служб организаций и финансово-кредитных институтов.	<i>Знать:</i> - профессиональные обязанности в процессе текущей деятельности финансовых служб организаций и финансово-кредитных институтов <i>Уметь:</i> - разрабатывать современные финансовые и кредитные продукты и услуги, реализовывать их и организовывать эффективную деятельность участников финансово-кредитной сферы
		2. Проводит критический анализ применяемых организациями финансовых и кредитных продуктов и услуг.	<i>Знать:</i> применяемые организациями финансовые и кредитные продукты и услуги. <i>Уметь:</i> проводить критический анализ применяемых организациями финансовых и кредитных продуктов и услуг
		3. Демонстрирует способность управлять финансовыми потоками, разрабатывать новые финансовые и кредитные продукты и услуги, с учетом доходности и риска, реализовывать их.	<i>Знать:</i> - управление финансовыми потоками <i>Уметь:</i> - управлять финансовыми потоками, разрабатывать новые финансовые и кредитные продукты и услуги, с учетом доходности и риска, реализовывать их.
		4. Разрабатывает эффективные	<i>Знать:</i> - направления деятельности различных подразделений финансовых

		направления деятельности различных подразделений финансовых департаментов организаций и финансово-кредитных институтов.	департаментов организаций и финансово-кредитных институтов. <i>Уметь:</i> - разрабатывать эффективные направления деятельности различных подразделений финансовых департаментов организаций и финансово-кредитных институтов
--	--	---	---

### 3 Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина «Основы трейдинга» является дисциплиной профиля вариативной части профессионального цикла дисциплин основной образовательной программы (ООП) по направлению «Экономика», профиль «Финансы и банковское дело» (бакалавриат), очно-заочная форма обучения.

Дисциплина «Основы трейдинга» углубляет и расширяет теоретические и прикладные знания по основам рыночной экономики; теории финансов, денежного обращения и кредита; бухгалтерского учета и экономического анализа, особенностей организации бухгалтерского учета в кредитных организациях; построение экономико-математического инструментария. Ее эффективное освоение базируется на знаниях, умениях и владениях, приобретенных студентами в ходе изучения таких дисциплин как: «Деньги кредит банки», «Банковское дело», «Банковский менеджмент и маркетинг».

Знания и навыки, полученные в процессе изучения дисциплины «Основы трейдинга» будут использованы студентами при изучении последующих дисциплин, предусмотренных учебным планом, при написании выпускной квалификационной (бакалаврской) работы, в процессе решения круга задач профессиональной деятельности в дальнейшем.

Таблица 2 - Междисциплинарные связи тем дисциплины с обеспечиваемыми (последующими) дисциплинами

№ п/п	Наименование обеспечиваемых (последующих) дисциплин	Номера разделов дисциплины, необходимых для изучения обеспечиваемых (последующих) дисциплин			
		1	2	3	4
1.	Деньги, кредит, банки	*	*	*	*
2.	Банковский бизнес	*	*	*	*
3.	Банковский менеджмент и маркетинг	*	*	*	*

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

Для направления подготовки 38.03.01 «Экономика», Финансы и банковское дело» (7 семестр), очно-заочной формы обучения общая трудоёмкость дисциплины составляет 3 зач. ед. 108 часов (таблица 3).

Таблица 3 – Трудоемкость дисциплины «Основы трейдинга» для направления 38.03.01 «Экономика», профиль «Финансы и кредит», очно-заочная форма обучения.

Вид учебной работы	Направление подготовки 38.03.01 «Экономика»	
	Всего (в з.е и часах)	Сем 7
<b>Общая трудоёмкость дисциплины</b>	<b>3/108</b>	<b>3/108</b>
<i>Контактная работа - Аудиторные занятия</i>	24	24
<i>Лекции</i>	8	8
Семинары, практические занятия	16	16
<i>Самостоятельная работа</i>	<b>84</b>	<b>84</b>
Вид промежуточной аттестации	зачет	зачет

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

### **5.1 Содержание разделов 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, мар-кетплейсы и краудфандинг. Маржинальная торговля. Финансовые риски трейдера и риск-менеджмент. Защита прав и законных интересов инвесторов

**Тема 2. 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 3. 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 4. 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. Инвестиционные портфели хедж-фондов и негосударственных пенсионных фондов.

#### **Тема 5. Торговые платформы, Алгоритмическая торговля и построение торговых алгоритмов**

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

Темы дисциплины и виды занятий для направления подготовки 38.03.01 «Экономика» представлены в таблице 4.

Таблица 4 - Распределение бюджета времени при изучении дисциплины «Основы трейдинга» для направления подготовки 38.03.01 «Экономика»,



профиль «Финансы и банковское дело», 4 курс очно-заочной формы обучения (в часах)

Наименование темы дисциплины	Трудоемкость в часах						Формы текущего контроля успеваемости
	Всего	Аудиторная работа				Самост оательн ая работа	
		Общая	Лекции	семинары, практическ ие занятия	занятия в интеракти вных формах		
1. Основы операций на финансовых рынках	22	5	2	3	2	17	Опрос
2. Финансовые инструменты: понятие и виды. Основные показатели.	21	4	1	3	2	17	Опрос, пратическое задание
3. Методы анализа финансовых инструментов. Технический и фундаментальный анализ	22	5	2	3	3	17	Опрос, пратическое задание
4. Инвестиционный портфель. Правила и принципы формирования инвестиционного портфеля.	21	4	1	3	3	17	Опрос, пратическое задание, контрольная работа по пройденному материалу
5. Торговые платформы, Алгоритмическая торговля и построение торговых алгоритмов	22	6	2	4	2	16	
В целом по дисциплине	108	24	8	16	12	84	
Итого в %					50		

### 5.3 Содержание семинаров, практических занятий

Практические занятия призваны путем диалога со студентами более глубоко и полно раскрыть особенности оценки банковской деятельности.

Цель проведения практических занятий — более глубокое усвоение студентами теоретических знаний и формирование навыков их применения в практической деятельности.

Содержание практических занятий для направления подготовки 38.03.01 «Экономика» представлено в таблице 5.

Таблица 5 – Трудоемкость практических занятий по дисциплине «Антикризисное управление в коммерческом банке» направления 38.03.01 «Экономика», профиль «Финансы и банковское дело» 4 курс очно-заочной формы обучения (в часах)

Наименование тем (разделов) дисциплины	Перечень вопросов для обсуждения на семинарских, практических занятиях, рекомендуемые источники из разделов 8,9	Формы проведения занятий
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. Рекомендуемые источники: раздел 8.1: 1-7; раздел 8.2: 1-2; раздел 8.3: 1-3; 9	1. Обсуждение вопросов темы 2. Обсуждение результатов самостоятельной работы в форме научной дискуссии
Тема 2. 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. Рекомендуемые источники: раздел 8.1: 1-7; раздел 8.2: 1-4; раздел 8.3: 1-3; 9	1. Обсуждение вопросов темы 2. Решение тестовых заданий 3. Обсуждение результатов самостоятельной работы в форме научной дискуссии

Тема 3. 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. Рекомендуемые источники: раздел 8.1: 1-7; раздел 8.2: 1-4; раздел. 8.3: 1-3; 9	1. Обсуждение вопросов темы 2. Решение тестовых заданий 3. Обсуждение результатов самостоятельной работы в форме научной дискуссии 4. Контрольная работа
Тема 4. 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. Инвестиционные портфели хеджфондов и негосударственных пенсионных фондов. Рекомендуемые источники: раздел 8.1: 1-7; раздел 8.2: 1-4; раздел. 8.3: 1-3; 9	1. Обсуждение вопросов темы 2. Решение тестовых заданий 3. Обсуждение результатов самостоятельной работы в форме научной дискуссии
Тема 5. 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 исследований. 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: 1-3; 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**

Основная цель самостоятельной работы студента при изучении дисциплины – закрепить теоретические знания, полученные в ходе лекционных занятий, а также сформировать навыки самостоятельного отбора и изучения, рекомендованных преподавателями кафедры учебной литературы, нормативных актов, материалов периодических изданий, их анализа и осмысления.

Самостоятельная работа студента в процессе освоения дисциплины «Антикризисное управление в коммерческом банке» включает:

- освоение рекомендованной преподавателем по данной дисциплине основной и дополнительной учебной литературы;
- изучение корпоративных образовательных ресурсов (электронные учебники, электронные библиотеки, электронные видеокурсы и др.);
- выполнение домашних заданий в виде решения отдельных задач;
- самостоятельный поиск информации в Интернете;
- выполнение контрольной работы;
- консультации по наиболее сложным вопросам;
- участие в работе видео-клуба по кафедре и ежегодных студенческих научных конференциях;
- подготовку к зачету.

На самостоятельную работу студентов, обучающихся по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика», профиль «Финансы и банковское дело» отводится 88 часов (очно-заочная форма) (таблица 6).

Таблица 6 – Трудоемкость самостоятельной работы студентов по дисциплине «Основы трейдинга» направления 38.03.01 «Экономика», профиль «Финансы и банковское дело», очно-заочная форма обучения.

Наименование разделов, тем, входящих в дисциплину	Указание разделов и тем, отводимых на самостоятельное освоение обучающимися	Форма внеаудиторной самостоятельной работы
Тема 1. Основы операций на финансовых рынках	Функции и роль финансовых инструментов. Анализ применения новых технологий на финансовых рынках.	1. Работа с литературой и другими источниками. 2. Подготовка к семинарскому занятию.
Тема 2. Финансовые инструменты: понятие и виды. Основные показатели.	1. Обоснование выбора финансовых инструментов под следующие цели инвестирования и торговли: - альтернатива банковскому депозиту; - структурные продукты с 100 % защитой депозита; - инвестирование в венчурные проекты; инвестирование в недвижимость.	1. Работа с литературой и другими источниками. 2. Подготовка к семинарскому занятию. 3. Подготовка к участию в дебатах.
Тема 3. Методы анализа финансовых инструментов. Технический и фундаментальный анализ	1. Методы технического анализа. Недостатки 2. Методы фундаментального анализа. Недостатки	1. Работа с литературой и другими источниками. 2. Подготовка к семинарскому занятию. 3. Подготовка к участию в дебатах. 4. Подготовка задания для самостоятельного выполнения 5. Подготовка контрольной работы
Тема 4. Инвестиционный портфель. Правила и принципы формирования инвестиционного портфеля.	1 Основные риски, возникающие по формированию инвестиционного портфеля. 2. Сравнительная характеристика современных портфельных теории.	1. Работа с литературой и другими источниками. 2. Подготовка к семинарскому занятию. 3. Подготовка к дискуссии. 4. Решение ситуационных задач 5. Подготовка контрольной работы
Тема 5. Торговые платформы, Алгоритмическая торговля и построение торговых алгоритмов	1. Системный трейдинг. Классификация автоматизированных торговых системы и принципы построения.	1. Работа с литературой и другими источниками. 2. Подготовка к семинарскому занятию. 3. Подготовка к участию в дебатах.

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

Аудиторная и внеаудиторная самостоятельная работа студентов состоит в знакомстве с периодическими изданиями и научной литературой по банковскому делу для написания контрольной работы и подготовке к зачету по дисциплине.

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. Робоэдвайзинг
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.

Вариант тестового задания:

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

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

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

C. 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):

A. Кредитному

B. Рыночному

C. 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):

A. 105,38%

B. 107,36%

C. 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 %

## **7 Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине**

### ***7.1. Перечень компетенций с указанием индикаторов их достижения в процессе освоения образовательной программы***

Перечень компетенций и их структура в виде знаний, умений содержатся в разделе 2 рабочей программы «Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы (перечень компетенций) с указанием индикаторов их достижения и планируемых результатов обучения по дисциплине».

### ***7.2. Типовые вопросы для оценки знаний и умений, характеризующих формирование компетенций***

Шифр компетенции	Вопросы	Правильный ответ
ПКП-1	1. При росте инфляционных ожиданий какие меры ЦБ РФ по изменению ключевой ставки будут оправданы?	Меры по повышению ключевой ставки
	2. Если при прочих равных условиях уменьшается экспорт из страны товаров, оплачиваемых в иностранной валюте, что произойдет с курсом национальной валюты?	Курс национальной валюты будет снижаться
	3. Как Центральному банку следует изменить норматив обязательных резервов для того, чтобы сократить инфляционное давление?	Поднять норматив обязательных резервов
	4. Какой тип амортизации может быть использован для перенесения стоимости актива в себестоимость продукции ускоренными темпами?	Ускоренный
	5. Каким образом стоит изменить налоги при прочих равных условиях на фазе кризиса в экономики для	Сократить ставки налогов



стимулирования экономического роста?	
6. Какой орган наделен правом эмиссии денег в Российской Федерации?	Центральный банк
7. Что необходимо предпринять с ключевой ставкой для предотвращения перегрева экономики на фазе экономического роста?	Поднять ключевую ставку
8. Как изменится уровень безработицы при осуществлении крупных государственных инфраструктурах проектов при прочих равных условиях?	Сократится
9. Можно ли отнести налоги к основным инструментам монетарной политики государства?	Нет
10. Каким образом стоит изменить объем субсидий и государственных дотаций при прочих равных условиях на фазе кризиса в экономики для стимулирования экономического роста?	Увеличить объем субсидий и дотаций
11. Какое воздействие при прочих равных условиях оказывает на инфляцию значительное увеличение налогообложения?	Инфляция сокращается
12. В условиях ограниченного воздействия денежно-кредитной политики, какие меры фискальной могут оказать сдерживающее воздействие на инфляцию при прочих равных условиях?	Повышение ставок налогообложения, сокращение субсидий и дотаций
13. При скачке ажиотажного спроса на иностранную валюту какие меры Центрального банка способны стабилизировать курс национальной валюты?	Повышение ключевой ставки, ограничение на вывоз и снятие валюты
14. К каким последствиям для денежного предложения приведет продажа Центральным банком государственных ценных бумаг?	Денежное предложение сократится
15. К каким изменениям совокупного спроса приведет сокращение ставки НДС?	Совокупный спрос будет увеличиваться
16. Относится ли совершенствование институциональной инфраструктуры к прямым методам государственного регулирования экономикой?	Нет
17. Какое изменение ключевой ставки может привести к увеличению объема ссуд, предоставляемых Центральным банком коммерческим банкам?	Сокращение ключевой ставки
18. Какое влияние оказывают на экономический рост дисфункции институциональной среды финансового рынка?	Отрицательное
19. В условиях ограниченного воздействия бюджетно-налоговой политики, какие меры денежно-кредитной могут оказать позитивное влияние на сокращение безработицы при прочих равных условиях?	Снижение ключевой ставки, сокращение норматива обязательных резервов
20. Как отразится на темпах экономического роста одновременное повышение ключевой ставки и уровня налогообложения?	Темп роста экономики замедлится
21. К какому изменению инвестиционного спроса приведет значительный рост инфляции?	Инвестиционный спрос будет сокращаться
22. Относятся ли изменения норматива обязательных резервов к основным инструментам фискальной политики государства?	Нет, не относятся
23. Каким образом, при прочих равных условиях,	Сальдо торгового

отразится на сальдо торгового баланса Китая увеличение Германией ввозных пошлин на китайские автомобили?	баланса Китая сократится
24. Как согласно Кейнсианской модели необходимо изменить ставки налогообложения для предотвращения перегрева экономики на фазе экономического роста?	Поднять ставки налогов
25. Какую политику в качестве доминирующей в регулировании экономики считали представители кейнсианства?	Бюджетно-налоговую
26. Можно ли отнести субсидии к инструментам денежно- кредитной политики?	Нет
27. Как изменятся темпы экономического роста при осуществлении крупномасштабных государственных инфраструктурных проектов при прочих равных условиях?	Экономический рост ускорится
28. К чему может привести при прочих равных условиях отмена специальных налоговых режимов в России?	К росту теневого сектора и сокращению объема налоговых поступлений в бюджет
29. Как отразится на экономическом росте стимулирование инвестиционного спроса инструментами денежно-кредитной политики?	Экономический рост ускорится
30. К каким изменениям совокупного предложения приведет сокращение ставки налога на прибыль?	К росту совокупного предложения
31. Каком образом политика «дорогих» денег отражается на денежной массе?	Денежная масса сокращается
32. Какое влияние оказывают внешнеэкономические и внешнеполитические факторы на точность прогнозирования параметров денежно-кредитной политики?	Отрицательное, точность прогноза сокращается
33. При увеличении ключевой ставки что произойдет с объемом ссуд, предоставляемых Центральным банком коммерческим банкам?	Он сократится
34. К каким операциям на открытом рынке следует прибегнуть Центральному банку страны в случае чрезмерного укрепления национальной валюты?	К операциям по покупке иностранной валюты
35. Какое воздействие при прочих равных условиях оказывает на инфляцию значительное увеличение государственных расходов?	Инфляция увеличивается
36. Как изменится денежное предложение если Центральный банк начнет выкупать государственные ценные бумаги?	Денежное предложение увеличится
37. Какое влияние оказывает волатильность цен на рынке углеводородов на точность прогнозирования параметров бюджетно-налоговой политики России?	Точность прогноза сокращается при росте волатильности рынка
38. Какое изменение норматива обязательных резервов может привести к увеличению объема ссуд, предоставляемых Центральным банком коммерческим банкам?	Сокращение норматива обязательных резервов

### 7.3 Тесты

Шифр компетенции	Тестовые задания	Правильный ответ
ПКП-1	1. Если наблюдается устойчивое повышение общего уровня цен на товары и услуги в экономике, то о каком явлении идет речь А) дефляция Б) инфляция В) волатильность Г) таргетирование	Б
	2. К какому агрегату ЦБ РФ относятся наличные деньги в обращении (монеты, банкноты)? А) М0 Б) М1 В) М2 Г) М3	А
	3. Основным инструментом денежно-кредитной политики Банка России является... А) ставка рефинансирования Б) ключевая ставка В) норматив обязательных резервов Г) валютные интервенции	Б
	4. Монетарная политика – это: А) решения, принимаемые государством относительно своих расходов и налогов Б) действия Центрального банка страны по изменению предложения денег и доступности кредита для поддержания стабильности цен В) политика установления торговых барьеров в международной торговле Г) изменение министерством финансов параметров бюджетно-налогового регулирования	Б
	5. Регламентируемая законодательством Российской Федерации деятельность органов государственной власти, органов местного самоуправления и иных участников бюджетного процесса по составлению и рассмотрению проектов бюджетов, утверждению и исполнению бюджетов, контролю за их исполнением, осуществлению бюджетного учета, составлению, внешней проверке, рассмотрению и утверждению бюджетной отчетности называется А) налоговое администрирование Б) монетарное регулирование В) бюджетное правило Г) бюджетный процесс	Г
	6. Какой федеральный орган исполнительной власти осуществляет функции по выработке государственной политики и нормативно-правовому регулированию в сферах банковской и страховой деятельности, кредитной кооперации, микрофинансовой деятельности, финансовых рынков, организации и проведения лотерей, азартных игр, производства и реализации защищенной от подделок полиграфической продукции, государственного регулирования деятельности бюро кредитных историй А) Казначейство	Б

Б) Минфин В) МВД Г) Генеральная прокуратура	
7. Для сдерживания инфляции ЦБ РФ... А) повышает ключевую ставку Б) снижает ключевую ставку В) повышает налоги Г) снижает налоги	Б
8. При режиме таргетирования инфляции валютный курс является... А) фиксированным Б) плавающим В) частично ограниченным Г) полностью ограниченным	Б
9. Состояние финансовой системы, в котором не происходит формирования системных рисков, способных при реализации оказать негативное воздействие на процесс трансформации сбережений в инвестиции и реальный сектор экономики А) дисфункция Б) дисбаланс В) финансовая стабильность Г) финансовый разрыв	В
10. Отношение стоимости фиксированного набора товаров и услуг в ценах текущего периода к его стоимости в ценах предыдущего (базисного) периода – это... А) индекс ликвидности Б) индекс Херфиндаля-Хиршмана В) индекс Лернера Г) индекс потребительских цен	Г
11. К методам таможенного регулирования относят А) тарифные методы Б) монетарные методы В) фискальные методы Г) экспертные методы	А
12. Налоговый вычет – это... А) уменьшение налогооблагаемого дохода при исчислении НДФЛ, либо возврат части ранее уплаченного НДФЛ в установленных законодательством РФ о налогах и сборах случаях Б) уменьшение налогооблагаемого дохода при исчислении налога на прибыль, либо возврат части ранее уплаченного налога на прибыль в установленных законодательством РФ о налогах и сборах случаях В) уменьшение налогооблагаемого дохода при исчислении налога на имущество, либо возврат части ранее уплаченного налога на имущество в установленных законодательством РФ о налогах и сборах случаях Г) уменьшение налогооблагаемого дохода при исчислении НДС, либо возврат части ранее уплаченного НДС в установленных законодательством РФ о налогах и сборах случаях	А

### 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.

### **Критерии оценивания знаний и умений, характеризующих степень сформированности компетенций:**

- **«зачтено»** выставляется в том случае, если компетенция по дисциплине освоена. Оценка выставляется при получении обучающимся более 50 баллов. При этом он:

**знает:** методы решения проблем текущей деятельности банков на основе результатов прикладных научных исследований в профессиональной сфере; принципы формирования стратегии развития банков, стратегического и финансового планирования; передовые концепции, технологии, модели в области банковского менеджмента; инструментарий банковского управления;

**умеет:** принимать эффективные решения проблем текущей деятельности банков на основе результатов прикладных научных исследований в профессиональной сфере; формировать стратегии развития банков, обосновывать объемы и выбирать методы финансового обеспечения их реализации, разрабатывать предложения по координации стратегического и финансового планирования в банке; применять передовые концепции, технологии, модели в области финансового менеджмента в изменяющихся условиях профессиональной деятельности; выявлять и использовать инструментарий банковского управления, соответствующий трансформациям современной российской экономической среды.

- **«не зачтено»** выставляется в том случае, если компетенция не освоена, ответы содержат существенные ошибки и обучающимся получено менее 50 баллов. При этом он:

**не знает:** методы решения проблем текущей деятельности банков на основе результатов прикладных научных исследований в профессиональной сфере; принципы формирования стратегии развития банков, стратегического и финансового планирования; передовые концепции, технологии, модели в

области банковского менеджмента; инструментарий банковского управления;

**не умеет:** принимать эффективные решения проблем текущей деятельности банков на основе результатов прикладных научных исследований в профессиональной сфере; формировать стратегии развития банков, обосновывать объемы и выбирать методы финансового обеспечения их реализации, разрабатывать предложения по координации стратегического и финансового планирования в банке; применять передовые концепции, технологии, модели в области финансового менеджмента в изменяющихся условиях профессиональной деятельности; выявлять и использовать инструментарий банковского управления, соответствующий трансформациям современной российской экономической среды.

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

### *Нормативные акты*

1 Бюджетный кодекс Российской Федерации от 31.07.1998 г. № 145-ФЗ (с доп. и изм.). – URL: [http:// www.consultant.ru](http://www.consultant.ru) (дата обращения: 10.01.2024).

2 Гражданский кодекс Российской Федерации (часть 1) от 30.11.1994 г. № 51-ФЗ (с доп. и изм.). URL: <http://www.consultant.ru> (дата обращения: 10.01.2024).

3 Гражданский кодекс Российской Федерации (часть 2) от 26.01.1996 г. № 14-ФЗ (с доп. и изм.). URL: [http:// www.consultant.ru](http://www.consultant.ru) (дата обращения: 10.01.2024).

4 Налоговый кодекс Российской Федерации (часть 1) от 31.07.1998 г. № 146-ФЗ (с доп. и изм.). URL: [http:// www.consultant.ru](http://www.consultant.ru) (дата обращения: 10.01.2024).

5 Налоговый кодекс Российской Федерации (часть 2) от 05.08.2000 №

117-ФЗ (с доп. и изм.). URL: [http:// www.consultant.ru](http://www.consultant.ru) (дата обращения: 10.01.2024).

6 Федеральный закон «Об акционерных обществах» от 26.12.1995 г. №208-ФЗ (с доп. и изм.). URL: <http://www.consultant.ru> (дата обращения: 10.01.2024).

7 Федеральный закон «Об обществах с ограниченной ответственностью» от 08.02.1998 г. №14-ФЗ (с доп. и изм.). URL: <http://www.consultant.ru> (дата обращения: 10.01.2024).

8 Федеральный закон «О рынке ценных бумаг» от 22.04.1996 № 39-ФЗ (с доп. и изм.) URL: <http://www.consultant.ru> (дата обращения: 10.01.2024).

9 Федеральный закон «Об инвестиционной деятельности в Российской Федерации, осуществляемой в форме капитальных вложений» от 25.02.1999 г. № 39-ФЗ (с доп. и изм.). URL: <http://www.consultant.ru> (дата обращения: 10.01.2024).

10 Федеральный закон «О финансовой аренде (лизинге)» от 29.10.1998 г. №164-ФЗ (с доп. и изм.). URL: <http://www.consultant.ru> (дата обращения: 10.01.2024).

11 Федеральный закон «О несостоятельности (банкротстве)» от 26.10.2002 г. №127-ФЗ (с доп. и изм.). URL: <http://www.consultant.ru> (дата обращения: 10.01.2024).

12 Федеральный закон от 08.05.1996 № 41-ФЗ «О производственных кооперативах» (с доп. и изм.). URL: <http://www.consultant.ru> (дата обращения: 10.01.2024).

13 Постановление Правительства РФ от 01.01.2002 №1 «О классификации основных средств, включаемых в амортизационные группы» (с изм. и доп.). URL: <http://www.consultant.ru> (дата обращения: 10.01.2024).

14 Постановление Правительства РФ от 25.06.2003 №367 «Об утверждении правил проведения арбитражным управляющим финансового анализа». URL: <http://www.consultant.ru> (дата обращения: 10.01.2024).



### *Основная 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). - ЭБС ZNANIUM.com. - URL: <http://znanium.com/catalog/product/395330>. - (дата обращения: 10.01.2024). —Текст : электронный.
2. Сребник, Б.В. Рынок ценных бумаг: учебное пособие / Б.В. Сребник. - Москва : Кнорус, 2014, 2016. - 288 с. - Текст: непосредственный. - То же. - 2020. - ЭБС BOOK.ru. - URL: <https://www.book.ru/book/932207> - (дата обращения: 10.01.2024). —Текст : электронный.
3. Банковские риски. : учебник / О.И. Лаврушин, Н.И. Валенцева, О.В. Захарова, Л.Н. Красавина [и др.] ; под ред. О.И. Лаврушина, Н.И. Валенцевой. — Москва : КноРус, 2019. — 292 с. — (Бакалавриат и магистратура). - ЭБС BOOK.ru. - URL: <https://book.ru/book/931065>. — (дата обращения: 10.01.2024). —Текст : электронный.
4. Шарп, У.Ф. Инвестиции: учебник / У.Ф. Шарп, Г.Д. Александер, Д.В. Бейли. - Москва: ИНФРА-М, 2007, 2011, 2013, 2016. - 1028 с. - (Университетский учебник). - Текст : непосредственный. - То же. - 2020. - ЭБС ZNANIUM.com. - URL: <http://znanium.com/catalog/product/1080428> (дата обращения: 10.01.2024). —Текст : электронный.

### *Дополнительная 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). — [www.dx.doi.org/10.12737/23640](http://www.dx.doi.org/10.12737/23640). - ЭБС ZNANIUM.com. - URL: <https://new.znanium.com/catalog/product/1015324>- (дата обращения: 10.01.2024). —Текст : электронный.
2. Гусева, И.А. Рынок ценных бумаг. Сборник тестовых заданий: Учебное пособие для студ., обуч. по спец. "Бухучет, анализ и аудит",

"Финансы. и кредит", "Мировая экономика", "Налоги и налогообложение" / И.А. Гусева. - Москва.: Кнорус, 2013, 2016. - 406 с.

3. Брусов, П.Н. Финансовая математика: Учебное пособие для студ., обуч. по напр. "Экономика", "Финансы и кредит" (степень - магистр) / П.Н. Брусов, Т.В. Филатова. - Москва: Инфра-М, 2014. - 480 с. – Текст: непосредственный. - То же. — 2020. – ЭБС ZNANIUM.com. — URL: <https://new.znanium.com/catalog/product/1036624>. — (дата обращения: 10.01.2024). —Текст : электронный.

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

1. URL:<http://www.rbk.ru> -Официальный сайт РосБизнесКонсалтинг
2. URL:<http://arb.ru> -Официальный сайт Ассоциации российских банков
3. URL:<http://futurebanking.ru> -Официальный сайт ООО «Регламент-Медиа»
4. URL:<http://rbc.ru> -Официальный сайт ИА «РБК».
5. URL:<http://www.banki.ru> -Официальный сайт ИА «Банки.ру»
6. URL:<http://www.bankir.ru> -Официальный сайт ИА «Банкир.ру»
7. URL:<http://www.cbr.ru> -Официальный сайт Банка России
8. URL:<http://www.fintechru.org> -Официальный сайт Ассоциации ФинТех
9. URL:<http://www.prime-tass.ru> -Агентство экономической информации «Прайм-Тасс»
10. URL:<http://www.tadviser.ru> -Официальный сайт «Tadviser.ru».
11. Электронная библиотека Финансового университета (ЭБ) <http://elib.fa.ru/>
12. Электронно-библиотечная система BOOK.RU <http://www.book.ru>
13. Электронно-библиотечная система Znanium <http://www.znanium.com>
14. Электронно-библиотечная система издательства «ЮРАЙТ»  
<https://www.biblio-online.ru/>
15. Научная электронная библиотека eLibrary.ru <http://elibrary.ru>

16.Электронная библиотека диссертаций Российской государственной библиотеки <https://dvs.rsl.ru>

## **10 Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины**

### *Методические рекомендации по изучению дисциплины*

Студентам необходимо ознакомиться с содержанием рабочей программы дисциплины (далее - РПД), с целями и задачами дисциплины, ее связями с другими дисциплинами образовательной программы, методическими разработками по данной дисциплине, имеющимся на образовательном портале и сайте кафедры, с графиком консультаций преподавателей кафедры.

### *Рекомендации по подготовке к лекционным занятиям*

Изучение дисциплины «Основы трейдинга» требует систематического и последовательного накопления знаний, следовательно, пропуски отдельных тем не позволяют глубоко освоить предмет. Именно поэтому контроль над систематической работой студентов всегда находится в центре внимания кафедры.

Студентам необходимо:

- перед каждой лекцией просматривать рабочую программу дисциплины, что позволит сэкономить время на записывание темы лекции, ее основных вопросов, рекомендуемой литературы;
- на отдельные лекции приносить соответствующий материал на бумажных носителях, представленный лектором на портале или присланный на «электронный почтовый ящик группы» (таблицы, графики, схемы). Данный материал будет охарактеризован, прокомментирован, дополнен непосредственно на лекции;

- перед очередной лекцией необходимо просмотреть по конспекту материал предыдущей лекции. При затруднениях в восприятии материала следует обратиться к основным литературным источникам. Если разобраться в материале опять не удалось, то обратитесь к лектору (по графику его консультаций) или к преподавателю на практических занятиях. Не оставляйте «белых пятен» в освоении материала.

#### *Рекомендации по подготовке к семинарским занятиям*

Студентам следует:

- приносить с собой рекомендованную преподавателем литературу к конкретному занятию;
- до очередного практического занятия по рекомендованным литературным источникам проработать теоретический материал, соответствующей темы занятия;
- при подготовке к практическим занятиям следует обязательно использовать не только лекции, учебную литературу, но и нормативно-правовые акты и материалы правоприменительной практики;
- теоретический материал следует соотносить с правовыми нормами, так как в них могут быть внесены изменения, дополнения, которые не всегда отражены в учебной литературе;
- в начале занятий задать преподавателю вопросы по материалу, вызвавшему затруднения в его понимании и освоении при решении задач, заданных для самостоятельного решения;
- в ходе семинара давать конкретные, четкие ответы по существу вопросов;
- на занятии доводить каждую задачу до окончательного решения, демонстрировать понимание проведенных расчетов (анализов, ситуаций), в случае затруднений обращаться к преподавателю.

Студентам, пропустившим занятия (независимо от причин), не имеющие письменного решения задач или не подготовившиеся к данному

практическому занятию, рекомендуется не позже чем в 2-недельный срок явиться на консультацию к преподавателю и отчитаться по теме, изучавшейся на занятии.

Студенты, не отчитавшиеся по каждой не проработанной ими на занятиях теме к началу зачетной сессии, упускают возможность получить положенные баллы за работу в соответствующем семестре.

#### *Методические рекомендации по выполнению различных форм самостоятельных домашних заданий*

Самостоятельная работа студентов включает в себя выполнение различного рода заданий, которые ориентированы на более глубокое усвоение материала изучаемой дисциплины. По каждой теме учебной дисциплины студентам предлагается перечень заданий для самостоятельной работы.

К выполнению заданий для самостоятельной работы предъявляются следующие требования: задания должны выполняться 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;
- использовать при подготовке нормативные документы Финансового университета, а именно, положений о реферате, эссе, контрольной работе, домашнем творческом задании, утвержденные приказом №611/о от 01 апреля 2014 года, положения о расчетно-аналитической работе, утвержденного приказом № 2161/0 от 19 декабря 2013 года (см. сайт Финансового Университета: на главной странице раздел «Наш университет»; далее

«Единая правовая база Финуниверситета»; подраздел «Методическая работа» - «Приказы Финуниверситета»);

- при подготовке к экзамену параллельно прорабатывать соответствующие теоретические и практические разделы дисциплины, фиксируя неясные моменты для их обсуждения на плановой консультации.

#### *Методические рекомендации по подготовке научного доклада (эссе)*

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

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

Научный доклад (эссе) готовится под руководством преподавателя, который ведет практические (семинарские) занятия.

Рекомендации студенту:

- перед началом работы по написанию научного доклада согласовать с преподавателем тему, структуру, литературу, а также обсудить ключевые вопросы, которые следует раскрыть в докладе (эссе);

- представить доклад (эссе) научному руководителю в письменной форме;

- выступить на семинарском занятии с 10-минутной презентацией своего научного доклада (эссе), ответить на вопросы студентов группы.

Требования:

- к оформлению научного доклада (эссе): 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 (эссе) скреплены скоросшивателем. На титульном листе указывается наименование

учебного заведения, название кафедры, наименование дисциплины, тема доклада (эссе), ФИО студента;

- к структуре доклада (эссе) - оглавление, введение (указывается актуальность, цель и задачи), основная часть, выводы автора, список литературы (не менее 5 позиций). Объем согласовывается с преподавателями. В конце работы ставится дата ее выполнения и подпись студента, выполнившего работу.

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

#### *Методические рекомендации по организации «круглого стола» и научной дискуссии*

При реализации дисциплины «Основы трейдинга» используются следующие интерактивные формы проведения занятий:

- круглый стол (научная дискуссия);
- электронный портфолио (формирование ресурсной папки профессиональных материалов);
- метод проектов;
- работа в малых группах.

*«Круглый стол»* организуется следующим образом:

- 1) преподавателем формулируются вопросы, обсуждение которых позволит всесторонне рассмотреть проблему;
- 2) вопросы распределяются по подгруппам и раздаются участникам для целенаправленной подготовки;
- 3) в ходе занятия вопросы раскрываются в определенной последовательности;
- 4) выступления специально подготовленных студентов обсуждаются и дополняются.

Задаются вопросы, учащиеся высказывают свои мнения, спорят, обосновывают свою точку зрения.

*Научная дискуссия*, как особая форма всестороннего обсуждения спорного вопроса в публичном собрании, в частной беседе, споре, реализуется как коллективное обсуждение какого-либо вопроса, проблемы или сопоставление информации, идей, мнений, предложений. Целью проведения дискуссии в этом случае является обучение, тренинг, изменение установок, стимулирование творчества и др. В проведении дискуссии используются различные организационные методики:

– Методика «вопрос – ответ» – разновидность простого собеседования; отличие состоит в том, что применяется определённая форма постановки вопросов для собеседования с участниками дискуссии-диалога.

– Методика «лабиринта» или метод последовательного обсуждения – своеобразная шаговая процедура, в которой каждый последующий шаг делается другим участником. Обсуждению подлежат все решения, даже неверные (тупиковые).

– Методика «эстафеты» – каждый заканчивающий выступление участник передает слово тому, кому считает нужным.

– Свободно плавающая дискуссия – когда группа к результату не приходит, но активность продолжается за рамками занятия. В основе такой процедуры групповой работы лежит «эффект Б.В. Зейгарник», характеризующийся высоким качеством запоминания незавершенных действий, когда участники продолжают «домысливать» наедине идеи, которые оказались незавершенными.

В основе «*круглого стола*» в форме «дебатов» организуемое как свободное высказывание, обмен мнениями по предложенному аспирантами тематическому тезису, эта форма «круглого стола» посвящена получению однозначного ответа на поставленный вопрос – «да» или «нет». Причем одна группа – утверждающие – является сторонниками положительного ответа, а другая группа – отрицающие – сторонниками отрицательного. Внутри каждой из групп могут образовываться 2 подгруппы, одна подгруппа – подбирает аргументы, а вторая – разрабатывает контраргументы. Участники



дебатов приводят примеры, факты, аргументируют, логично доказывают, поясняют, дают информацию и т.д. Процедура дебатов не допускает личностных оценок, эмоциональных проявлений. Обсуждается тема, а не отношение к ней отдельных участников.

*Разбор ситуации* – это изложение гипотетической ситуации, которое используется для анализа и обсуждения. Этот метод стимулирует дискуссии и обсуждения в группах, совместные поиски новых путей работы. Метод используется для обсуждения различных проблем, с которыми в типовой ситуации сталкиваются практически все гражданские служащие, и развивает навыки коллективной работы над разрешением и преодолением трудностей. Этапы процесса: описание конкретной ситуации, детальное ознакомление с ситуацией; формулирование проблемы, которую надо разрешить и вопросов для обсуждения, подготовка к обсуждению и поиск путей решения проблемы; изложение подготовленных предложений или вариантов ответов на вопросы; обсуждение предложенных вариантов решений; обобщение результатов занятий и подведение итогов.

Кейс-метод – это способ рассмотреть реальную экономическую (управленческую) ситуацию. Предполагает анализ информации в изучаемом объекте, постановку проблемы, поиск решений, составление (отбор) предлагаемых путей решения проблемы, формирование цели в виде программы (действий). Данный метод привязывает дискуссию к реальным фактам, с которыми участникам игры в той или иной мере доведется иметь дело на практике. Деловая игра позволяет аспирантам осмыслить механизм и средство решения актуальных проблем, попробовать себя в роли менеджера, руководителя, ответственного за принятие решений.

Кейс-метод не ограничивается лишь совместным обсуждением проблемы в учебной аудитории, предполагает реализацию следующих шагов:

- индивидуальную подготовку участников к обсуждению конкретной ситуации (сбор информации) по обсуждаемой проблеме;

- предварительное неформальное обсуждение кейс-ситуации в активной группе однокурсников;
- кейс-обсуждение под руководством преподавателя;
- письменная контрольная работа с использованием кейса.

#### *Методические рекомендации по написанию контрольных работ*

Выполнение контрольной работы направлено на развитие теоретических знаний и закрепление практических навыков по принятию оптимальных управленческих решений в банке, поэтому ее написание предусматривает подбор материала по предлагаемым вопросам. Задания составлены таким образом, чтобы освоить теоретическую часть вопроса, проработать часть теоретико-прикладного материала курса и сделать вывод по эффективности практических проявлений данной операции в конкретном банке или его подразделении. Задания имеют логическую взаимосвязь, что обеспечивает студенту комплексное освоение вопроса.

Выполненная и оформленная в соответствии с требованиями кафедры «Экономика и финансы» контрольная работа прикрепляется в информационно-образовательном портале для проверки преподавателем.

#### *Методические рекомендации по работе с литературой*

Любая форма самостоятельной работы студента (подготовка к семинарскому занятию, написание доклада, эссе, курсовой работы и т.п.) начинается с изучения соответствующей литературы как в библиотеке, так и дома.

К каждой теме учебной дисциплины подобрана основная и дополнительная литература.

Основная литература - это учебники и учебные пособия.

Дополнительная литература - это монографии, сборники научных трудов, журнальные и газетные статьи, различные справочники, энциклопедии, интернет ресурсы.

Рекомендации студенту:

- выбранную монографию или статью целесообразно внимательно просмотреть. В книгах следует ознакомиться с оглавлением и научно-справочным аппаратом, прочитать аннотацию и предисловие. Целесообразно ее пролистать, рассмотреть иллюстрации, таблицы, диаграммы, приложения. Такое поверхностное ознакомление позволит узнать, какие главы следует читать внимательно, а какие прочесть быстро;

- в книге или журнале, принадлежащие самому студенту, ключевые позиции можно выделять маркером или делать пометки на полях. При работе с Интернет - источником целесообразно также выделять важную информацию;

- если книга или журнал не являются собственностью студента, то целесообразно записывать номера страниц, которые привлекли внимание. Позже следует возвратиться к ним, перечитать или переписать нужную информацию.

Физическое действие по записыванию помогает прочно заложить данную информацию в «банк памяти».

Записи в той или иной форме не только способствуют пониманию и усвоению изучаемого материала, но и помогают вырабатывать навыки ясного изложения в письменной форме тех или иных теоретических вопросов.

## **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. Astro Linux

2. Libre Office

### **11.2 Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы**

1 Справочная правовая система «Консультант Плюс». URL: <https://www.consultant.ru/>

2 Информационно-правовая система «Гарант-аэро». URL: <http://www.garant.ru>

11.3 Сертифицированные программные и аппаратные средства защиты информации: не предусмотрены

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

Материально-техническая база Краснодарского филиала Финансового университета соответствует действующим противопожарным правилам и нормам, обеспечивает проведение всех видов дисциплинарной и междисциплинарной подготовки, практической и научно-исследовательской работ обучающихся, предусмотренных учебным планом.

Образовательный процесс обеспечивается специальными помещениями, которые представляют собой аудитории для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, выполнения курсовых работ, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, помещения для самостоятельной работы студентов и помещения для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования. Специальные помещения укомплектованы специализированной мебелью и техническими средствами обучения, обеспечивающими представление учебной информации большой аудитории, демонстрационным оборудованием.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой, обеспечивающей доступ к сети Интернет и электронной информационно-образовательной среде Финансового университета.