

## **АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ**

### **Б1В.09 «Финансовые рынки, алгоритмический трейдинг и портфельное управление»**

**Автор:** Кабаков Ярослав Александрович, Заместитель генерального директора АО «Инвестиционная компания "ФИНАМ"»

**Код и наименование направления подготовки, профиля:** 38.04.02 Менеджмент «Прорывные финансовые и цифровые технологии»

**Квалификация (степень) выпускника:** Магистр

**Форма обучения:** очная

#### **Цель освоения дисциплины:**

Сформировать следующие компетенции: на уровне знаний – понимание роли и функции финансовых рынков; на уровне умений – способность применять различные финансовые модели в зависимости от условий; на уровне навыков – умение вести обработку финансовых данных.

#### **План курса:**

##### Тема 1. Основы трейдинговых операций

Основные типы поведения инвестора на фондовом рынке. Понятие трейдинга. Классификация субъектов торговли. Инвесторы, спекулянты, игроки на фондовом рынке. Арбитражеры и хеджеры. Скальпинг, дейтрейдинг, позиционная торговля, инвестирование. Маржинальная торговля. Психологическая составляющая торговли. Дисциплина, организация, ответственность трейдера. Анализ и контроль деятельности.

##### Тема 2. Механизм биржевой торговли

Процессы, протекающие на биржевых рынках. Виды рынков и инструментов, механизм и участники торговли, типы заявок и сделок. Организация расчетов и учета прав на инструменты. Источники информации о торговой сессии. Биржевая информация как индикатор настроения рынка.

##### Тема 3. Практические аспекты осуществления торговых операций

Типы инвестиционных посредников. Брокер - основной представитель трейдера. Критерии выбора брокера. Типы договорных отношений с брокером. Тарифная политика брокера и основные затраты инвестора. Правила расчета «входного порога» - минимальной суммы средств на счете. Открытие позиции. Длинная и короткая позиция. Позиция «с плечом». Заккрытие позиции. Способы закрытия позиции. проскальзывание. Понятие транзакции - завершенной позиции. 10 Контроль риска. Правила входа в позицию, удержания объема, контроля риска. Выбор размера позиции.

##### Тема 4. Торговые платформы и их применение в трейдинге

Виды торговых платформ, их практическое использование. Наиболее распространенные торговые платформы - QUIK, TRANZAQ, Алортрейд. Техническое оснащение трейдера. Аналитические системы, их особенности. Возможности построения МТС на основе торговых и аналитических систем. Организация электронного «рабочего места». Исходные данные. Построение основных таблиц и графиков. Анализ графической и аналитической информации, результатов сделок. Ведение дневника трейдера. Кривая капитала, основные показатели эффективности торговли.

## Тема 5. Алгоритм торговли и построение торговых стратегий

Формирование собственного стиля торговли, выбор рынков и инструментов. Основные правила поведения на рынке. Формирование системы «запретов». Разработка плана принятия инвестиционного решения. Выбор метода анализа - фундаментальный и технический анализ. Проведение исследования. Бэк-тестирование. Правила проведения исторического тестирования и моделирования. Порядок тестирования системы и критерии оценки системы. Порядок ревизии и отказа от торговой системы. Стратегии торговли «хождения «за трендом» и «против тренда»». Торговля «по стакану». Отслеживание поведения крупных игроков рынка.

В результате освоения дисциплины у студентов должны быть сформированы:

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
ПК-3	Способность использовать современные методы управления корпоративными финансами для решения стратегических задач	ПК-3.3	Способен оценить применимость и эффективность финансового инструмента для решения стратегических задач
ПК-4	способность управлять организациями, подразделениями, группами (командами) сотрудников, проектными сетями	ПК-4.1	способен управлять организациями, подразделениями, группами (командами) сотрудников, проектными сетями
ПК-5	владение методами экономического и стратегического анализа поведения экономических агентов и рынков в глобальной среде	ПК-5.1	владеет методами экономического и стратегического анализа поведения экономических агентов и рынков в глобальной среде
ПК-6	способность обобщать и критически оценивать результаты исследований актуальных проблем управления, полученных отечественными и зарубежными	ПК-6.1	Способен обобщать и критически оценивать результаты исследований актуальных проблем управления, полученных отечественными и зарубежными исследователями

	исследователями		
ПК ОС-13	способность принимать управленческие решения на основе анализа структурированных и неструктурированных данных	ПК ОС-13.1	способен принимать управленческие решения на основе анализа структурированных и неструктурированных данных
ПК ОС-14	Готовность к созданию и оценке финансовых инновационных инициатив с использованием аналитических финансовых инструментов и стратегий	ПК ОС-14.1	Овладел навыком создания и оценки финансовых инновационных инициатив с использованием аналитических финансовых инструментов и стратегий

#### **Формы и методы текущего контроля и промежуточной аттестации:**

В ходе реализации дисциплины используются следующие методы текущего контроля и успеваемости обучающихся:

Опрос, тест, диспут, итоговый экзамен.

#### **Основная литература:**

1. Питер Бернстайн Фундаментальные идеи финансового мира [Электронный ресурс] : эволюция / Бернстайн Питер. — Электрон. текстовые данные. — М. : Альпина Паблишер, 2016. — 256 с. — 978-5-9614-5383-6. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/41499.html>
2. Галанов В.А. Рынок ценных бумаг: Учебник / Галанов В.А. - М. : ИНФРА-М, 2015. - 378с., ЭБС Znanium.;
3. Сребник Б.В. Финансовые рынки: профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг: Учебное пособие / Б.В. Сребник [и др.]; Финуниверситет. - М.: ИНФРА-М, 2014. - 366с., ЭБС Znanium.;
4. Сребник Б.В. Рынок ценных бумаг: Учебное пособие / Сребник Б.В.; Финуниверситет. - М.:Кнорус, 2014. - 288с.;