

МУНИЦИПАЛЬНОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБЩЕОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ
«СРЕДНЯЯ ШКОЛА № 39»

Согласовано:
председатель научно-методического
совета
Ж.А. Ковалева
протокол № 1
от «31» августа 2023г.

Утверждаю:
директор МБОУ «СШ № 39»
М. Н. Титова
Приказ № 01-05-357
от «01» сентября 2023г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА
КУРСА «ОСНОВЫ ФОНДОВОЙ И ВАЛЮТНОЙ БИРЖИ»

Класс: 10-11

Срок реализации данной программы: 2023-2024 уч. год

Учитель истории и обществознания: Коростик Ксения Павловна

г. Норильск, 2023г.

Пояснительная записка

Программа курса модифицирована и составлена из следующих программ в соответствии с изучаемыми разделами:

- Программа Т.А. Панова «Операции банка с ценными бумагами»
- Программа А.У Солтаханов «Валютные операции банков»
- Программа О.В. Помаскина, В.М. Аскинадзи, М.В.Пашковская «Рынок ценных бумаг»
- Программа «Фондовая биржа» А.А. Фоменко

Актуальность проблем школьного экономического образования обусловлена радикальными изменениями в политической и экономической жизни России, с ее новым витком развития в мировой экономике. Исходя из концепции современной школы – воспитать конкурентоспособную творческую личность, наделить ее такими знаниями и навыками, которые помогли бы достичь успешности в жизни. В данном случае обучение основам фондовой и валютной биржи поможет ученикам ориентироваться в экономическом современном обществе в условиях стремительно развивающихся рыночных отношений.

Сегодня никому не нужно доказывать необходимость экономических знаний. Невозможно представить современного человека, не столкнувшегося с проблемами рыночных отношений. И чем раньше он проявит интерес к проблемам экономики, постоянная потребность в экономическом знании, тем легче ему будет строить свою взрослую жизнь. Предполагаемый курс призван помочь учащимся определиться с будущей профессией. Курс рекомендован для социальной адаптации учащихся к происходящим экономическим изменениям в жизни мирового сообщества, а также для профессиональной ориентации выпускников. Этот курс будет интересен для учеников планирующих связать свою будущую деятельность с экономикой, маркетингом, финансами и кредитом. Управлением капиталом, банковским делом.

Целью данного курса является: Помощь будущему профессиональному самоопределению. Сформировать базовый уровень экономической грамотности, экономического мышления: выработка адекватных представлений о сути экономических явлений и их взаимосвязи, умения выносить аргументированные суждения по экономическим вопросам, обретение опыта в анализе конкретных экономических ситуаций. Формирование у учащихся прочных теоретических знаний и практических навыков в области вложений денежных средств в различные ценные бумаги на фондовой бирже, базовых знаний теоретических основ и практических навыков в области организации валютных операций кредитных организаций. В процессе изучения курса учащиеся знакомятся с основными терминами, понятиями, принципами, формами и методами организации валютных операций. Изучение видов ценных бумаг, операций с ними, определение доходности различных видов бумаг, различных практических аспектов деятельности банков на рынке ценных бумаг и содержания выполняемых ими операций с ценными бумагами. В изучение данного курса помогут выработать практические навыки принятия ответственных экономических решений, как в личной, так и в общественной жизни.

Изучение данного курса решает следующие задачи:

- расширение кругозора у учащихся.
- освоение основ знаний о современной экономике;
- развитие интереса к новому предмету,
- обучить методам и принципам инвестиций на фондовой бирже;
- обучить анализировать и прогнозировать движение цен на фондовой бирже;
- формировать практические навыки торговли на фондовой бирже;
- сформировать представление о характере, сущности валютных отношений и валютной системы;
- обучить основам теоретических знаний о функционировании рынка ценных бумаг и видах ценных бумаг;
- подготовить учащихся к практической деятельности, связанной с обращением ценных бумаг.

При реализации курса применяются такие формы обучения: рассказ, объяснение, лекция, беседа, практические занятия, самостоятельная работа.

Программа курса рассчитана на детей от 16-17 лет. Занятия проводятся 2 раза в неделю, количество часов в год – 64 часов. Продолжительность занятия – 45 минут. Данный курс может проводить только учитель истории.

I. УЧЕБНЫЙ ПЛАН

Цель:

- сформировать знания о фондовой и валютной бирже;
- сформировать навыки работы на фондовых и валютных рынках;
- воспитать уважение к собственности, ответственности, экономность;
- сформировать экономическое мышление, экономическую грамотность;
- сформировать навыки анализа и прогноза движения цен на фондовой бирже;

II. СОДЕРЖАНИЕ ПРОГРАММЫ

Введение.

Фондовый и Валютный рынок как экономическая сфера деятельности. Фондовый и Валютный рынок – это сфера экономических отношений, проявляющихся при осуществлении операции по купле-продаже иностранной валютой и ценных бумаг в иностранной валюте, а также операций по инвестированию валютного капитала.

Тема 1. Основы фондовой биржи.

Определение фондовой биржи. Структура управления. Участники биржевой торговли. Допуск к торгам. Сделки с ценными бумагами. Режимы торгов. Этапы прохождения сделки. Биржевая информация. Электронная торговля.

Основные понятия темы: фондовая биржа, регламент торгов, листинг, управление фондовой биржей, участники торгов, режим торгов

Тема 2. Инфраструктура фондовых бирж.

Регулирование фондовых бирж: государственное регулирование (схема государственного регулирования, органы государственного регулирования, ФСФР, нормативные документы); саморегулирование (задачи СРО, НАУФОР, другие СРО), внутренние документы

Эмитенты (акционерные общества, база СКРИН, типы акционеров и их права)

Инвесторы: спекулянты, портфельные, стратеги, хеджеры, арбитражеры, инсайдеры и аутсайдеры

Организация оборота: реестродержатели, депозитарии, клиринг, организаторы торговли.

Доступ к фондовой бирже

Основные понятия темы: регулирование фондовых бирж, эмитенты, спекулянты, хеджеры, стратеги, портфельные инвесторы, оборот на фондовой бирже, доступ к фондовой бирже, информационно-торговые терминалы

Тема 3. Инструменты торговли.

Информационно-торговый терминал QUIK: таблицы: таблица текущих значений, таблица истории значений параметров, таблица сделок, таблица котировок, портфель инвестора, таблица лимитов по бумагам, таблица лимитов по деньгам; новости, графики, биржевые приказы.

Аналитическая система МетаСток: рабочая область, данные, концепция графиков, виды графиков, аналитические линии, индикаторы, инструменты (язык формул, построитель индикаторов пользователя, тестирование торговых систем, создание экспертов, поисковики).

Основные понятия темы: лонги, шорты, инструменты пари, инструменты хеджирования, маржа на спот рынке, маржа на срочном рынке, вариационная маржа

Тема 4. Информационное обеспечение фондовых бирж.

Концепция раскрытия информации. Принцип прозрачности рынка, Участники раскрытия информации: фондовые биржи, профессиональные участники РЦБ, информационные агентства.

Рейтинги информационных агентств. Международная шкала агентства S&P.

Биржевые индексы: общие требования к методике расчета индекса (организация, рассчитывающая индекс, валюта, индексы и средние, способ усреднения, расчет индекса, усредненного по капитализации, репрезентативность, ликвидность, наследственность и изменчивость, корреляция индексов, семейства индексов).

Методика расчета российских индексов: методика расчета индекса ММВБ, методика расчета индекса РТС.

Описание распространенных индексов. Индексы РТС: технический индекс РТС, RUX. Зарубежные индексы: США индекс Доу-Джонса, индекс S&P 500 и S&P 100, индекс Nasdaq. Великобритания FT-SE 30. Глобальные индексы: индекс MSCI.

Основные понятия темы: раскрытие информации, рейтинг аналитических агентств, биржевой индекс, методика расчета биржевого индекса.

Тема 5. Основные модели прогноза цен

Классификация подходов к прогнозированию цен.

Теория случайных событий: постулаты, определение, формы эффективности рынка, проверка слабой, средней и сильной формы ГЭР, эффективность в среднем, или можно ли обыграть рынок.

Теория Доу.

Технический анализ.

Фундаментальный анализ: макроэкономический, отраслевой и корпоративный.
Справедливые цены: виды цен на акции, МСФО, расчет справедливых цен (доходный, сравнительный и затратный методы).

Психология движения цен: жадность и страх, обратные связи, самореализующиеся графики, психология рыночной информации, психология трендовых рынков, психология бокового рынка, психология разворота тренда, рыночная тактика.

Влияние новостей: классификация новостей, влияние американского фондового рынка, корпоративные новости.

Основные понятия темы: теория случайных блужданий, гипотеза эффективности рынка, форма гипотезы эффективности рынка, теория Доу, технический анализ, фундаментальный анализ, обратные связи на фондовом рынке, самореализующиеся графики, психология фондового краха, психология трендового рынка, психология бокового рынка, психология разворота рынка, фондовые новости.

Тема 6. Анализ и прогноз движения цен

Графический анализ: постулаты технического анализа; виды цен и торговые диапазоны. Типы графиков: линейные графики, бары, японские свечи, гистограмма, шкалы. Ценовой тренд: линия тренда, транспортир, линейная регрессия. Поддержка и сопротивление: уровни сопротивления и поддержки, линии сопротивления и поддержки, линия тренда, линия канала, скоростные линии сопротивления.

Графические модели: разворота (тройная и двойная вершина/дно, V-образная вершина и основание ("шип")), фигуры, подтверждающие продолжение тренда: треугольник, "Флаг", "Вымпел", клин, прямоугольник.

Инструментальный анализ и прогноз движения цен: индикаторы и осцилляторы: классификация, индикаторы тренда, индикаторы волатильности, индикаторы скорости (момента), индикаторы циклов, индикаторы силы рынка, индикаторы поддержки и сопротивления. Инструменты Фибоначчи.

Волновая теория Эллиота.

Система трех экранов Элдера.

Основные понятия темы: технический анализ, виды цен, торговые диапазоны, типы графиков, канал, поддержка и сопротивление, модель разворота тренда, модель продолжения тренда, скользящее среднее, параболика, стохастический осциллятор, объем, полосы Боллинджера, волновая теория Эллиота, экраны Элдера

Тема 7. Биржевые торговые стратегии

Определение торговой стратегии, элементы торговой стратегии, требования к торговым стратегиям, оптимальные входы и выходы, требования к разработке торговых стратегий .

Вход в рынок.

Выход из рынка.

Основные понятия темы: торговая стратеги, вход в рынок, выход из рынка, безубыточный стоп-лосс, скользящий стоп-лосс, тэйк-профит.

Тема 8. Механические торговые системы

Торговые системы в МетаСток: язык формул, построитель индикаторов, ранжирование и отбор ценных бумаг, эксперт-советник, тестирование торговых систем, оптимизация торговых систем.

Примеры торговых систем.

Эффективность торговых систем.

Основные понятия темы: язык формул, построитель индикаторов, ранжирование акций, тестер систем, эксперт, эффективность торговой системы, эффективность входа, эффективность выхода.

Тема 9. Управление риском и инвестиционным счетом

Риск и биржевой счет: виды рисков, место торговой стратегии, взаимосвязь риска и размера торгового счета, отсутствие методики управления счетом.

Оценка торговых систем: оценка по прибыли, оценка по просадке счета, оценка соотношения прибыль/ использование кредита, оценка торговых систем на основе соотношения прибыль/ время, процентное соотношение выигрышей системы, оптимальное f , вероятность разорения.

Основные понятия темы: риск VAR, стоп-лосс, просадка счета, оптимальное f .

Тема 10. Валютная биржа «FOREX».

Основные понятия, термины.

Пять основных пар валют.

Основные понятия темы: Позиция. Пункт. Спрэд (spread).

Тема 11. Валютные курсы.

Виды валютных курсов. Кросс-курсы. Спот-курс. Форвард-курсы (курсы валют по срочным сделкам).

Котировки. Косвенные котировки. Прямые котировки.

Основные понятия темы: аутрайт (outright).

Тема 12. Управление капиталом торговая тактика.

Общие замечания по управлению капиталом

Фигуры разворота.

Практические занятия: Отработка теоретических знаний на практике.

III. ПЕРЕЧЕНЬ ЗНАНИЙ И УМЕНИЙ

Учащиеся должны знать:

- основные термины и понятия в области инвестиций в ценные бумаги на фондовой бирже;
- принципы анализа и прогноза движения цен на фондовой бирже;
- принципы расчета доходности различных финансовых инструментов;

Учащиеся должны уметь:

- анализировать и прогнозировать движение цен на фондовой и валютной бирже с помощью программ анализа;
- использовать электронные терминалы для работы на валютной и фондовой биржах;
- выявлять особенности валютных операций банков;
- собирать и анализировать необходимую информацию.

IV. СПИСОК ЛИТЕРАТУРЫ

1. Учебно-методическое пособие: И.К.Ключников, О.А.Молчанова, О.И.Ключников «Фондовые биржи: вводный курс» М., Инфра-М, 2009г.
2. Чарльз Лебо и Дэвид В.Лукас "Компьютерный анализ фьючерсных рынков". Издательский дом "Альпина", 1998.

3. Стив Нисон "Японские свечи: графический анализ финансовых рынков". Москва, "Диаграмма", 1998.
4. А.Эрлих "Технический анализ товарных и финансовых рынков". И-во "Инфра - М" 1996.
5. Т.Демарк "Технический анализ, новая наука". Москва, "Диаграмма", 1997.
6. М.А. Портной, М.Н. Романчук. Валютные рынки и валютные отношения: учебное пособие. М.:МЭСИ, 2006г.
7. Джон Дж. Мэрфи. Технический анализ фьючерсных рынков: теория и практика. – М.: Диаграмма, 2008г.
8. Щеголева Н.Г. Валютные операции: учебник. М.: Маркет ДС, 2004г.
9. Валютное право/Под ред. Алексеевой Д.Г. М.:Норма, 2008г.
10. Ведихин А.В. FOREX от 1-го лица. Валютные рынки для начинающих и профессионалов: 2-е изд.-М.:СмартБук, 2008.

Программные средства:

Информационно-торговый терминал telesetup.