

**Общество с ограниченной ответственностью
«Весперфин»**

УТВЕРЖДЕНО



Генеральный директор
Веспер А.И.
Приказ № 05-08 от 20 мая 2022 г.



**ДОПОЛНИТЕЛЬНАЯ ПРОФЕССИОНАЛЬНАЯ
ПРОГРАММА ПРОФЕССИОНАЛЬНОЙ ПЕРЕПОДГОТОВКИ
«Рынок ценных бумаг»
с присвоением квалификации
«Специалист рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов»
(курс «Продвинутый»)**

г. Санкт-Петербург, 2022

1. ПОЯСНИТЕЛЬНАЯ ЗАПИСКА

Дополнительная профессиональная программа профессиональной переподготовки «Рынок ценных бумаг» разработана на основе следующих нормативных правовых актов:

- Федеральный закон от 29.12.2012 № 273-ФЗ «Об образовании в Российской Федерации»;
 - Федеральный закон от 04.05.2011 № 99-ФЗ «О лицензировании отдельных видов деятельности»;
 - Постановление Правительства РФ от 18.09.2020 № 1490 «О лицензировании образовательной деятельности»;
 - Приказ Минобрнауки России от 1 июля 2013 г. № 499 «Об утверждении Порядка организации и осуществления образовательной деятельности по дополнительным профессиональным программам»;
 - Приказ Минобрнауки России от 23 августа 2017 г. № 816 «Об утверждении порядка применения организациями, осуществляющими образовательную деятельность, электронного обучения, дистанционных образовательных технологий при реализации образовательных программ»;
 - ФГОС ВО по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика», утвержденного приказом Министерства науки и высшего образования РФ от 12 августа 2020 г. № 954 «Об утверждении федерального государственного образовательного стандарта высшего образования - бакалавриат по направлению подготовки 38.03.01 Экономика,
 - Профессиональный стандарт «Специалист по управлению рисками», утвержденный приказом от 30 августа 2018 г. № 564 н Министерства труда и социальной защиты Российской Федерации от 30 августа 2018 г.
 - Профессиональный стандарт «Специалист рынка ценных бумаг», утвержденный приказом Министерства труда и социальной защиты Российской Федерации от 23 марта 2015 г. № 184н.
- других федеральных законов и действующих нормативных правовых актов.

Цель реализации программы является формирование у слушателей компетенций для выполнения нового вида профессиональной деятельности на финансовых рынках.

Задачи программы:

- формирование навыка работы с биржами и торговыми терминалами
- формирование навыка проведения технического анализа
- формирование навыка составления инвестиционных и торговых стратегий

Характеристика профессиональной деятельности:

Область профессиональной деятельности слушателя, прошедшего обучение по программе, включает:

- финансовые организации
- кредитные организации
- консалтинговые (в сфере финансов и кредита) организации.

Программой предусмотрено формирование или совершенствование следующих универсальных компетенций:

УК-1. Способен осуществлять поиск, критический анализ и синтез информации, применять системный подход для решения поставленных задач.

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.

УК-10. Способен принимать обоснованные экономические решения в различных областях жизнедеятельности.

Программой предусмотрено формирование или совершенствование следующих общепрофессиональных компетенций:

- ОПК-1. Способен применять знания (на промежуточном уровне) экономической теории при решении прикладных задач;
- ОПК-2. Способен осуществлять сбор, обработку и статистический анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач;
- ОПК-3. Способен анализировать и содержательно объяснять природу экономических процессов на микро- и макроуровне;
- ОПК-4. Способен предлагать экономически и финансово обоснованные организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности;
- ОПК-5. Способен использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач.

Программой предусмотрено формирование или совершенствование следующих профессиональных компетенций:

- заключение сделок с финансовыми активами на биржевом рынке
- выбор ценных бумаг и иных биржевых инструментов для инвестирования средств
- проведение технического анализа рынка (финансовых инструментов)
- формирование и реализация инвестиционных стратегий
- уменьшение (контроль) рисков при использовании биржевых инструментов.

Настоящая программа основана на изучении технического анализа, который поможет грамотно определять моменты входа в сделку и выхода из нее, для фиксации прибыли либо убытка, а также возможные варианты движения заданного финансового актива.

Основная цель вида профессиональной деятельности слушателя:

Предоставление консультационных услуг, связанных с выпуском и обращением ценных бумаг, совершением сделок с производными финансовыми инструментами.

Преимущества программы: получение слушателями системных знаний в области финансовых рынков, освоение эффективных рыночных инструментов и стратегий инвестирования. Программой предусмотрено формирование у слушателей практических навыков, все практические задания основаны на реальных ситуациях (реальных рыночных ситуациях).

В процессе прохождения программы слушатели изучат финансовые активы, виды инвестирования, возможности и ограничения современного рынка.

Слушатель, освоивший программу, должен знать:

- основные понятия и терминологию в области инвестирования
- основных участников фондового и срочного рынка
- трендовые индикаторы, осцилляторы, статические и динамические уровни
- принципы сочетания таймфреймов
- волновую теорию Эллиотта
- основы кластерного анализа
- алгоритм управления торговой позицией

уметь:

- анализировать ценные бумаги и производные финансовые инструменты для использования в инвестиционном портфеле;
- настраивать и использовать торгово-аналитическую платформу для анализа горизонтальных объемов;
- совершать сделки на фондовом и срочном рынках;
- самостоятельно составлять торговые стратегии, сочетать разные торговые элементы для эффективной торговли;
- управлять торговой позицией от открытия до полного закрытия трейда;
- рассчитывать риски на позицию;
- прогнозировать движение цены;
- анализировать технические индикаторы рынка;
- подбирать индикаторы для создания прибыльной стратегии;
- сочетать таймфреймы и элементы технического анализа для достижения наилучшего результата торговли

владеть:

- навыками создания прибыльных торговых систем
- принципами составления прогноза движения активов
- навыками создания алгоритма торговли
- навыками ситуативной и стратегической торговли.

Категория слушателей:

К освоению дополнительной профессиональной программы допускаются: лица, имеющие среднее профессиональное и (или) высшее образование; лица, получающие среднее профессиональное и (или) высшее образование.

Программа предназначена для слушателей, ориентированных на работу в финансовых организациях: инвестиционных, брокерских и дилерских компаниях, фондовых отделах коммерческих банков, а также тех, кто осуществляет консультационную деятельность по финансовым вопросам и инвестициям.

2. СОДЕРЖАНИЕ ПРОГРАММЫ

Сроки реализации программы: программа рассчитана на 260 часов.

Форма обучения: заочная, очно – заочная формы с применением электронного обучения и дистанционных образовательных технологий.

Выдаваемый документ: диплом о профессиональной переподготовке установленного образца.

2.1 Учебный план

№ п/п	Название модулей	Всего	Теория	Сам. работа	Форма контроля
1	Модуль 1. Динамические уровни. Теория и практика Ленты Боллинджера Price Channel Скоростные линии Импульс Боллинджера Стратегия «полки» на динамических уровнях	13	5	8	зачет

2	Модуль 2. Графические уровни всех типов. Теория и практика Уровни по балансу спроса и предложения Уровни по экстремумам Уровни Фибоначчи	10	5	5	зачет
3	Модуль 3. Теория Ганна. Свинги Ганна Определение свингов Ганна Правила построения свингов	5	2	3	зачет
4	Модуль 4. Уровни Ганна Теория и практика построения Торговля уровней Ганна	12	4	8	зачет
5	Модуль 5. Торговые элементы: объем, глубина рынка, On Balance Volume и открытый интерес Определения Особенности применения Комбинация с уровнями всех типов Механика баланса и дисбаланса Торговое и аналитическое применение в стратегической и ситуативной торговле	14	8	6	зачет
6	Модуль 6. Свечные паттерны разворота и продолжения тренда Свечные паттерны Особенности торговли Применение на практике	14	6	8	зачет
7	Модуль 7. Кластерный анализ Основные определения Типы графиков Фильтры	13	6	7	зачет
8	Модуль 8. Кластерный анализ Анализ тренда Анализ разворота	10	5	5	зачет
9	Модуль 9. Кластерный анализ Poc, vah, val Ложный пробой Дельта, кумулятивная дельта	12	8	4	зачет
10	Модуль 10. Анализ фьючерсов Ситуативная торговля Отличие ситуативной торговли от стратегической Принципы ситуативной торговли Практика на терминале	15	8	7	зачет
11	Модуль 11. Торговая неделя Отработка пройденного материала на терминале Применение кластеров и всех пройденных индикаторов в ситуативной торговле	12	-	12	зачет

12	Модуль 12. Волновой принцип Эллиотта Основные термины и положения Коррекция Виды коррекции Принципы построения	12	5	7	зачет
13	Модуль 13. Волновой принцип Эллиотта Определение точек входа по волнам Эллиотта Торговля волн Эллиотта Коллективное задание по Эллиотту	13	5	8	зачет
14	Модуль 14. Контрольная работа по волнам Эллиотта Практика построения волн на акциях Написание прогнозов Практика на торговом терминале	17	7	10	зачет
15	Модуль 15. Волны Вульфа. Теория и практика Принципы построения волн Вульфа Бычья и медвежья модель Pin-бар и sweet zone Практика на терминале	16	7	9	зачет
16	Модуль 16. Моментум двух и трех таймфреймов Принципы работы на нескольких таймфрейма Алгоритм построения стратегии Практическое задание	15	7	8	зачет
17	Модуль 17. Торговый алгоритм Написание торгового алгоритма Составление системы входов, доборов, частичной и полной фиксации позиции Защита алгоритма	17	7	10	зачет
18	Модуль 18. Торговая неделя Отработка пройденного материала на терминале Закрепление всех полученных знаний на практике	16	-	16	зачет
19	Модуль 19. 8 рабочих стратегий Индикаторная Кластерная Long Кластерная Short и другие	12	12	-	-
20	Модуль 20. Серфинг-инвестирование. Принципы и алгоритм Принцип отбора акций для торговли Комбинации индикаторов Практика прогнозирования	8	8	-	-
21	Модуль 21. Завершение (подведение итогов) Прямой эфир Обсуждение итогов курса	4	4	-	-
	Итого	260			

3	Теория Ганна. Свинги Ганна	<p>Определение свингов Ганна Правила построения свингов</p> <p>Домашнее задание: 1. На отрезке любого графика отметить и прислать 4 типа баров: по одному примеру каждого. 2. Начертить свинги Ганна: -1барные -2барные -3барные.</p>
4	Уровни Ганна	<p>Теория и практика построения Торговля уровнями Ганна</p> <p>Домашнее задание: Начертить на любом графике на любом промежутке 3б свинги, провести уровни и отметить по 1 сделке: - по перебитию предыдущего экстремума - по отбойной/пробойной свече Прислать график/графики этих 2 сделок.</p>
5	Торговые элементы: объем, глубина рынка, On Balance Volume и открытый интерес	<p>Определения Особенности применения Комбинация с уровнями всех типов Механика баланса и дисбаланса Торговое и аналитическое применение в стратегической и ситуативной торговле</p> <p>Домашнее задание: 1. Рассмотреть три задачи. К каждой из них есть график, вопрос и варианты ответа. 2. Прислать в дз ответ к каждой из задач с обоснованием выбранного решения. Графики не высылать.</p> <p>Задачи: 1. Проанализировать показания глубины рынка и выбрать ответ: 1) по ГР видим плиту для шорта 2) по ГР видим плиту для лонга 3) нет плиты на графике</p> <p>2. Выбрать точку (точки) входа по отбою от ПЧ, подтверждающиеся объемами: 1) вход в точке 1 2) вход в точке 2 3) вход в точке 3 4) вход в точке 4</p> <p>3. Если рассматривать движение цены и открытый интерес, будете ли вы присматривать входы на шорт в правой части графика? 1) да, самое время для шорта 2) нет, предпосылок для шорта нет.</p>

6	Свечные паттерны разворота и продолжения тренда	<p>Свечные паттерны Особенности торговли Применение на практике</p> <p>Домашнее задание: Найти 5 примеров свечных паттернов (на выбор), прислать в 5 графиков с ними. Каждый паттерн обязательно подписать.</p>
7	Кластерный анализ	<p>Основные определения Типы графиков Фильтры</p> <p>Домашнее задание: Установить программу кластерного анализа. Изучить материал урока.</p>
8	Кластерный анализ	<p>Анализ тренда Анализ разворота</p> <p>Домашнее задание: 1. Отторговать на демо или реальном счете сделки с использованием кластеров. Количество не ограничено, но в дз нужно будет прислать 3! На вход можно использовать пробой/отбой от уровня, пробой боковика, стратегию хаоса. 2. Прислать в дз 3 сделки. График с пояснением: по каким сигналам зашли, охарактеризовать бар входа по кластерам: какой он, какая у него дельта. Внимание. Если вы отторговали пробой боковика - покажите и боковик, и вход по кластерам. Если это уровень - покажите его + бар по кластерам. Если это аллигатор - покажите и график стратегии, и ангуляцию, и бар по кластерам. В дз должно быть полностью видно все, что использовано в торговле.</p>
9	Кластерный анализ	<p>Рос, vah, val Ложный пробой Дельта, кумулятивная дельта</p> <p>Домашнее задание: 1. На графике отметить все толкающие и тормозные бары (маркировкой: sd1/su1 и т.д., без учёта дельты). 2. Пояснить, где могли быть: ВХОД, ВЫХОД (отметьте на одном из графиков). 3. Примеры ложных и истинных пробоев разобрать в чате.</p>
10	Анализ фьючерсов	<p>Ситуативная торговля Отличие ситуативной торговли от стратегической Принципы ситуативной торговли Практика на терминале</p>

		<p>Домашнее задание:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Провести 3 ситуативных сделки на вашем торгуемом ТФ. Инструмент любой. Демо или реальный - на ваш выбор. 2. Занести их в дневник. 3. В графе комментариев пояснить логику сделки (почему там зашли, какие сигналы, почему там вышли). 4. К дз приложить скрины (не фото) графиков с отметками сделки (вход, стоп, тейк).
11	Торговая неделя	<p>Отработка пройденного материала на терминале. Применение кластеров и всех пройденных индикаторов в ситуативной торговле.</p>
12	Волновой принцип Эллиотта	<p>Основные термины и положения Коррекция Виды коррекции Принципы построения</p> <p>Домашнее задание: Расчертить на Д и на Week готовые графики четырех заданных компаний (названия компаний могут меняться в зависимости от рыночной ситуации). На каждую акцию и каждый ТФ строго 1 начерченный вариант. ИТОГО 8 графиков в дз.</p>
13	Волновой принцип Эллиотта	<p>Определение точек входа по волнам Эллиотта Торговля волн Эллиотта Коллективное задание по Эллиотту</p> <p>Домашнее задание: Домашнее задание будет выполняться в чате. Каждый день кураторы выкладывают в чат несколько вариантов черчения волн в виде тестирования. Вы голосуете, обсуждаете, задаете вопросы. В конце дня куратор поясняет, какой вариант верный и почему.</p>
14	Контрольная работа по волнам Эллиотта	<p>Практика построения волн на акциях Написание прогнозов Практика на торговом терминале</p> <p>Домашнее задание:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Рассмотреть 3 любые акции на ТФ Д или Week на истории! Начертить волны Эллиота и выбрать такие, в которых был вход в волну 3 или 5. 2. Сделать анализ Акции на момент входа: Какой тренд Как ведут себя осцилляторы Какие сигналы по трендовым индикаторам Какая волна Эллиотта (обязательно начертить и показать). 3. Сформулировать четкий прогноз: Условия для входа в лонг: ...

		<p>Цели для лонга: ... Отмена лонга если: ... (все в точности как в примере в теории). 4. Сдать в дз анализ, графики с волнами и анализ входа всех 3х акций. Внимание, волны чертить КРУПНО. Не нужно мельчить.</p>
15	Волны Вульфа. Теория и практика	<p>Принципы построения волн Вульфа Бычья и медвежья модель Pin-бар и sweet zone Практика на терминале</p> <p>Домашнее задание: 1. Найти и прислать графики 4 вульфов на ТФ м5, м15, м60 и Д. 2. Отторговать Вульфа (1 сделка) - можно прислать либо в дз, либо в чат.</p>
16	Моментум двух и трех таймфреймов	<p>Принципы работы на нескольких таймфрейма Алгоритм построения стратегии Практическое задание</p> <p>Домашнее задание: 1. Пересмотреть свою стратегию с учётом Моментума двух ТФ. Стратегию раскрывать не надо! Просто отписаться в дз о результатах и впечатлениях, если нужна помощь советом – пишите. 2. Взять акцию Сбербанк АО (не префы) и определить: какие индикаторы ведущие на недельном графике, какие h4. ИТОГО в дз присылаем: - свое впечатление от применения стратегии Моменту двух ТФ к своей личной стратегии; - описание ведущих индикаторов для акции Сбербанк на Week и H4: какие индикаторы Вы взяли для каждого ТФ и почему. 2 графика с ведущими индикаторами приложить.</p>
17	Торговый алгоритм	<p>Написание торгового алгоритма Составление системы входов, доборов, частичной и полной фиксации позиции Защита алгоритма</p> <p>Контрольная работа: Выпускная работа. Пишем и сдаем торговый алгоритм. Прописать: Вход: условия Стоп: Добор: условия Частич. фикс: условия Выход: условия. Не более 1 страницы описания алгоритма (кратко, ёмко),</p>

		расчеты присылать не нужно. Дополнить алгоритм примером 1 сделки (не более). На скрине графика отметки: вход, стоп, добор, част. фикс, выход.
18	Торговая неделя	Отработка пройденного материала на терминале Закрепление всех полученных знаний на практике.
19	8 рабочих стратегий	Индикаторная Кластерная Long Кластерная Short и другие.
20	Серфинг-инвестирование. Принципы и алгоритм	Принцип отбора акций для торговли Комбинации индикаторов Практика прогнозирования.
21	Завершение курса	Подведение итогов.

3. ФОРМЫ АТТЕСТАЦИИ

Контроль и оценка полученных знаний и навыков предполагает промежуточный и итоговый контроль.

3.1. Промежуточный контроль и оценочные средства

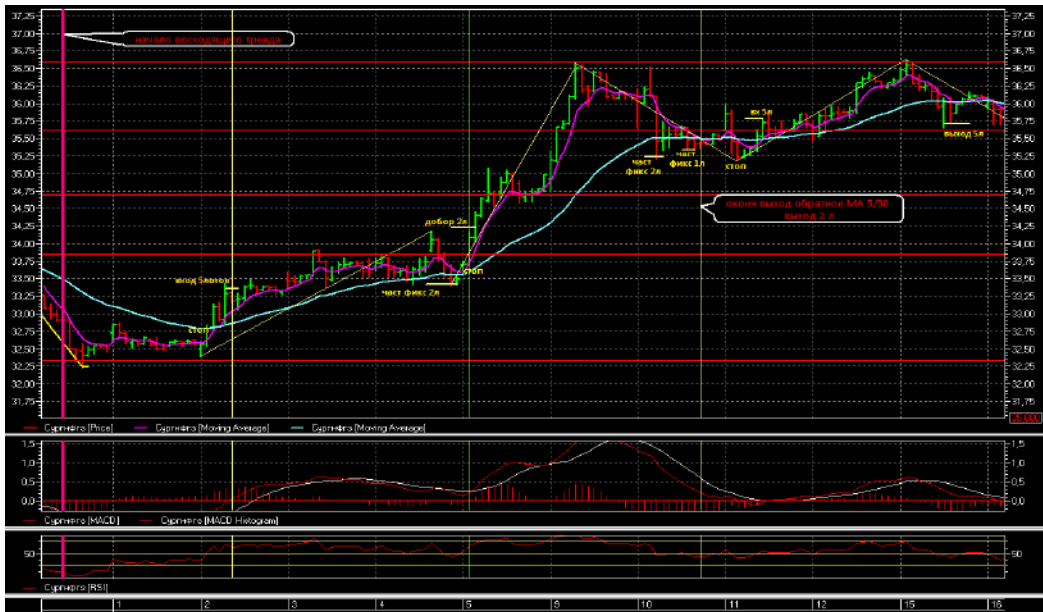
Промежуточный контроль: проверка самостоятельной работы обучающихся преподавателем, по системе зачтено/не зачтено.

Отметка «зачтено» выставляется слушателю, усвоившему материал, правильно выполняет домашнее задание, дает исчерпывающие, правильно применяет теоретические положения при решении практических вопросов.

Отметка «не зачтено» выставляется слушателю, который допускает в ответе неточности, недостаточно правильно излагает формулировки, с затруднениями выполняет практические задания.

3.2. Итоговый контроль и оценочные средства

Итоговый контроль: составление и защита алгоритма по примеру:



Алгоритм Сургутнефтегаз М60

Из расчета наличие финансов на 7 лотов

Входить только в лонги.

Фильтр по локальному тренду: если локальный тренд за шорт – входить.

Ранний вход (при наличии): 1 лот

При наличии паттерна разворота, отбивающегося от уровня либо при индюках МАКДП+РСИ50 при хорошем объеме, по кластерам если это бар медвежий тормозной с положительной дельтой (SD1/SD2) или бычий толчковый (DU1/DU2/DU3) с положительной дельтой.

Основной вход - 4 лот (при отсутствии раннего входа – 5лот):

- пересечение МА5/30+МАКД О (не вхожу, если: РСИ в КЗ; на 4 свече не стала сделкой).
- стоп на экстремуме.

Доборы по 1 лоту на каждый добор (если перед добором случился фикс – добираю на первом доборе до первоначальной позиции):

- закрытие над уровнем Ганна в лонг+МАКДП (не вхожу, если: РСИ в КЗ; на 4 свече не стала сделкой).
- отбой от уровня Ганна паттерном разворота на хорошем объеме и по кластерам: если это бар медвежий тормозной с положительной дельтой (SD1/SD2) или бычий толчковый (DU1/DU2/DU3) с положительной дельтой.
- СТОПЫ по экстремуму.

Фиксы: (первый фикс всегда 2 лота и по остальным фиксам по 1 лоту на каждый; последний фикс закрываю всю позицию):

- закрытие над/под МА30,
- пересечение в шорт МА5 уровня Ганна,
- закрытие всей позиции – обратное пересечение МА 5/30.

4. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Рекомендуемая литература

1. Грэм Б. Разумный инвестор Полное руководство по стоимостному инвестированию / Б. Грэм - М.: Альпина Паблишер, 2018. - 568 с.
2. Мёрфи Дж. Технический анализ финансовых рынков / Дж. Мёрфи - М.: Вильямс, 2017. - 496 с.
3. Швагер Д. Технический анализ / Д. Швагер - М.: Альпина Паблишер, 2022. - 808 с.
4. Мёрфи Дж. Визуальный инвестор / Дж. Мёрфи - М.: Вильямс, 2021. - 326 с.
5. Найман Эрик Л. Малая энциклопедия трейдера / Э. Найман - М.: Альпина Паблишер, 2020. - 458 с.
6. Чанг Ха-Джун Как устроена экономика / Ха-Джун Чанг - М.: МИФ, 2022. - 304 с.
7. Джастин Г-В, Вильямс Б. Торговый хаос / Б. Вильямс, Г-В. Джастин - М.: Альпина Паблишер, 2021. - 310 с.
8. Сваннелл Р. Прогноз рынка по новой рафинированной системе распознавания паттернов по волновому принципу Эллиота 2007г.
9. Дуглас М. Зональный трейдинг / М.Дуглас - М.: И-Трейд, 2013. - 240 с.
10. Лин К., Шлоссберг Б. Трейдеры -миллионеры / К. Лин, Б. Шлоссберг - М.: Интеллектуальная литература, 2021. - 258 с.
11. Вильямс Л. Долгосрочные секреты краткосрочной торговли / Л.Вильямс - М.: Дивиденд, 2021. - 396 с.

Информационные ресурсы

Справочно-правовая информационная система Консультант Плюс <http://www.consultant.ru/>

1. Сервис для фундаментального анализа публичных компаний - <https://blackterminal.com/>
2. Сервис для аналитики инвестиционных портфелей - <https://intelinvest.ru/>
3. Сервис для анализа долговых ценных бумаг - <https://smart-lab.ru/q/bonds/>
4. Центральный банк Российской Федерации - www.cbr.ru
5. Сервис для анализа дивидендных выплат - <https://investmint.ru/>
6. Сервис для анализа биржевых паевых инвестиционных фондов - <https://investfunds.ru/etf/>
7. Сервис для анализа движений котировок ценных бумаг - <https://www.tradingview.com/>
8. Котировки и финансовые новости <https://ru.investing.com/>
9. Московская биржа <https://www.moex.com/>
10. СПБ биржа <https://spbexchange.ru/>

Электронно-информационное обеспечение реализации программы

Реализация содержания программы осуществляется с помощью средств дистанционной связи (Интернет) в режиме видеоконференций (вебинаров), видеозаписей, аудиовизуальных произведений, либо в виде материалов, предоставленных в электронном виде.

Материально-техническое обеспечение

Для организации обучения слушателей на стороне преподавателя используется рабочее место, ориентированное на работу с дистанционными технологиями:

Персональный компьютер или ноутбук с встроенным камерой, микрофоном и наушниками, MS Windows; Офисный пакет Office; Web-браузер; мессенджером Telegram.

Рабочее место обучающегося должно быть оборудовано персональным компьютером с выходом в Интернет и компьютерной периферией: микрофоном, аудиокolonками и (или) наушниками, мессенджером Telegram.