

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Комарова Светлана Юриевна  
Должность: Проректор по образовательной деятельности  
Дата подписания: 01.10.2024 06:42:22  
Уникальный программный ключ:  
43ba42f5deae4116bbfcb9ac98e39108031227e81add207cbee4149f2098d7a

**Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Омский государственный аграрный университет имени П.А.Столыпина»  
Экономический факультет**

ОПОП по направлению подготовки 38.03.01 Экономика

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ  
по дисциплине**

**Б1.В.14 Технический анализ финансовых рынков**

Направленность (профиль) «Прикладная экономика и финансы»

|                                                     |                                                           |
|-----------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|
| Обеспечивающая преподавание дисциплины<br>кафедра - | экономики, бухгалтерского учета и финансового<br>контроля |
| Ведущий преподаватель дисциплины,<br>к.э.н., доцент | Н.А. Калайтан                                             |

## **ВВЕДЕНИЕ**

1. Фонд оценочных средств по дисциплине является обязательным обособленным приложением к Рабочей программе учебной дисциплины.

2. Фонд оценочных средств является составной частью нормативно-методического обеспечения системы оценки качества освоения обучающимися указанной дисциплины.

3. При помощи ФОС осуществляется контроль и управление процессом формирования обучающимися компетенций, из числа предусмотренных ФГОС ВО в качестве результатов освоения учебной дисциплины.

4. Фонд оценочных средств по дисциплине включает в себя: оценочные средства, применяемые для входного контроля; оценочные средства, применяемые в рамках индивидуализации выполнения, контроля фиксированных видов ВАРС; оценочные средства, применяемые для текущего контроля; оценочные средства, применяемые для рубежного контроля и оценочные средства, применяемые при промежуточной аттестации по итогам изучения дисциплины.

5. Разработчиками фонда оценочных средств по дисциплине являются преподаватели кафедры экономики, бухгалтерского учета и финансового контроля, обеспечивающей изучение обучающимися дисциплины в университете. Содержательной основой для разработки ФОС послужила Рабочая программа учебной дисциплины.

**ЧАСТЬ 1. ОЖИДАЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ИЗУЧЕНИЯ**  
**учебной дисциплины, персональный уровень достижения которых проверяется**  
**с использованием представленных в п. 3 оценочных средств**

| Компетенции,<br>в формировании которых<br>задействована дисциплина |                                                                                                                                         | Код и наименование<br>индикатора достижений<br>компетенции                                                                                                                               | Компоненты компетенций,<br>формируемые в рамках данной дисциплины<br>(как ожидаемый результат ее освоения)                                                                                                           |                                                                                                                                                                                                                                         |                                                                                                                                                                                                                  |
|--------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| код                                                                | наименование                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                          | знать и понимать                                                                                                                                                                                                     | уметь делать<br>(действовать)                                                                                                                                                                                                           | владеть навыками<br>(иметь навыки)                                                                                                                                                                               |
| Профессиональные компетенции                                       |                                                                                                                                         |                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                         |                                                                                                                                                                                                                  |
| ПК-2                                                               | Способность осуществлять мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков | ИД-1ПК-2 Проведение исследования финансового рынка и изучение предложений финансовых услуг (в том числе действующих правил и условий, тарифной политики и действующих форм документации) | Знает экономические законы, действующие на финансовых рынках; законы формирования ценовых котировок на биржах. Методы проведения исследований на финансовых рынках. Методы анализа конъюнктуры на финансовых рынках. | Умеет использовать закономерности экономического развития применительно к анализу финансовых рынков при проведении исследований. Умеет применять методы сбора и анализа данных о финансовых рынках для проведения технического анализа. | Навыки использования знания об экономических законах на финансовых рынках для проведения исследований. Навыки применения методов сбора и анализа данных о финансовых рынках для проведения технического анализа. |
|                                                                    |                                                                                                                                         | ИД-2ПК-2 Организация сбора, обработки и анализа информации, в том числе с применением социологических, маркетинговых исследований                                                        | Знает методы, способы и инструменты технического анализа финансовых рынков                                                                                                                                           | Умеет применять методы, способы и инструменты технического анализа финансовых рынков (графические, динамические и др.)                                                                                                                  | Навыки применения методов, способов и инструментов технического анализа финансовых рынков (графические, динамические и др.)                                                                                      |
|                                                                    |                                                                                                                                         | ИД-3ПК-2 Мониторинг информационных источников финансовой информации                                                                                                                      | Знает о применимости данных, необходимых для проведения технического анализ а на финансовых рынках. Знает современные информационные источники о финансовых рынках.                                                  | Умеет применять экономические знания для поиска данных, необходимых для проведения технического анализа на финансовых рынках                                                                                                            | Навыки применения данных, необходимых для проведения технического анализа на финансовых рынках                                                                                                                   |

## Общие критерии оценки и реестр применяемых оценочных средств

**дисциплины в рамках педагогического контроля**

\* данным знаком помечены индивидуализируемые виды учебной работы

## 2.2 Общие критерии оценки хода и результатов изучения учебной дисциплины

|                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                         |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>1. Формальный критерий получения обучающимися положительной оценки по итогам изучения дисциплины:</b>                      |                                                                                                                                                                                                                                         |
| 1.1 Предусмотренная программа изучения дисциплины обучающимся выполнена полностью до начала процесса промежуточной аттестации | 1.2 По каждой из предусмотренных программой видов работ по дисциплине обучающийся успешно отчитался перед преподавателем, демонстрируя при этом должный (не ниже минимально приемлемого) уровень сформированности элементов компетенций |
| <b>2. Группы неформальных критериев качественной оценки работы обучающегося в рамках изучения дисциплины:</b>                 |                                                                                                                                                                                                                                         |
| <b>2.1</b> Критерии оценки качества хода процесса изучения обучающимся программы дисциплины (текущей успеваемости)            | <b>2.2.</b> Критерии оценки качества выполнения конкретных видов ВАРС                                                                                                                                                                   |
| <b>2.3</b> Критерии оценки качественного уровня итоговых результатов изучения дисциплины                                      | <b>2.4.</b> Критерии аттестационной оценки качественного уровня результатов изучения дисциплины                                                                                                                                         |

**2.3 РЕЕСТР**  
**элементов фонда оценочных средств по учебной дисциплине**

| Группа<br>оценочных средств                                                                | Оценочное средство или его элемент                                              |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|
|                                                                                            | Наименование                                                                    |
| <b>1. Средства для входного контроля</b>                                                   | Контрольные вопросы для проведения входного контроля                            |
|                                                                                            | Критерии оценки ответов на контрольные вопросы входного контроля                |
| <b>2. Средства для индивидуализации выполнения, контроля фиксированных видов ВАРС</b>      | Перечень тем электронной презентации. Этапы работы над электронной презентацией |
|                                                                                            | Критерии оценки электронной презентации                                         |
| <b>3. Средства для текущего контроля</b>                                                   | Вопросы для самостоятельного изучения темы                                      |
|                                                                                            | Общий алгоритм самостоятельного изучения темы                                   |
|                                                                                            | Критерии оценки самостоятельного изучения темы                                  |
|                                                                                            | Вопросы для самоподготовки по темам семинарских занятий                         |
|                                                                                            | Критерии оценки самоподготовки по темам семинарских занятий                     |
|                                                                                            | Вопросы для самоподготовки по темам практических занятий                        |
|                                                                                            | Задачи для практических занятий                                                 |
|                                                                                            | Критерии оценки самоподготовки по темам практических занятий                    |
|                                                                                            | Тестовые вопросы для проведения контроля по итогам изучения 1-2 разделов        |
|                                                                                            | Критерии оценки ответов на тестовые вопросы                                     |
| <b>4. Средства для промежуточной аттестации магистрантов по итогам изучения дисциплины</b> | Вопросы для подготовки к зачету                                                 |
|                                                                                            | Плановая процедура проведения зачета                                            |
|                                                                                            | Критерии оценки ответов на вопросы итогового контроля                           |

## 2.4 Описание показателей, критериев и шкал оценивания и этапов формирования компетенций в рамках дисциплины

| Индекс и<br>назва<br>ние<br>компе<br>тенции | Код индикатора<br>достиже<br>ний<br>компетенции | Индикаторы<br>компетен<br>ции               | Показатель оценивания<br>– знания, умения,<br>навыки (владения)                                                                                                                                                                        | Уровни сформированности компетенций                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |         |         | Формы и<br>средства<br>контроля<br>формирования<br>компетенций |
|---------------------------------------------|-------------------------------------------------|---------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------|---------|----------------------------------------------------------------|
|                                             |                                                 |                                             |                                                                                                                                                                                                                                        | компетенция не<br>сформирована                                                                                                                                                                                                            | минимальный                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | средний | высокий |                                                                |
|                                             |                                                 |                                             |                                                                                                                                                                                                                                        | Оценки сформированности компетенций                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |         |         |                                                                |
|                                             |                                                 |                                             |                                                                                                                                                                                                                                        | 2                                                                                                                                                                                                                                         | 3                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 4       | 5       |                                                                |
|                                             |                                                 |                                             |                                                                                                                                                                                                                                        | Не зачтено                                                                                                                                                                                                                                | Зачтено                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |         |         |                                                                |
|                                             |                                                 |                                             |                                                                                                                                                                                                                                        | Характеристика сформированности компетенции                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |         |         |                                                                |
|                                             |                                                 |                                             |                                                                                                                                                                                                                                        | Компетенция в полной мере не<br>сформирована. Имеющихся<br>знаний, умений и навыков<br>недостаточно для решения<br>практических<br>(профессиональных) задач                                                                               | 1 Сформированность компетенции соответствует минимальным требованиям. Имеющихся знаний, умений, навыков в целом достаточно для решения практических (профессиональных) задач<br>2 Сформированность компетенции в целом соответствует требованиям. Имеющихся знаний, умений, навыков и мотивации в целом достаточно для решения стандартных практических (профессиональных) задач<br>3 Сформированность компетенции полностью соответствует требованиям. Имеющихся знаний, умений, навыков и мотивации в полной мере достаточно для решения сложных практических (профессиональных) задач                                                                                                                                                                                                    |         |         |                                                                |
| Критерии оценивания                         |                                                 |                                             |                                                                                                                                                                                                                                        |                                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |         |         |                                                                |
| ПК-2                                        | ИД-1 <sub>ПК-2</sub>                            | Полнота <b>знаний</b>                       | Знать экономические законы, действующие на финансовых рынках; законы формирования ценовых котировок на биржах. Методы проведения исследований на финансовых рынках. Методы анализа конъюнктуры на финансовых рынках.                   | Не знает экономические законы, действующие на финансовых рынках; законы формирования ценовых котировок на биржах. Методы проведения исследований на финансовых рынках. Методы анализа конъюнктуры на финансовых рынках.                   | 1 Поверхностно знает экономические законы, действующие на финансовых рынках; законы формирования ценовых котировок на биржах. Имеет общее представление о методах проведения исследований на финансовых рынках; методах анализа конъюнктуры на финансовых рынках.<br>2 Свободно ориентируется в экономических законах, действующих на финансовых рынках; законах формирования ценовых котировок на биржах. Знаком с основными методами проведения исследований на финансовых рынках; методами анализа конъюнктуры на финансовых рынках.<br>3 В совершенстве знает и понимает экономические законы, действующие на финансовых рынках; законы формирования ценовых котировок на биржах. Методы проведения исследований на финансовых рынках. Методы анализа конъюнктуры на финансовых рынках. |         |         | Тестирование;<br>опрос; реферат;<br>доклад;<br>презентация     |
|                                             |                                                 | Наличие <b>умений</b>                       | Уметь использовать закономерности экономического развития применительно к анализу финансовых рынков при проведении исследований. Умеет применять методы сбора и анализа данных о финансовых рынках для проведения технического анализа | Не умеет использовать закономерности экономического развития применительно к анализу финансовых рынков при проведении исследований. Умеет применять методы сбора и анализа данных о финансовых рынках для проведения технического анализа | 1 Умеет использовать некоторые закономерности экономического развития применительно к анализу финансовых рынков при проведении исследований. Умеет применять некоторые методы сбора и анализа данных о финансовых рынках для проведения технического анализа<br>2 Умеет использовать основные закономерности экономического развития применительно к анализу финансовых рынков при проведении исследований. Умеет применять основные методы сбора и анализа данных о финансовых рынках для проведения технического анализа<br>3 В совершенстве умеет использовать закономерности экономического развития применительно к анализу финансовых рынков при проведении исследований. Умеет применять методы сбора и анализа данных о финансовых рынках для проведения технического анализа       |         |         |                                                                |
|                                             |                                                 | Наличие <b>навыков</b><br>(владение опытом) | Навыки использования знания об экономических законах на финансовых рынках для проведения исследований. Навыки применения методов сбора и анализа данных о финансовых рынках для проведения технического анализа.                       | Не имеет навыков использования знания об экономических законах на финансовых рынках для проведения исследований. Навыки применения методов сбора и анализа данных о финансовых рынках для проведения технического анализа.                | 1 Имеет некоторые навыки использования знания об экономических законах на финансовых рынках для проведения исследований. Навыки применения методов сбора и анализа данных о финансовых рынках для проведения технического анализа.<br>2 Имеет навыки использования знания об экономических законах на финансовых рынках для проведения исследований. Навыки применения методов сбора и анализа данных о финансовых рынках для проведения технического анализа.<br>3 Имеет уверенные навыки использования знания об экономических законах на финансовых рынках для проведения исследований. Навыки применения методов сбора и анализа данных о финансовых рынках для проведения технического анализа.                                                                                        |         |         |                                                                |
|                                             | ИД-2 <sub>ПК-2</sub>                            | Полнота <b>знаний</b>                       | Знает методы, способы и инструменты технического анализа                                                                                                                                                                               | Не знает методы, способы и инструменты технического анализа финансовых рынков                                                                                                                                                             | 1 Знает отдельные методы, способы и инструменты технического анализа финансовых рынков<br>2 Знает основные методы, способы и инструменты технического анализа финансовых рынков                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |         |         | Тестирование;<br>опрос; реферат;<br>доклад;                    |





### **ЧАСТЬ 3 Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков, характеризующих этапы формирования компетенций**

#### **Часть 3.1. Типовые контрольные задания, необходимые для оценки знаний, умений, навыков**

##### **Часть 3.1.1. Средства для индивидуализации выполнения, контроля фиксированных видов ВАРС**

###### **Перечень электронных презентаций обучающихся**

###### **Место электронной презентации в структуре учебной дисциплины**

Разделы учебной дисциплины, усвоение которых студентами сопровождается или завершается подготовкой электронной презентации:

| № | Наименование раздела                     |
|---|------------------------------------------|
| 2 | Методы и инструменты финансового анализа |

###### **Перечень примерных тем электронной презентации**

1. Способы формализации для программ технического анализа линий трендов
2. Способы формализации для программ технического анализа графических формаций
3. Создание, тестирование и оптимизация торговых стратегий, основанных на графических методах
4. Создание, тестирование и оптимизация торговых стратегий, основанных на трендовых индикаторах
5. Создание, тестирование и оптимизация торговых стратегий, основанных на контртрендовых индикаторах
6. Разработка и тестирование собственного индикатора входа в позицию
7. Разработка новых инструментов выхода из позиции
8. Тестирование частот появления моделей японских свечей на российском фондовом рынке и оценка их прогнозной точности
9. Тестирование входов и выходов торговых систем, основанных на японских свечах
10. Тестирование авторских методик
11. Изучение роста на основе прошлых доходов и прогноз будущего роста
12. Определение ставки дисконтирования для расчетов стоимости компании
13. Финансовый прогноз деятельности компании и оценка будущих денежных потоков
14. Оценка многопрофильных компаний
15. Оценка молодых или начинающих фирм
16. Оценка фирм с отрицательной прибылью
17. Оценка циклических фирм
18. Оценка компаний на развивающихся рынках
19. Сравнительная оценка компаний
20. Влияние макроэкономических данных на курс валютных пар
21. Влияние природных, макроэкономических и техногенных факторов на динамику товарных фьючерсов

###### **Этапы работы над электронной презентацией**

Обучающийся выбирает тему презентации самостоятельно. После выбора темы обучающийся приступает к поиску литературы, опубликованной по данной тематике. Правильный, корректный подбор литературы по необходимой тематике – это первый и важнейший этап написания реферата. Подобранный материал изучается в следующем порядке:

- знакомство с литературой, просмотр и выборочное чтение с целью получения общего представления о проблеме и структуре будущей работе;
- исследование необходимых источников, сплошное чтение отдельных работ, их изучение, конспектирование необходимого материала (при конспектировании в обязательном порядке указывается автор, название работы, место издания, издательство, год издания, страницы, последние изменения (если нормативный документ));
- обращение к литературе для дополнений и уточнений на этапе написания реферата.

Использованная литература может быть различного характера: нормативно-правовые документы, монографии, учебники, диссертации, авторефераты, статьи из журналов, газет, ресурсы сети Интернет и др. Могут использоваться как отечественные, так и иностранные источники.

Желательно, чтобы большинство литературных источников было опубликовано не позднее последних 5 лет. Это позволяет изучить современное состояние проблемы

### Критерии оценки презентации

При аттестации студентов по итогам их работы над презентацией руководителем используются следующие критерии оценки.

1. Критерии оценки качества процесса подготовки презентации:

- способность работать самостоятельно;
- способность творчески и инициативно решать задачи;
- способность рационально планировать этапы и время выполнения презентации, диагностировать и анализировать причины появления проблем при выполнении презентации, находить оптимальные способы их решения;

– дисциплинированность, соблюдение плана, графика подготовки презентации;

– способность вести дискуссию, выстраивать аргументацию с использованием результатов исследований, демонстрация широты кругозора.

2. Критерии оценки содержания презентации:

- степень раскрытия темы;
- самостоятельность и качество анализа теоретических положений;
- глубина проработки, обоснованность методологической и методической программы исследования;
- проработка литературы при выполнении презентации.

3. Критерии оценки оформления презентации:

- логика и стиль изложения;
- структура и содержание;
- объем и качество выполнения иллюстративного материала;
- качество ссылок;
- качество списка литературы;
- общий уровень грамотности изложения.

4. Критерии оценки участия студента в контрольно-оценочном мероприятии по итогам работы над презентацией:

- качество демонстрационного материала (электронной презентации);
- способность и умение публичного выступления;
- уровень ответов на вопросы.

### ШКАЛА И КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ

- **«зачтено»** выставляется, если презентация полностью раскрывает тему, имеет чёткую структуру и логику изложения, точка зрения студента обоснована, присутствуют ссылки на источники литературы, приведены практические примеры, рассматриваются мнения известных учёных в данной области. Студент демонстрирует способность анализировать материал.
- **«не зачтено»** выставляется за неполное раскрытие темы; нарушение логики и структуры изложения материала; выводов и предложений, носящих общий характер, плохо подготовленное наглядное представление работы; отсутствуют практические примеры; нет ссылок на источники литературы.

#### 3.1.2 ВОПРОСЫ для проведения входного контроля

Входной контроль знаний обучающихся является частью общего контроля и предназначен для определения уровня готовности каждого обучающегося и группы в целом к дальнейшему обучению, а также для выявления типичных пробелов в знаниях, умениях и навыках обучающихся с целью организации работы по ликвидации этих пробелов.

Одновременно входной контроль выполняет функцию первичного среза обученности и качества знаний по дисциплине и определения перспектив дальнейшего обучения каждого обучающегося и группы в целом с целью сопоставления этих результатов с предшествующими и последующими показателями и выявления результативности работы.

Являясь составной частью педагогического мониторинга качества образования, входной контроль в сочетании с другими формами контроля, которые организуются в течение изучения дисциплины, обеспечивает объективную оценку качества работы каждого преподавателя независимо от контингента обучающихся и их предшествующей подготовки, т. к. результаты каждого обучающегося и группы в целом сравниваются с их собственными предшествующими показателями.

Таким образом, входной контроль играет роль нулевой отметки для последующего определения вклада преподавателя в процесс обучения.

### **Процедура проведения входного контроля**

Входной контроль проводится в учебной группе в аудиторное время без предварительной подготовки обучающихся. При проведении входного контроля обучающиеся не должны покидать аудиторию до его окончания, пользоваться учебниками, конспектами и другими справочными материалами.

Оценка уровня знаний обучающегося производится в виде «зачтено и незачтено».

Результаты входного контроля оформляются преподавателем в журнале учета посещаемости и текущей успеваемости студентов.

### **ВОПРОСЫ для проведения входного контроля**

1. Понятие финансового рынка
2. Виды финансовых рынков
3. Понятие финансовой инфраструктуры
4. Рынок ценных бумаг: основные понятия, функции
5. Первичный рынок ценных бумаг
6. Валютный рынок
7. Кредитный рынок: виды, объекты инвестирования
8. Институты финансового рынка
9. Основные тенденции развития финансового рынка на современном этапе
10. Финансы экономических субъектов
11. Понятие финансового анализа
12. Виды финансового анализа
13. Государственное регулирование финансового рынка
14. Рынок ценных бумаг: виды, участники
15. Вторичный рынок ценных бумаг
16. Рынок драгоценных металлов
17. Кредитный рынок: сущность, функции
18. Институциональная среда финансового рынка
19. Основные особенности развития финансового рынка на современном этапе
20. Государственные и муниципальные финансы

### **ШКАЛА И КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ**

-«зачтено» студент использует научную терминологию, стилистическое и логическое изложение ответа на вопросы; владеет инструментарием предшествующих изученных дисциплин; умеет ориентироваться в основных теориях, концепциях и направлениях по изучаемым дисциплинам.

-«незачтено» студент имеет недостаточно полный объем знаний в рамках изученных дисциплин; использует научную терминологию, но ответы на вопросы осуществляются с существенными логическими ошибками; слабо владеет инструментарием в рамках предшествующих дисциплин; не умеет ориентироваться в основных теориях, концепциях и направлениях; отказ от ответа.

#### **3.1.3 Средства для текущего контроля**

##### **ВОПРОСЫ**

##### **для самостоятельного изучения темы**

«Типология моделей функционирования финансовых рынков»

1. Тенденции развития финансовых рынков в мировом сообществе.
2. Финансовый рынок. Функции финансового рынка.
3. Денежный рынок. Рынок капитала. Рынок ценных бумаг (фондовый рынок). Финансовая система и финансовый рынок.
4. Финансовые институты и рынки.
5. Типы финансовых систем (основанные на банках и основанные на рынках ценных бумаг).
6. Основные мировые тенденции развития финансовых рынков.
7. Виды финансовых посредников и их место на финансовом рынке.

## **ВОПРОСЫ**

### **для самостоятельного изучения темы**

«Эффективность финансового рынка и его развития»

1. Концепция эффективности финансовых рынков и понятие эффективного рынка
2. Три формы рыночной эффективности
3. Слабая форма рыночной эффективности
4. Средняя (полусильная) форма рыночной эффективности
5. Сильная форма рыночной эффективности.
6. Значение исследования эффективности рынка

## **ВОПРОСЫ**

### **для самостоятельного изучения темы**

«Индикаторы развития финансовых рынков»

1. Капитализация публичных компаний
2. Отношение капитализации к ВВП
3. Биржевая торговля акциями. Отношение биржевой торговли акциями к ВВП
4. Стоимость корпоративных облигаций в обращении. Отношение стоимости корпоративных облигаций в обращении к ВВП
5. Пенсионные накопления и резервы негосударственных пенсионных фондов
6. Годовой объем публичных размещений акций на внутреннем рынке по рыночной стоимости
7. Количество розничных инвесторов на рынке ценных бумаг

## **ВОПРОСЫ**

### **для самостоятельного изучения темы**

«Система фундаментального анализа и макроэкономический анализ в его структуре»

1. Алгоритмы определения целевой цены компании
2. Последовательный анализ перспектив компании и ее акций сверху-вниз
3. Последовательный анализ перспектив компании и ее акций снизу-вверх
4. Макроэкономические факторы, влияющие на оценку стоимости компании
5. Состояние национальной экономики
6. Экономическая политика государства
7. Политическая ситуация в государстве.
8. Правовое регулирование
9. Конъюнктура мировых товарных и финансовых рынков

## **ВОПРОСЫ**

### **для самостоятельного изучения темы**

«Применение методов технического анализа в целях финансового мониторинга»

1. Предмет финансового мониторинга
2. критерии классификации мониторинговой деятельности
3. Объекты финансового мониторинга
4. Субъекты финансового мониторинга
5. Основные принципы мониторинга
6. Требования, предъявляемые к мониторинговой деятельности
7. Наиболее важные характеристики и отличительные особенности мониторинга при рассмотрении его как вида практической деятельности
8. Условия успешного комплексного решения проблем, связанных с использованием информации для проведения финансового мониторинга и принятия управленческих решений
9. Основные цели и задачи мониторинга
10. Методология мониторинга
11. Технология мониторинга

## **ВОПРОСЫ**

### **для самостоятельного изучения темы**

«Стратегический анализ в рекомендациях FATF: особенности методологии»

1. Группа разработки финансовых мер борьбы с отмыванием денег
2. Техническое соответствие и эффективность
3. Оценка технического соответствия
4. Оценка эффективности
5. Наднациональная оценка
6. Отчет о взаимной оценке

7. Руководящие документы ФАТФ
8. Правовые основания требований к финансовым учреждениям и УНФПП

### **ВОПРОСЫ**

#### **для самостоятельного изучения темы**

**«Влияние мирового кризиса ликвидности на развитие финансовых рынков»**

1. Причины и условия финансового кризиса
2. Финансовые кризисы: понятие и виды
3. Кризис ликвидности как часть финансового кризиса
4. Влияние финансового кризиса на развитие финансовых рынков
5. Экономика России как часть мирового финансового кризиса
6. Характеристика финансовых отношений в условиях кризиса
7. Промежуточные итоги финансового кризиса
8. Уроки финансового кризиса
9. Антикризисные меры, принимаемые на мировом и российском уровнях
10. Программа антикризисных мер правительства РФ

### **ВОПРОСЫ**

#### **для самостоятельного изучения темы**

**«Применение методов фундаментального анализа в целях финансового мониторинга»**

1. Сравнение показателей как метод фундаментального анализа
2. Корреляция как метод фундаментального анализа
3. Сезонность как метод фундаментального анализа
4. Группировка и обобщение как метод фундаментального анализа
5. Индукция и дедукция как метод фундаментального анализа
6. Макроэкономический анализ как метод фундаментального анализа
7. Отраслевой метод как метод фундаментального анализа
8. Анализ компаний как метод фундаментального анализа

### **ВОПРОСЫ**

#### **для самостоятельного изучения темы**

**«Мониторинг финансовых рынков на основе исследования динамики индексов развития финансовых рынков»**

1. Цели и направления развития финансового рынка РФ
2. Текущее состояние российского финансового рынка: тенденции, вызовы и возможности
3. Мероприятия по развитию финансового рынка РФ
4. Риски реализации основных направлений развития финансового рынка РФ
5. Ожидаемые результаты и индикаторы мониторингу эффективности
6. Методика расчета индикаторов для мониторинга эффективности

### **ВОПРОСЫ**

#### **для самостоятельного изучения темы**

**«Динамика различных видов индексов как индикатор развития финансовых рынков»**

1. Динамика среднегодовых значений финансовых индикаторов
2. Динамика среднемесячных значений финансовых индикаторов
3. Динамика ежедневных значений финансовых индикаторов
4. Изменения значений финансовых индикаторов
5. Обобщенные индикаторы финансовых рынков
6. Прогнозирование кризисных явлений на финансовых рынках

### **ВОПРОСЫ**

#### **для самостоятельного изучения темы**

**«Исследование динамики индексов развития финансовых рынков в целях финансового мониторинга»**

1. Абсолютные размеры мировых финансовых рынков
2. Динамика мировых финансовых рынков
3. Финансовый рынок России
4. Ресурсы для финансовых рынков
5. Конкуренция между финансовыми инструментами
6. Балансы финансовых инструментов
7. Институциональные балансы

### **Общий алгоритм самостоятельного изучения темы**

- 1) Ознакомиться с рекомендованными нормативно-правовыми документами;
- 2) Подготовиться к предусмотренному контрольно-оценочному мероприятию по результатам самостоятельного изучения темы (доклад или презентация (по выбору студента))
- 3) Принять участие в указанном мероприятии в установленное время

### **ШКАЛА И КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ самостоятельного изучения темы**

- оценка «зачтено» выставляется студенту, если в представленной работе (доклад или презентация) раскрыта тема, представлены различные позиции и взгляды на проблему, теоретические послылки подтверждены примерами, содержание четко структурировано, при написании работы использовался широкий круг источников, к которым в тексте работы имеются отсылки.
- оценка «не зачтено» выставляется студенту, если в представленной работе (доклад или презентация) не раскрыта тема, материал излагается непоследовательно, нет четкой структуры, не представлены различные позиции и взгляды на проблему, теоретические послылки не подтверждены примерами, при написании работы использовался ограниченный круг источников, в тексте работы отсутствуют ссылки.

### **ВОПРОСЫ**

#### **для самоподготовки к практическим (семинарским) занятиям**

В процессе подготовки к практическим (семинарским) занятиям студент изучает представленные ниже вопросы по темам. На занятии студент демонстрирует свои знания по изученным вопросам в форме устного ответа. Для усвоения материала по теме занятия обучающийся решает задачи.

#### **Тема семинара 1. Сущность и особенности технического анализа финансовых рынков**

- 1) Основные положения и цели технического анализа
- 2) Функции технического анализа
- 3) Принципы технического анализа
- 4) Способы технического анализа

Контрольные вопросы:

1. Основные понятия, используемые при работе на финансовых рынках
2. Финансовые рынки
3. Виды ценных бумаг
4. Участники рынков
5. Механизм торговли на финансовых рынках
6. Сущность технического анализа
7. Технический анализ и гипотеза эффективности рынков
8. Технический и фундаментальный анализ
9. Теория Доу

#### **Тема семинара 2. Методы предоставления информации и инструменты технического анализа**

- 1) Методы предоставления ценовой информации
- 2) Объем торговли и открытый интерес
- 3) Понятие и виды тренда
- 4) Фазы тренда

Контрольные вопросы:

1. Линейные графики
2. Графики в виде «баров»
3. Графики эквивалентных объемов (equivolume)
4. Японские свечи Графики объемных свечей (candlevolume)
5. Графики типа «крестики-нолики»
6. Графики трехполосного разворота (tree line break)
7. Графики типа «Каги» (Kagi) Графики типа «Ренко» (Renko)
8. Гистограммы
9. Определение тренда по Доу

10. Линии тренда Линии канала
11. Линии ДеМарка
12. Использование линий трендов и линий канала для анализа рынка.
13. Модели Скользящие средние
14. Огибающие ценовые полосы
15. Бестрендовые движения цен.
16. Уровни поддержки и сопротивления

### **Тема семинара 3. Методы предоставления информации и инструменты технического анализа**

- 1) Методы предоставления ценовой информации
- 2) Объем торговли и открытый интерес
- 3) Понятие и виды тренда
- 4) Фазы тренда

Контрольные вопросы:

1. Линейные графики
2. Графики в виде «баров»
3. Графики эквивалентных объемов (equivolume)
4. Японские свечи Графики объемных свечей (candlevolume)
5. Графики типа «крестики-нолики»
6. Графики трехполосного разворота (tree line break)
7. Графики типа «Каги» (Kagi) Графики типа «Ренко» (Renko)
8. Гистограммы
9. Определение тренда по Доу
10. Линии тренда Линии канала
11. Линии ДеМарка
12. Использование линий трендов и линий канала для анализа рынка.
13. Модели Скользящие средние
14. Огибающие ценовые полосы
15. Бестрендовые движения цен.
16. Уровни поддержки и сопротивления

### **Тема семинара 4. Осцилляторы**

- 1) Цель особенности классификация осцилляторов
- 2) Момент
- 3) Норма изменения
- 4) Индекс относительной силы

Контрольные вопросы:

1. Осциллятор скорости рынка
2. Основные принципы анализа осцилляторов
3. Темп изменений
4. Осциллятор двойной скользящей средней
5. Схождение - расхождение скользящих средних
6. Индекс относительной силы
7. Стохастический осциллятор
8. Осциллятор Уильямса
9. Индикаторы направленного движения
10. Индекс расширения диапазона

### **Тема семинара 5. Торговые системы**

- 1) Понятие. Сущность торговой системы
- 2) Элементы торговой системы
- 3) Этапы построения торговой системы

Контрольные вопросы:

1. Структура и основные этапы построения механической торговой системы
2. Основные типы механических торговых систем
3. Трендследящие торговые стратегии
4. Противотрендовые стратегии и системы торгового диапазона
5. Оценка и оптимизация торговых стратегий
6. Управление размером открываемой торговой позиции

**ВОПРОСЫ**  
**для самоподготовки к практическим занятиям**

- 1: Валютные рынки
- 2: Валютный курс
3. Валютные операции
4. Балансы международных расчетов
5. Валютные риски
6. Мировой рынок ссудных капиталов
7. Валютная политика России

**Задачи к практическим занятиям**  
**Тема практического занятия 1: Скользящие средние**

**Задача 1.** Пусть сглаживание осуществляется по пятичленной скользящей средней ( $l=5$ ), причем аппроксимация осуществляется квадратичным полиномом ( $m=2$ ). Требуется определить весовые коэффициенты для восстановления двух последних уровней ряда.

**Задача 2.** Методы аналитического выравнивания и прогнозирования временных рядов.

Необходимо выровнять ряд динамики с помощью уравнения линейного тренда  $y = a_0 + a_1 \cdot t$

| t     | $y_t$  | $t^2$ | $y_t \cdot t$ | $\hat{y}_t$ |
|-------|--------|-------|---------------|-------------|
| 1     | 387,6  | 1     | 387,6         | 403,5       |
| 2     | 399,9  | 4     | 799,8         | 396,9       |
| 3     | 404,4  | 9     | 1212,0        | 390,2       |
| 4     | 383,1  | 16    | 1532,4        | 383,6       |
| 5     | 376,9  | 25    | 1884,5        | 376,9       |
| 6     | 377,7  | 36    | 2266,2        | 370,3       |
| 7     | 358,1  | 49    | 2506,7        | 363,7       |
| 8     | 371,9  | 64    | 2975,2        | 357,1       |
| 9     | 337,4  | 81    | 3000,6        | 350,4       |
| Итого | 3392,6 | 285   | 16565,0       | 3392,6      |

**Задача 3.** Методы аналитического выравнивания и прогнозирования временного ряда. В таблице представлен ряд динамики условного экономического показателя ( $y$ ) за девять лет ( $t$ ).

| t | 1     | 2     | 3     | 4     | 5     | 6     | 7     | 8     | 9     |
|---|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| y | 387,6 | 399,9 | 404,0 | 383,1 | 376,9 | 377,7 | 358,1 | 371,9 | 333,4 |

Рассчитать доверительный интервал прогноза по уровню тренда.

| t | $y_t$ | t  | $y_t$ | t  | $y_t$ |
|---|-------|----|-------|----|-------|
| 1 | 510   | 11 | 494   | 21 | 523   |
| 2 | 497   | 12 | 499   | 22 | 527   |
| 3 | 504   | 13 | 502   | 23 | 523   |



|    |     |    |     |    |     |
|----|-----|----|-----|----|-----|
| 4  | 510 | 14 | 509 | 24 | 528 |
| 5  | 509 | 15 | 525 | 25 | 529 |
| 6  | 503 | 16 | 512 | 26 | 538 |
| 7  | 500 | 17 | 510 | 27 | 539 |
| 8  | 500 | 18 | 506 | 28 | 541 |
| 9  | 500 | 19 | 515 | 29 | 543 |
| 10 | 495 | 20 | 522 | 30 | 541 |

### **ШКАЛА И КРИТЕРИИ ОЦЕНКИ самоподготовки по темам практических (семинарских) занятий**

Результаты определяют оценками.

*Оценку «отлично»* выставляют студенту, глубоко и прочно освоившему теоретический и практический материал дисциплины. Ответ должен быть логичным, грамотным. Студенту необходимо показать знание не только основного, но и дополнительного материала. Студент должен свободно справляться с поставленными задачами, правильно обосновывать принятые решения.

*Оценку «хорошо»* заслуживает студент, твердо знающий программный материал дисциплины, грамотно и по существу излагающий его. Необходимо правильно применять теоретические положения при решении практических задач, владеть определенными навыками и приемами их выполнения.

*Оценку «удовлетворительно»* получает студент, который имеет знания только основного материала, но не усвоил его детали, испытывает затруднения при решении практических задач. В ответах на поставленные вопросы студентом допущены неточности, даны недостаточно правильные формулировки, нарушена последовательность в изложении программного материала.

*Оценка «неудовлетворительно»* говорит о том, что студент не знает значительной части материала по дисциплине, допускает существенные ошибки в ответах, не может решить практические задачи или решает их с затруднениями.

### **ТЕСТОВЫЕ ВОПРОСЫ для проведения рубежного контроля**

#### **Раздел 1. Теоретический анализ финансовых рынков: сущность, цели, принципы**

1. Укажите время (МСК) проведения торгов на рынке FORTS:

- а) 10.00-23.50;
- б) 10.00-18.45.

2. Основные походы в фундаментальном анализе:

- а) снизу вверх;
- б) сверху вниз;
- в) верны оба варианта.

3. Фьючерс - это инструмент:

- а) долговой;
- б) срочный;
- в) долевого.

4. Рост базовой/учетной ставки приводит:

- а) ни к чему не приводит;
- б) к снижению ликвидности;
- в) повышению ликвидности.

5. Основная функция НКЦ:

- а) управление рисками;
- б) обеспечение стабильности;
- в) верны оба варианта.

6. Вариационная маржа - это:
- а) убыток в текущей торговой сессии;
  - б) прибыль/убыток в текущей торговой сессии;
  - в) прибыль в текущей торговой сессии.
7. В каком году была создана организация FATF (Financial Action Task Force):
- а) 1989;
  - б) 1988;
  - в) 1987.
8. Технический анализ - это:
- а) анализ актива на основе ценовых данных;
  - б) верны оба варианта;
  - в) анализ компании на основе ее баланса.
9. Фундаментальный анализ - это:
- а) верны оба варианта;
  - б) анализ макроэкономики;
  - в) анализ микроэкономики,
10. Индекс относительной силы - это индикатор:
- а) Moving Average;
  - б) Volume;
  - в) ATR;
  - г) RSI.
11. Ситуация контанго - это ситуация, при которой:
- а) фьючерсный контракт торгуется выше текущей цены базового актива;
  - б) фьючерсный контракт торгуется ниже текущей цены базового актива,
12. Фундаментальный анализ в большей степени подходит:
- а) для инвесторов;
  - б) спекулянтов;
  - в) скальперов.
13. При покупке опциона Put или Call:
- а) риски ограничены премией;
  - б) риски не ограничены;
  - в) рисков нет.
14. Страйк опциона - это:
- а) время исполнения;
  - б) цена исполнения.
15. Дата основания ММВБ:
- а) 1994;
  - б) 1992;
  - в) 1993.
16. При построении графика с помощью японских свечей осуществляется анализ на основе цен:
- а) максимума;
  - б) минимума;
  - в) закрытия;
  - г) верны все варианты;
  - д) открытия.
17. Акция - это инструмент:
- а) долевого;
  - б) долгового;
  - в) срочный.
18. Посредники фондового рынка, которые осуществляют заявки от имени клиента и за его счет:

- а) дилеры;
- б) брокеры.

19. Укажите наивысший кредитный рейтинг относительно инвестиционной категории:

- а) BBB;
- б) AAA;
- в) D.

20. Коэффициент Р/Е показывает:

- а) соотношение цены компании к ее прибыли;
- б) соотношение прибыли компании к долгу,

## **Раздел 2. Методы и инструменты финансового анализа**

1. Международный финансовый рынок – это:

- а) сфера рыночных отношений, которая обеспечивает перелив и перераспределение капитала;
- б) сфера кредитных отношений, которая обеспечивает перелив и перераспределение капитала;
- в) рынок капитала;

2. К функциям международного финансового рынка относятся:

- а) перераспределение и перелив капитала;
- б) централизация капитала;
- в) межвременная торговля;

3. Глобализации мировых финансовых рынков во многом способствовало распространение Интернета:

- а) да, это утверждение верно;
- б) финансовый рынок – это отдельный сегмент глобального рынка, и Интернет не имеет к нему никакого отношения;
- в) воздействие Интернета на финансовые рынки носит слишком незначительно, поэтому такое утверждение не совсем точное;
- г) Интернет способствует глобализации лишь кредитных рынков, поэтому считать, что Интернет воздействует на весь финансовый рынок, неверно.

4. Национальные фондовые биржи, например, ММВБ, можно рассматривать как структурный элемент МФР:

- а) структурным элементом МФР могут быть международные, а не национальные фондовые биржи;
- б) биржи вообще не входят в инфраструктуру МФР;
- в) да, такое утверждение верно;
- г) национальные биржи являются элементом лишь международных фондовых бирж, а не всего МФР.

5. В рамках альянса Euronext функционирует единая система проведения клиринга.

- а) нет, такой системы пока нет;
- б) создать такую систему в принципе невозможно;
- в) да, такая система действует;
- г) клиринговое обеспечение достигается в Euronext только при совершении мультивалютных сделок.

6. Платежный баланс считается ... при превышении валютных поступлений над валютными платежами.

- а) пассивным;
- б) сбалансированным;
- в) уравновешенным;
- г) активным.

7. В платежном балансе раздел «невидимых» операций включает баланс:

- а) текущих операций;
- б) услуг и некоммерческих платежей;
- в) операций с официальными валютными резервами; г) движения капиталов и кредитов.

8. При определении сальдо платежного баланса его статьи делятся на: а) национальные и внешнеэкономические;

- б) основные и балансирующие;
- в) постоянные и сезонные;
- г) относительные и абсолютные.

9. Платежный баланс на ... основывается на ежедневно меняющемся соотношении поступлений и платежей.

- а) определенную дату;
- б) определенный период;
- в) определенное событие;
- г) определенный срок.

10. Что из перечисленного не является функцией валюты:

- а) распределение налоговых поступлений по необходимым направлениям;
- б) мера интернациональных стоимостей;
- в) использование в качестве резервного средства;
- г) использование в качестве международного средства платежа.

11. По возможности обмена на другую валюту различают следующие виды валюты:

- а) обмениваемая и необмениваемая;
- б) полностью конвертируемая, частично конвертируемая, неконвертируемая;
- в) сильная и слабая;
- г) резервная и нерезервная.

12. Что из перечисленного относится к определению валютной системы?

- а) любой платежный документ либо денежное обязательство, выраженный в той или иной национальной или счетной денежной единице и используемый в международных расчетах;
- б) совокупность иностранных валют, в которых центральные банки различных государств накапливают и хранят резервы для международных расчетов;
- в) порядок проведения международных расчетов между странами, основанный на взаимном зачете платежей за товары и услуги, обладающие равной ценой, исчисленной в клиринговой валюте по согласованным ценам;
- г) финансовый рынок, на котором обращаются надежные краткосрочные финансовые инструменты.

13. Как называется глобальный валютный рынок, который работает 24 часа в сутки попеременно во всех частях света?

- а) Еврозона;
- б) зона долларового обращения;
- в) Московская межбанковская валютная биржа;
- г) Международная валютная биржа ФОРЕКС.

14. Определите, для какой из перечисленных форм кредита отличительным признаком является принадлежность одного из участников к другой стране:

- а) банковская форма кредита;
- б) государственная форма кредита;
- в) международная форма кредита;
- г) коммерческая форма кредита.

15. Выберите правильный ответ, чтобы закончить предложение: «Международные кредиты предоставляются...»:

- а) только в свободно конвертируемых валютах;
- б) в валютах страны-кредитора, страны-заемщика, третьей страны и международных счетных денежных единицах;
- в) только в валюте страны-кредитора;
- г) только в международных счетных денежных единицах.

16. Укажите, в каком из перечисленных вариантов представлено разделение государственных займов по способу размещения:

- а) выигрышные, процентные и товарные;
- б) краткосрочные и долгосрочные;
- в) принудительные, размещаемые по подписке и свободно обращающиеся;

г) облигационные и безоблигационные.

17. Какие свойства присущи ценной бумаге:

- а) ценная бумага содержит обязательные реквизиты;
- б) ценная бумага может быть объектом купли – продажи;
- в) ценным бумагам присущи только системные риски;
- г) ценным бумагам присущи только несистемные риски.

18. Назовите характерные черты векселя:

- а) вексель – ордерная ценная бумага;
- б) вексель – эмиссионная ценная бумага;
- в) вексель – это долговая ценная бумага;
- г) вексель – это денежное обязательство.

19. Профессиональный участник РЦБ, выполняющий функции регистратора, может принимать участие в торгах на бирже в качестве дилера:

- а) да, такое участие допустимо;
- б) нет, такое совмещение недопустимо;
- в) нет, он может выполнять лишь функции брокера, но не дилера;
- г) все определяется правилами конкретной биржи.

20. Сберегательные сертификаты:

- а) выпускаются любыми акционерными обществами;
- б) предназначены для физических лиц;
- в) предназначены для юридических лиц;
- г) выпускаются банками.

21. Укажите государственные ценные бумаги Российской Федерации:

- а) казначейские бонды;
- б) облигации федерального займа;
- в) государственные краткосрочные облигации;
- г) казначейские ноты.

22. На протяжении торговой сессии в РТС торговые члены должны непрерывно поддерживать:

- а) три двусторонние котировки;
- б) одну одностороннюю котировку;
- в) три односторонние котировки;
- г) пять двусторонних котировок.

23. Как динамика значений объема связана с направлением изменения цены:

- а) при восходящей тенденции значения объема увеличиваются по мере роста значений цены;
- б) при нисходящей тенденции значения объема уменьшаются по мере уменьшения значений цены;
- в) динамика значений объема не зависит от направления тенденции;
- г) динамика значений объема зависит от направления тенденции.

24. В перечень функций международных организаций входит:

- а) регулирование;
- б) содействие;
- в) субсидирование;
- г) наблюдение;
- д) контроль.

25. Обусловленность финансирования МВФ означает, что: ...

- а) страна-получатель кредита обязуется направлять полученные средства на заранее оговоренные цели;
- б) страна-реципиент кредита обязуется проводить определенную экономическую политику;
- в) кредитор выделяет средства ради достижения ежегодных целей своей деятельности.
- г) страна-резидент кредита обязуется проводить определенную политику в области формирования валютного законодательства.

26. Лондонский клуб представляет собой:

- а) консультационный комитет правительств стран-кредиторов;
- б) консультационный комитет банков-кредиторов;

- в) известное место отдых британских финансовых аналитиков;
- г) организацию кредитных банков.

27. Кредиты Международного Банка Реконструкции и Развития предназначены для:

- а) стран, не имеющих доступ на международные финансовые рынки;
- б) стран, испытывающих дефицит платежного баланса;
- в) стран, не имеющих возможности платить рыночные процентные ставки.
- г) стран, испытывающих профицит платежного баланса.

28. Деньги – это ...

- а) товар, обменивающийся на определенную группу товаров;
- б) товар, играющий роль всеобщего эквивалента;
- в) товар, обладающий наименьшей ликвидностью;
- г) ценная бумага, выпущенная акционерным обществом.

29. Выберите из приведенных формул, закон денежного обращения выведенный И. Фишером:

- а)  $MV = PQ$ ;
- б)  $MQ = PV$ ;
- в)  $M = QVP$ ;
- г)  $P = MVQ$ .

30. Денежная система – это

- а) национальная система денег
- б) государственная система организации выпуска и функционирования денежных средств
- в) порядок обращения национальной валюты
- г) совокупность атрибутов денежных знаков: наименование денежной единицы, масштаб цен, виды денежных знаков.

### ШКАЛА И КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ

- оценка «отлично» выставляется обучающемуся, если получено более 80% правильных ответов.
- оценка «хорошо» - получено от 71 до 80% правильных ответов.
- оценка «удовлетворительно» - получено от 61 до 70% правильных ответов.
- оценка «неудовлетворительно» - получено менее 60% правильных ответов.

#### 3.1.4. Средства для промежуточной аттестации по итогам изучения дисциплины

##### ВОПРОСЫ

##### для подготовки к итоговому контролю

1. Основные положения и цели технического анализа
2. Функции технического анализа
3. Принципы технического анализа
4. Способы технического анализа
5. Методы предоставления ценовой информации
6. Объем торговли и открытый интерес
7. Понятие и виды тренда
8. Фазы тренда
9. Уровни поддержки и сопротивления
10. Линии и каналы тренда
11. Модели разворота тенденций
12. Модели продолжения тенденций
13. Сущность скользящих средних
14. Объекты скользящих средних
15. Правила скользящих средних
16. Комбинации скользящих средних
17. Цель особенности классификация осцилляторов

18. Момент
19. Норма изменения
20. Индекс относительной силы
21. Понятие. Сущность торговой системы
22. Элементы торговой системы
23. Этапы построения торговой системы
24. Способы формализации для программ технического анализа линий трендов
25. Способы формализации для программ технического анализа графических формаций
26. Создание, тестирование и оптимизация торговых стратегий, основанных на графических методах
27. Создание, тестирование и оптимизация торговых стратегий, основанных на трендовых индикаторах
28. Создание, тестирование и оптимизация торговых стратегий, основанных на контртрендовых индикаторах
29. Разработка и тестирование собственного индикатора входа в позицию
30. Разработка новых инструментов выхода из позиции
31. Тестирование частот появления моделей японских свечей на российском фондовом рынке и оценка их прогнозной точности
32. Тестирование входов и выходов торговых систем, основанных на японских свечах
33. Тестирование авторских методик
34. Изучение роста на основе прошлых доходов и прогноз будущего роста
35. Определение ставки дисконтирования для расчетов стоимости компании
36. Финансовый прогноз деятельности компании и оценка будущих денежных потоков
37. Оценка многопрофильных компаний
38. Оценка молодых или начинающих фирм
39. Оценка фирм с отрицательной прибылью
40. Оценка циклических фирм
41. Оценка компаний на развивающихся рынках
42. Сравнительная оценка компаний
43. Влияние макроэкономических данных на курс валютных пар
44. Влияние природных, макроэкономических и техногенных факторов на динамику товарных фьючерсов
45. Типология моделей функционирования финансовых рынков
46. Эффективность финансового рынка и его развития
47. Индикаторы развития финансовых рынков
48. Система фундаментального анализа и макроэкономический анализ в его структуре
49. Применение методов технического анализа в целях финансового мониторинга
50. Стратегический анализ в рекомендациях FATF: особенности методологии
51. Влияние мирового кризиса ликвидности на развитие финансовых рынков
52. Применение методов фундаментального анализа в целях финансового мониторинга
53. Мониторинг финансовых рынков на основе исследования динамики индексов развития финансовых рынков
54. Динамика различных видов индексов как индикатор развития финансовых рынков
55. Исследование динамики индексов развития финансовых рынков в целях финансового мониторинга

**ПЛАНОВАЯ ПРОЦЕДУРА  
проведения зачета**

| <b>Нормативная база проведения<br/>промежуточной аттестации обучающихся по результатам изучения дисциплины:</b>                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                     |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1) действующее «Положение о текущем контроле успеваемости, промежуточной аттестации обучающихся по программам высшего образования (бакалавриат, специалитет, магистратура) и среднего профессионального образования в ФГБОУ ВО Омский ГАУ» |                                                                                                                                                                                                                     |
| <b>6.2. Основные характеристики<br/>промежуточной аттестации обучающихся по итогам изучения дисциплины</b>                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                     |
| <b>Цель промежуточной аттестации</b>                                                                                                                                                                                                       | установление уровня достижения каждым обучающимся целей обучения по данной дисциплине, изложенных в п.2.2 настоящей программы                                                                                       |
| <b>Форма промежуточной аттестации</b>                                                                                                                                                                                                      | зачет                                                                                                                                                                                                               |
| <b>Место процедуры получения зачета в графике учебного процесса:</b>                                                                                                                                                                       | 1) участие обучающегося в процедуре получения зачёта осуществляется за счёт учебного времени (трудоемкости), отведённого на изучение дисциплины                                                                     |
|                                                                                                                                                                                                                                            | 2) процедура проводится в рамках ВАРО, на последней неделе семестра                                                                                                                                                 |
| <b>Основные условия получения обучающимся зачёта:</b>                                                                                                                                                                                      | 1) обучающийся выполнил все виды учебной работы (включая самостоятельную) и отчитался об их выполнении в сроки, установленные графиком учебного процесса по дисциплине;<br>2) подготовил полнокомплектное портфолио |
| <b>Процедура получения зачёта</b>                                                                                                                                                                                                          | 1) Преподаватель просматривает представленные материалы и записи в журнале учёта посещаемости и успеваемости студентов.<br>2) Преподаватель выставляет зачет в зачетную ведомость и в зачётную книжку студента.     |

**ШКАЛА И КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ**

-«зачтено» студент использует научную терминологию, стилистическое и логическое изложение ответа на вопросы; владеет инструментарием предшествующих изученных дисциплин; умеет ориентироваться в основных теориях, концепциях и направлениях по изучаемым дисциплинам.

-«незачтено» студент имеет недостаточно полный объем знаний в рамках изученных дисциплин; использует научную терминологию, но ответы на вопросы осуществляются с существенными логическими ошибками; слабо владеет инструментарием в рамках предшествующих дисциплин; не умеет ориентироваться в основных теориях, концепциях и направлениях; отказ от ответа.



#### 4. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА сформированности компетенции

##### 4.1. ПК-2 Способность осуществлять мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков

**ИД-1<sub>ПК-2</sub>** Проведение исследования финансового рынка и изучение предложений финансовых услуг (в том числе действующих правил и условий, тарифной политики и действующих форм документации)

**Тип заданий:** выбор одного варианта правильного ответа из нескольких предложенных / выбор нескольких правильных вариантов из предложенных вариантов ответов

1. Одним из способов снижения рисков на финансовом рынке является:  
+ликвидационный неттинг  
ликвидирующий неттинг  
вспомогательный неттинг  
восстанавливающий неттинг
2. Сделка с товаром, совершаемая на бирже и предусматривающая немедленную оплату и поставку товара, - это  
репорт  
+ сделка с опционом  
кассовая сделка  
срочная сделка
3. Специальные расчётные единицы, применяемые во внешней торговле на основе межправительственных соглашений двух или нескольких государств  
СДР  
+ клиринговая валюта  
резервная валюта  
международная коллективная валюта

**Тип заданий:** установление правильной последовательности в предложенных вариантах ответов / установление соответствия между элементами в предложенных вариантах ответов

4. Соответствие между понятиями трейдерского анализа и их содержанием:

**УКАЖИТЕ СООТВЕТСТВИЕ ДЛЯ КАЖДОГО ЭЛЕМЕНТА ЗАДАНИЯ**

|                    |                                                                                               |
|--------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------|
| арбитраж           | сделка с малой степенью риска из торговли одной и той же валютой на разных торговых площадках |
| аск (от англ. Ask) | цена, за которую продавец предлагает приобрести валюту                                        |
| бид (от англ. Bid) | ордер на покупку                                                                              |
| котитровка         | текущая цена биржевого инструмента                                                            |
|                    | сделка, направленная на покупку биржевого актива                                              |
|                    | ценовое движение, направленное в противоположную сторону от основного                         |

**Тип заданий:** открытого типа (самостоятельный ввод обучающимся правильного ответа в виде термина, краткого определения, цифрового значения) / Практико-ориентированные задания (кейсы)

5. Правление Международного валютного фонда находится в городе  
**ОТВЕТ ЗАПИШИТЕ СТРОЧНЫМИ БУКВАМИ В ФОРМЕ СУЩЕСТВИТЕЛЬНОГО В ИМЕНИТЕЛЬНОМ ПАДЕЖЕ**  
+Вашингтон

**ИД-2<sub>ПК-2</sub>** Организация сбора, обработки и анализа информации, в том числе с применением социологических, маркетинговых исследований

**Тип заданий: выбор одного варианта правильного ответа из нескольких предложенных / выбор нескольких правильных вариантов из предложенных вариантов ответов**

6. Баланс, характеризующий соотношение валютных поступлений из-за границы и платежей, произведенных той или иной страной другим странам, - это:

экспортный  
+платежный  
расчетный  
торговый

7. Способ страхования валютных рисков.

односторонние действия одного из контрагентов  
использование валютной оговорки  
+хеджирование  
регулирование валютной позиции по заключаемым контрактам

8. Спрэдом называется...

максимальное изменение котировки за торговую сессию;  
количество национальной валюты, предлагаемой за единицу иностранной валюты  
количество иностранной валюты, предлагаемой за единицу национальной валюты  
+разность между лучшими ценами заявок на продажу (аск) и на покупку (бид)  
фиксированный валютный курс

**Тип заданий: установление правильной последовательности в предложенных вариантах ответов / установление соответствия между элементами в предложенных вариантах ответов**

9. Соответствие между графиками (их элементами) и их содержанием:

УКАЖИТЕ СООТВЕТСТВИЕ ДЛЯ КАЖДОГО ЭЛЕМЕНТА ЗАДАНИЯ

|                 |                                                                                                  |
|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------|
| бар             | элемент графика котировок, который отображает движение цены на определенном временном промежутке |
| боковик, флет   | движение цены без явно выраженного тренда                                                        |
| линейный график | график движения цены, построенный в виде кривой линии                                            |
| паттерн         | повторяющаяся модель в динамике цены                                                             |
|                 | значимый уровень, на котором обычно цена замедляет падение и начинает рост                       |
|                 | способ отображения активности в биржевом стакане в течение времени                               |

**Тип заданий: открытого типа (самостоятельный ввод обучающимся правильного ответа в виде термина, краткого определения, цифрового значения) / Практико-ориентированные задания (кейсы)**

После Лондонской конференции 1933 г. возникли три валютных фонда: долларовой, стерлинговой и ...

ОТВЕТ ЗАПИШИТЕ СТРОЧНЫМИ БУКВАМИ В ФОРМЕ ПРИЛАГАТЕЛЬНОГО В ИМЕНИТЕЛЬНОМ ПАДЕЖЕ

+золотой

**ИД-3<sub>ПК-2</sub> Мониторинг информационных источников финансовой информации**

**Тип заданий: выбор одного варианта правильного ответа из нескольких предложенных / выбор нескольких правильных вариантов из предложенных вариантов ответов**

Платежный баланс считается ...при превышении валютных платежей над валютными поступлениями  
открытым  
закрытым  
активным

+пассивным

«Бычьим» трендом называется:

+повышательное движение цены

понижательное движение цены

скачкообразное движение цены

устойчивость цены за определенный период

Ревальвация национальной валюты применяется при ... платежном балансе.

пассивном

взвешенном

сбалансированном

активном+

**Тип заданий: установление правильной последовательности в предложенных вариантах ответов / установление соответствия между элементами в предложенных вариантах ответов**

Соответствие между понятиями валютного законодательства и их содержанием:

**УКАЖИТЕ СООТВЕТСТВИЕ ДЛЯ КАЖДОГО ЭЛЕМЕНТА ЗАДАНИЯ**

|                       |                                                                                                |
|-----------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------|
| иностранная валюта    | законное средство платежа на территории соответствующего иностранного государства              |
| валютные ценности     | иностранная валюта, внешние ценные бумаги, а также цифровые права                              |
| внешние ценные бумаги | ценные бумаги, не относящиеся в соответствии с законодательством к внутренним ценным бумагам   |
| валютная операция     | приобретение резидентом у резидента валютных ценностей на законных основаниях                  |
|                       | находящиеся за пределами территории Российской Федерации филиалы резидентов                    |
|                       | эмиссионные ценные бумаги, номинальная стоимость которых указана в валюте Российской Федерации |

**Тип заданий: открытого типа (самостоятельный ввод обучающимся правильного ответа в виде термина, краткого определения, цифрового значения) / Практико-ориентированные задания (кейсы)**

Инвестирование средств в разные активы с целью снижения рисков – это...

**ОТВЕТ ЗАПИШИТЕ СТРОЧНЫМИ БУКВАМИ В ФОРМЕ СУЩЕСТВИТЕЛЬНОГО В ИМЕНИТЕЛЬНОМ ПАДЕЖЕ**

+ диверсификация

