

**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«ВОРОНЕЖСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АГРАРНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ИМЕНИА
ИМПЕРАТОРА ПЕТРА I»**

Экономический факультет

Кафедра финансов и кредита

УТВЕРЖДАЮ

Зав. кафедрой

Агибалов А.В. 
«19» апреля 2017г.

Фонд оценочных средств

по дисциплине Б1.В.ДВ.5.1 Фундаментальный и технический анализ финансовых рынков
для направления 38.03.01 Экономика академический бакалавриат
профиль «Финансы и кредит»

1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

Индекс	Формулировка	Разделы дисциплины	
		1	2
ОПК-2	способностью осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач	+	
ОПК-3	способностью выбрать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, проанализировать результаты расчетов и обосновать полученные выводы		+
ПК-5	способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений		+
ПК-6	способностью анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей	+	
ПК-7	способностью, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет.	+	

2. Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

2.1 Шкала академических оценок освоения дисциплины

Виды оценок	Оценки	
Академическая оценка по 2-х балльной шкале (зачет)	Не зачтено	Зачтено

2.2 Текущий контроль

Код	Планируемые результаты	Раздел дисциплины	Содержание требования в разрезе разделов дисциплины	Технология формирования	Форма оценочного средства (контроля)	№Задания		
						Пороговый уровень (удовл.)	Повышенный уровень (хорошо)	Высокий уровень (отлично)
ОПК-2	Знать: – основы фундаментального анализа как подхода к прогнозированию динамики финансовых рынков на основе экономических показателей, политических событий, слухов и информационного настроения рынка; – основы технического анализа как подхода к прогнозированию финансового рынка на основе изучения математических и графических закономерностей в движении цены; психологическую природу реакции финансового рынка на экономические и политические новости.	1	1. Понятие и виды фундаментальных новостей. Цикл жизни фундаментальных факторов 2. Значения фундаментальных показателей и уточненные значения фундаментальных индикаторов 3. Политика, кризисные и природные явления, их влияние на финансовые рынки 4. Экономические циклы и их влияние на финансовые рынки 5. Валовой внутренний продукт 6. Инфляционные показатели 7. Показатели рынок труда 8. Показатели производственного сектора 9. Показатели	Лекция, практическое занятие, самостоятельная работа	Устный опрос, практические задания, тестирование.	Задания из разделов 3.1, 3.5 Тесты из задания 3.2	Задания из разделов 3.1, 3.5 Тесты из задания 3.2	Задания из разделов 3.1, 3.5 Тесты из задания 3.2

			<p>международной торговли</p> <p>10. Бюджетные показатели</p> <p>11. Индикаторы потребительского спроса</p> <p>12. Показатели розничной торговли</p> <p>13. Доходы населения и их индикаторы</p> <p>14. Индексы настроения потребителя</p> <p>15. Индикаторы делового цикла</p> <p>16. Индексы делового оптимизма</p> <p>17. Календарь экономических событий</p>					
ОПК-3	<p>Уметь:</p> <p>– планировать изменения показателей и использовать то, что рынок еще до факта публикации их значений уже начинает его закладывать в рыночную динамику;</p> <p>– производить</p>	2	<p>1. Торговая позиция</p> <p>2. Цены покупки и продажи — BID и ASK</p> <p>3. Усиление и ослабление валют данной валютной пары</p> <p>4. Способы открытия и закрытия позиций</p> <p>5. Типы ордеров по отношению к итогам сделки</p> <p>6.</p>	Лекция, практическое занятие, самостоятельная работа	Устный опрос, практические задания, тестирование.	Задания из разделов 3.1, 3.5 Тесты из задания 3.2	Задания из разделов 3.1, 3.5 Тесты из задания 3.2	Задания из разделов 3.1, 3.5 Тесты из задания 3.2

<p>поиск ключевого экономического или политического события, или процесса, который волнует участников рынка. Иметь навыки: – владения графическим методом анализа рынка, при котором любые заключения делаются на основе анализа простых графических элементов — линий, уровней, фигур и самих графиков цен; – владения математическим методом анализа рынка, при котором заключения формируются на основе анализа поведения искусственно созданных</p>		<p>Технологические типы ордеров 7. Расчет результата сделок 8. Учет спреда при выставлении ордеров 9. Операции с открытой позицией 10. Технический анализ — определение и постулаты 11. Технический анализ как методы прогнозирования цен 12. Графические методы прогнозирования цен 13. Математические методы прогнозирования цен 14. Формы представления данных о ценах 15. Тренды, линии, уровни 16. Разрывы 17. Перелом тренда 18. Разворотные фигуры (фигуры перелома) и принципы формирования разворотных фигур 19. Фигура «голова и плечи»</p>					
---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	--	--	--

	<p>численных показателей технических индикаторов.</p> <p>—</p>		<p>(head and shoulders, H&S)</p> <p>20. Кратные вершины и основания</p> <p>21. Неудавшийся размах</p> <p>22. Закругленные вершины и основания</p> <p>23. Расширяющая формация</p> <p>24. Алмазная формация</p> <p>25. Восходящие и нисходящие треугольники</p> <p>26. Расширяющийся треугольник</p> <p>27. Клин</p> <p>28. Веерный принцип</p> <p>29. Фигуры продолжения тенденции</p> <p>30. Симметричный треугольник</p> <p>31. Восходящий треугольник</p> <p>32. Нисходящий треугольник</p> <p>33. Расширяющийся треугольник</p> <p>34. Вымпел</p> <p>35. Флаг</p> <p>36. Клин</p>					
--	----------------------------------------------------------------	--	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	--	--	--

			<p>37. Прямоугольн ик</p> <p>38. Отмеренный ход</p> <p>39. Волновая теория Элиота</p> <p>40. Пропорции Фибоначчи в анализе рыночных графиков</p> <p>41. Скользящие средние и другие трендовые индикаторы</p> <p>42. Осцилляторы. Сигналы, подаваемые осцилляторами.</p> <p>43. Виды осцилляторов</p> <p>44. Подходы к определению параметров индикатора</p> <p>45. Подходы в анализе японских свечей</p>					
ПК-5	<p>Уметь:</p> <p>– планировать изменения показателей и использовать то, что рынок еще до факта публикации их значений уже начинает его закладывать в</p>	2	<p>1. Торговая позиция</p> <p>2. Цены покупки и продажи — BID и ASK</p> <p>3. Усиление и ослабление валют данной валютной пары</p> <p>4. Способы открытия и закрытия позиций</p>	Лекция, практическое занятие, самостоятельная работа	Устный опрос, практические задания, тестирование.	Задания из разделов 3.1, 3.5 Тесты из задания 3.2	Задания из разделов 3.1, 3.5 Тесты из задания 3.2	Задания из разделов 3.1, 3.5 Тесты из задания 3.2

	<p>рыночную динамику; – производить поиск ключевого экономического или политического события, или процесса, который волнует участников рынка. Иметь навыки: – владения графическим методом анализа рынка, при котором любые заключения делаются на основе анализа простых графических элементов — линий, уровней, фигур и самих графиков цен; – владения математическим методом анализа рынка, при котором заключения формируются на основе анализа</p>		<p>5. Типы ордеров по отношению к итогам сделки 6. Технологические типы ордеров 7. Расчет результата сделок 8. Учет спреда при выставлении ордеров 9. Операции с открытой позицией 10. Технический анализ — определение и постулаты 11. Технический анализ как методы прогнозирования цен 12. Графические методы прогнозирования цен 13. Математические методы прогнозирования цен 14. Формы представления данных о ценах 15. Тренды, линии, уровни 16. Разрывы 17. Перелом тренда 18. Разворотные фигуры (фигуры перелома) и принципы</p>					
--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	--	--	--

	<p>поведения искусственно созданных численных показателей технических индикаторов.</p> <p style="text-align: center;">—</p>		<p>формирования разворотных фигур</p> <p>19. Фигура «голова и плечи» (head and shoulders, H&S)</p> <p>20. Кратные вершины и основания</p> <p>21. Неудавшийся размах</p> <p>22. Закругленные вершины и основания</p> <p>23. Расширяющая форма</p> <p>24. Алмазная форма</p> <p>25. Восходящие и нисходящие треугольники</p> <p>26. Расширяющийся треугольник</p> <p>27. Клин</p> <p>28. Веерный принцип</p> <p>29. Фигуры продолжения тенденции</p> <p>30. Симметричный треугольник</p> <p>31. Восходящий треугольник</p> <p>32. Нисходящий треугольник</p> <p>33. Расширяющийся</p>					
--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	--	--	--

			<p>йся треугольник</p> <p>34. Вымпел</p> <p>35. Флаг</p> <p>36. Клин</p> <p>37. Прямоугольн ик</p> <p>38. Отмеренный ход</p> <p>39. Волновая теория Элиота</p> <p>40. Пропорции Фибоначчи в анализе рыночных графиков</p> <p>41. Скользящие средние и другие трендовые индикаторы</p> <p>42. Осцилляторы. Сигналы, подаваемые осцилляторами.</p> <p>43. Виды осцилляторов</p> <p>44. Подходы к определению параметров индикатора</p> <p>45. Подходы в анализе японских свечей</p>					
ПК-6	<p>Уметь:</p> <p>– выявлять логические связи в экономике;</p> <p>– сравнивать макрэкономическ ую ситуацию в</p>	1	<p>1. Понятие и виды фундаментальных новостей. Цикл жизни фундаментальных факторов</p> <p>2. Значения</p>	Лекция, практическое занятие, самостоятельная работа	Устный опрос, практические задания, тестирование.	Задания из разделов 3.1, 3.5 Тесты из задания 3.2	Задания из разделов 3.1, 3.5 Тесты из задания 3.2	Задания из разделов 3.1, 3.5 Тесты из задания 3.2

	<p>анализируемых странах; – работать по новостям, сравнивая плановые показатели и их фактические значения. Иметь навыки: – владения графическим методом анализа рынка, при котором любые заключения делаются на основе анализа простых графических элементов — линий, уровней, фигур и самих графиков цен; – владения математическим методом анализа рынка, при котором заключения формируются на основе анализа поведения</p>		<p>фундаментальных показателей и уточненные значения фундаментальных индикаторов 3. Политика, кризисные и природные явления, их влияние на финансовые рынки 4. Экономические циклы и их влияние на финансовые рынки 5. Валовой внутренний продукт 6. Инфляционные показатели 7. Показатели рынок труда 8. Показатели производственного сектора 9. Показатели международной торговли 10. Бюджетные показатели 11. Индикаторы потребительского спроса 12. Показатели розничной торговли 13. Доходы населения и их индикаторы</p>					
--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	--	--	--

	искусственно созданных численных показателей технических индикаторов. —		14. Индексы настроения потребителя 15. Индикаторы делового цикла 16. Индексы делового оптимизма 17. Календарь экономических событий					
ПК-7	Уметь: – выявлять логические связи в экономике; – сравнивать макроэкономическую ситуацию в анализируемых странах; работать по новостям, сравнивая плановые показатели и их фактические значения.	1	1. Понятие и виды фундаментальных новостей. Цикл жизни фундаментальных фак-торов 2. Значения фундаментальных показателей и уточненные значения фундаментальных индикаторов 3. Политика, кризисные и природные явления, их влияние на финансовые рынки 4. Экономические циклы и их влияние на финансовые рынки 5. Валовой внутренний продукт 6. Инфляционные показатели	Лекция, практическое занятие, самостоятельная работа	Устный опрос, практические задания, тестирование.	Задания из разделов 3.1, 3.5 Тесты из задания 3.2	Задания из разделов 3.1, 3.5 Тесты из задания 3.2	Задания из разделов 3.1, 3.5 Тесты из задания 3.2

			<p>7. Показатели рынка труда</p> <p>8. Показатели производственного сектора</p> <p>9. Показатели международной торговли</p> <p>10. Бюджетные показатели</p> <p>11. Индикаторы потребительского спроса</p> <p>12. Показатели розничной торговли</p> <p>13. Доходы населения и их индикаторы</p> <p>14. Индексы настроения потребителя</p> <p>15. Индикаторы делового цикла</p> <p>16. Индексы делового оптимизма</p> <p>17. Календарь экономических событий</p>					
--	--	--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	--	--	--

2.3 Промежуточная аттестация

Код	Планируемые результаты	Технология формирования	Форма оценочного средства (контроля)	№Задания		
				Пороговый уровень (зачтено)	Повышенный уровень	Высокий уровень
ОПК-2	<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> – основы фундаментального анализа как подхода к прогнозированию динамики финансовых рынков на основе экономических показателей, политических событий, слухов и информационного настроения рынка; – основы технического анализа как подхода к прогнозированию финансового рынка на основе изучения математических и графических закономерностей в движении цены; – психологическую природу реакции финансового рынка на экономические и политические новости. 	Лекция, практическое занятие, самостоятельная работа	Зачет	Задания из раздела 3.1, 3.6 Тесты из задания 3.2		
ОПК-3	<p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> – планировать изменения показателей и использовать то, что рынок еще до факта публикации их значений уже начинает его закладывать в рыночную динамику; – производить поиск ключевого экономического или политического события, или процесса, который волнует участников рынка. <p>Иметь навыки:</p> <ul style="list-style-type: none"> – владения графическим методом анализа рынка, при котором 	Лекция, практическое занятие, самостоятельная работа	Зачет	Задания из раздела 3.1, 3.6 Тесты из задания 3.2		

	<p>любые заключения делаются на основе анализа простых графических элементов — линий, уровней, фигур и самих графиков цен;</p> <p>– владения математическим методом анализа рынка, при котором заключения формируются на основе анализа поведения искусственно созданных численных показателей — технических индикаторов.</p>					
ПК-5	<p>Уметь:</p> <p>– планировать изменения показателей и использовать то, что рынок еще до факта публикации их значений уже начинает его закладывать в рыночную динамику;</p> <p>– производить поиск ключевого экономического или политического события, или процесса, который волнует участников рынка.</p> <p>Иметь навыки:</p> <p>– владения графическим методом анализа рынка, при котором любые заключения делаются на основе анализа простых графических элементов — линий, уровней, фигур и самих графиков цен;</p> <p>– владения математическим методом анализа рынка, при котором заключения формируются на основе анализа поведения искусственно созданных численных показателей —</p>	<p>Лекция, практическое занятие, самостоятельная работа</p>	<p>Зачет</p>	<p>Задания из раздела 3.1, 3.6 Тесты из задания 3.2</p>		

	технических индикаторов.					
ПК-6	<p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> – выявлять логические связи в экономике; – сравнивать макроэкономическую ситуацию в анализируемых странах; – работать по новостям, сравнивая плановые показатели и их фактические значения. <p>Иметь навыки:</p> <ul style="list-style-type: none"> – владения графическим методом анализа рынка, при котором любые заключения делаются на основе анализа простых графических элементов — линий, уровней, фигур и самих графиков цен; – владения математическим методом анализа рынка, при котором заключения формируются на основе анализа поведения искусственно созданных численных показателей — технических индикаторов. 	Лекция, практическое занятие, самостоятельная работа	Зачет	Задания из раздела 3.1, 3.6 Тесты из задания 3.2		
ПК-7	<p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> – выявлять логические связи в экономике; – сравнивать макроэкономическую ситуацию в анализируемых странах; – работать по новостям, сравнивая плановые показатели и их фактические значения. 	Лекция, практическое занятие, самостоятельная работа	Зачет	Задания из раздела 3.1, 3.6 Тесты из задания 3.2		

2.4 Критерии оценки на зачете

Оценка экзаменатора,	Критерии
«Зачтено», пороговый уровень	Обучающийся показал знание основных положений учебной дисциплины, умение получить с помощью преподавателя правильное решение конкретной практической задачи из числа предусмотренных рабочей программой, знакомство с рекомендованной справочной, учебной и научной литературой.
«Не зачтено»	При ответе обучающегося выявились существенные пробелы в знаниях основных положений учебной дисциплины, неумение с помощью преподавателя получить правильное решение конкретной практической задачи из числа предусмотренных рабочей программой учебной дисциплины

2.5 Критерии оценки устного опроса

Оценка	Критерии
«отлично»	выставляется обучающемуся, если он четко выражает свою точку зрения по рассматриваемым вопросам, приводя соответствующие примеры
«хорошо»	выставляется обучающемуся, если он допускает отдельные погрешности в ответе
«удовлетворительно»	выставляется обучающемуся, если он обнаруживает пробелы в знаниях основного учебно-программного материала
«неудовлетворительно»	выставляется обучающемуся, если он обнаруживает существенные пробелы в знаниях основных положений учебной дисциплины, неумение с помощью преподавателя получить правильное решение конкретной практической задачи из числа предусмотренных рабочей программой учебной дисциплины

2.6 Критерии оценки тестов

Ступени уровней освоения компетенций	Отличительные признаки	Показатель оценки сформированной компетенции
Пороговый	Обучающийся воспроизводит термины, основные понятия, способен узнавать языковые явления.	Не менее 55 % баллов за задания теста.
Продвинутый	Обучающийся выявляет взаимосвязи, классифицирует, упорядочивает, интерпретирует, применяет на практике пройденный материал.	Не менее 75 % баллов за задания теста.
Высокий	Обучающийся анализирует, оценивает, прогнозирует, конструирует.	Не менее 90 % баллов за задания теста.
Компетенция не сформирована		Менее 55 % баллов за задания теста.

2.7 Критерии оценки практических заданий

Оценка	Критерии
«отлично»	Составлен правильный алгоритм решения задачи, в логическом рассуждении, в выборе формул и решении нет ошибок, получен верный ответ, задача решена рациональным способом
«хорошо»	Составлен правильный алгоритм решения задачи, в логическом рассуждении и решении нет существенных ошибок; правильно сделан выбор формул для решения; есть объяснение решения, но задача решена нерациональным способом или допущено не более двух несущественных ошибок, получен верный ответ
«удовлетворительно»	Задание понято правильно, в логическом рассуждении нет существенных ошибок, но допущены существенные ошибки в выборе формул или в математических расчетах; задача решена не полностью или в общем виде
«неудовлетворительно»	Задача не решена или решена неправильно

2.8 Допуск к сдаче зачета

- 1.Посещение занятий. Допускается один пропуск без предъявления справки.
2. Выполнение домашних заданий.
3. Активное участие в работе на занятиях.

3. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы

3.1 Вопросы к зачету

1. Понятие и виды фундаментальных новостей. Цикл жизни фундаментальных факторов
2. Значения фундаментальных показателей и уточненные значения фундаментальных индикаторов
3. Политика, кризисные и природные явления, их влияние на финансовые рынки
4. Экономические циклы и их влияние на финансовые рынки
5. Валовой внутренний продукт
6. Инфляционные показатели
7. Показатели рынок труда
8. Показатели производственного сектора
9. Показатели международной торговли
10. Бюджетные показатели
11. Индикаторы потребительского спроса
12. Показатели розничной торговли
13. Доходы населения и их индикаторы
14. Индексы настроения потребителя
15. Индикаторы делового цикла
16. Индексы делового оптимизма

17. Календарь экономических событий
18. Торговая позиция
19. Цены покупки и продажи — BID и ASK
20. Усиление и ослабление валют данной валютной пары
21. Способы открытия и закрытия позиций
22. Типы ордеров по отношению к итогам сделки
23. Технологические типы ордеров
24. Расчет результата сделок
25. Учет спреда при выставлении ордеров
26. Операции с открытой позицией
27. Технический анализ — определение и постулаты
28. Технический анализ как методы прогнозирования цен
29. Графические методы прогнозирования цен
30. Математические методы прогнозирования цен
31. Формы представления данных о ценах
32. Тренды, линии, уровни
33. Разрывы
34. Перелом тренда
35. Разворотные фигуры (фигуры перелома) и принципы формирования разворотных фигур
36. Фигура «голова и плечи» (head and shoulders, H&S)
37. Кратные вершины и основания
38. Неудавшийся размах
39. Закругленные вершины и основания
40. Расширяющаяся формация
41. Алмазная формация
42. Восходящие и нисходящие треугольники
43. Расширяющийся треугольник
44. Клин
45. Веерный принцип
46. Фигуры продолжения тенденции
47. Симметричный треугольник
48. Восходящий треугольник
49. Нисходящий треугольник
50. Расширяющийся треугольник
51. Вымпел
52. Флаг
53. Клин
54. Прямоугольник
55. Отмеренный ход
56. Волновая теория Элиота
57. Пропорции Фибоначчи в анализе рыночных графиков
58. Скользящие средние и другие трендовые индикаторы
59. Осцилляторы. Сигналы, подаваемые осцилляторами.
60. Виды осцилляторов
61. Подходы к определению параметров индикатора
62. Подходы в анализе японских свечей

3.2 Тестовые задания

1. Задание

Участник рынка, купивший валюту для страхования риска неблагоприятного для себя изменения курса, является:

- инвестором;
- спекулянтом;
- маркет-мейкером;
- хеджером.

2. Задание

Срочные сделки – это:

- мгновенные сделки;
- экстренные сделки, которые необходимо как можно быстрее (срочно) осуществить на рынке в результате возникновения какой-либо ситуации;
- сделки на определенную дату в будущем;
- сделки со сроком поставки $T + 2$.

3. Задание

Покупатель может отказаться от исполнения контракта:

- на рынке спот;
- на рынке опционов;
- на фьючерсном рынке;
- ни на одном из вышеперечисленных рынков.

4. Задание

Фьючерс отличается от форварда тем, что:

- фьючерсы торгуются на бирже, а форварды – на внебиржевом рынке;
- форварды торгуются на бирже, а фьючерсы – на внебиржевом рынке;
- все сделки по форвардам жестко регламентированы, а по фьючерсам — зависят от договоренности сторон;
- от исполнения поставки по фьючерсу можно отказаться, а по форварду — нет.

5. Задание

Дата поставки финансового актива на спотовом рынке:

- в течение 48 часов;
- в течение 24 часов;
- мгновенно;
- дата поставки оговаривается отдельно.

6. Задание

Положительное сальдо торгового баланса страны — это:

- превышение экспорта товаров и услуг над их импортом;
- превышение импорта товаров и услуг над их экспортом;
- превышение объема ввезенного в страну капитала над вывезенным;
- превышение объема вывезенного капитала над ввезенным.

7. Задание

При росте индекса потребительских цен курс национальной валюты:

- укрепляется;
- не изменяется;
- может измениться в любом направлении;
- понижается.

8. Задание

При росте ВВП курс национальной валюты:

- укрепляется;
- может измениться в любом направлении;
- не изменяется;
- понижается.

9. Задание

При росте безработицы инфляция:

- снижается;

- растет;
- может измениться в любом направлении;
- не изменяется.

10. Задание

При росте безработицы курс национальной валюты:

- укрепляется;
- не изменяется;
- может измениться в любом направлении;
- понижается.

11. Задание

Фондовыми индексами США являются:

- NIKKEI;
- DAX;
- FTSE;
- S&P и Dow–Jones.

12. Задание

Динамику курсов акций высокотехнологичных компаний США отражает индекс:

- NIKKEI;
- NASDAQ;
- S&P;
- Dow–Jones.

13. Задание

Основным фондовым индексом Японии является:

- DAX;
- NIKKEI;
- FTSE;
- S&P.

14. Задание

Основным фондовым индексом Великобритании является:

- DAX;
- NIKKEI;
- FTSE;
- S&P.

15. Задание

Основным фондовым индексом Германии является:

- DAX;
- NIKKEI;
- FTSE;
- S&P.

02. Технический анализ

16. Задание

Торговый канал образуется:

- линиями, проведенными через два последних максимума и минимума;
- линией, проведенной через два последних максимума и параллельной ей линией, проведенной через последний минимум;
- линией тренда и параллельной ей линией консолидации;
- двумя горизонтальными линиями, между которыми и находится ценовой график.

17. Задание

Если после энергичного движения рынка появляется разрыв, который не заполняется, то это:

- разрыв прорыва;
- убегающий разрыв;
- разрыв на излете;

- убегающий разрыв или разрыв на излете.

18. Задание

Восходящий тренд — это такое движение цены, когда:

- каждый последующий пик и каждый последующий минимум — выше предыдущего;
- каждый последующий минимум выше предыдущего, а каждый последующий пик — ниже;
- каждый последующий минимум ниже предыдущего, а каждый последующий пик — выше;
- цена растёт.

19. Задание

От чего зависит цвет японской свечи?

- от цены закрытия;
- от максимальной цены;
- от цены открытия и цены закрытия;
- от разницы между максимальной и минимальной ценами.

20. Задание

Цвет японской свечи черный, если:

- цена открытия больше цены закрытия;
- цена закрытия больше цены открытия;
- цена закрытия равна цене открытия;
- максимальная цена равна минимальной цене.

21. Задание

Тело свечи при построении графика японских свечей строится по:

- ценам открытия и закрытия;
- максимальным и минимальным ценам;
- цене открытия и максимальной цене;
- цене закрытия и минимальной цене.

22. Задание

Коэффициенты Фибоначчи используются для определения:

- высоты торгового канала;
- возможного уровня коррекции;
- определения уровня поддержки и сопротивления;
- возможного направления движения цены.

23. Задание

Один цикл по теории Элиота состоит из:

- 5 волн;
- 7 волн;
- 2 волн;
- 8 волн.

24. Задание

В «бычьей фазе» цикла по теории Элиота:

- 3 волны роста и 2 волны коррекции;
- 2 волны роста и 3 волны коррекции;
- 2 волны роста и 1 волна коррекции;
- 1 волна роста и 2 волны коррекции.

25. Задание

Если 12-периодная скользящая средняя ниже 24-периодной скользящей средней и 24-периодная скользящая средняя ниже 48-периодной скользящей средней, то на рынке, вероятнее всего, наблюдается:

- тренд вверх;
- разворот тренда вверх;
- тренд вниз;
- разворот тренда вниз.

26. Задание

Простая скользящая средняя строится как:

- средняя геометрическая цен за определенный промежуток времени;
- средняя арифметическая цен за определенный промежуток времени;
- сумма всех цен за определенный промежуток времени;
- средняя арифметическая первой и последней цены за определенный промежуток времени.

27. Задание

Преимущество экспоненциальной скользящей средней по сравнению с простой в том, что:

- более близкие к текущему моменту котировки являются более значимыми;
- учитываются все данные за анализируемый период;
- характеризует сумму всех цен за определенный промежуток времени;
- ее значение более точно предсказывает будущую цену.

28. Задание

Преимущество взвешенной скользящей средней по сравнению с простой в том, что:

- характеризует сумму всех цен за определенный промежуток времени;
- более близкие к текущему моменту котировки являются более значимыми;
- учитываются все данные за анализируемый период;
- ее значение более точно предсказывает будущую цену.

29. Задание

MACD — это:

- разность медленной и быстрой скользящей средней;
- разность быстрой и медленной скользящей средней;
- разность между ценой скользящей средней;
- разность между скользящей средней и ценой.

30. Задание

Осцилляторы — это рыночные индикаторы, предназначенные:

- для определения длительности текущего тренда;
- для определения момента входа после разворота цены;
- для подтверждения наличия тренда;
- для определения направления тренда.

3.3 Курсовая работа

«Не предусмотрена»

3.4 Контрольная работа

«Не предусмотрена»

3.5 Практические задания текущего контроля

Задание 1.

В таблице приведены цены на гамбургер «Биг Мак» в некоторых странах по данным апрельского (2000) номера журнала The Economist. Исходя из концепции паритета покупательной способности (абсолютный вариант ППС) рассчитать курсы соответствующих валют по отношению к американскому доллару.

Страна	Цена «Биг Мак»	Валюта	Долларовый ППС
США	2,51	USD	
Великобритания	1,90	GBP	
Швейцария	5,90	CHF	
Япония	294	JPY	
Еврорегион:			
Германия	4,99	DEM	
Испания	375	ESP	
Италия	4500	ITL	
Франция	18,5	FRF	
средняя (по 4-м странам)		EUR	

Для определения ППС евро необходимо перевести цены гамбургера в марках, песетах, лирах и франках в евро (фиксированные курсы этих валют к евро приведены в таблице ниже). Полученные четыре цены гамбургера усреднить и использовать для вычисления ППС евро к доллару США. Очень полезно сравнить найденные ППС-курсы четырех валют (GBP, CHF, JPY, EUR) с реальными рыночными курсами на тот же период времени.

Курсы валют к евро

Валюта	Единиц за евро
Немецкая марка	1,95583
Французский франк	6,55957
Итальянская лира	1936,21
Испанская песета	166,386
Португальский эскудо	200,482
Финская марка	5,94573
Ирландский фунт	0,787564
Бельгийский / Люксембургский франк	40,3399
Голландский гульден	2,20371
Австрийский шиллинг	13,7603

Задание 2.

В таблице представлены условные данные по росту цен за период в полгода и год, соответствующие четырем основным валютам (американский доллар, британский фунт, евро, японская иена). Исходя из этих процентных величин изменения цен, найти ожидаемые изменения курсов этих валют по отношению друг к другу за каждый из указанных периодов в соответствии с формулой относительного варианта паритета покупательной способности.

Страна	Полгода, %	Год, %
USA	1,70	2,05
UK	1,65	1,96
EU-11	1,1	1,35
Japan	0,80	0,95

Результаты привести в виде таблицы, верхняя половина которой должна содержать рассчитанные по формуле относительного ППС процентные изменения δS курсов валют по отношению друг к другу за полугодие, а в нижней половине представить результаты расчета по данным об изменении цен за год. Курсы валют по отношению друг к другу определяются в принятой на рынке FOREX форме: количество долларов за фунт, долларов за евро, иен за доллар, фунтов за евро, иен за фунт, иен за евро.

δS	Доллар	Фунт	Евро	Иена
Доллар	–			
Фунт		–		
Евро			–	
Иена				–

Задание 3.

В таблице приведены условные данные по росту денежной массы (в процентах) для четырех валют за некоторый период времени. Дайте оценку относительных изменений обменных курсов, обусловленных ростом денежной массы, для следующих пар валют: GBP/USD, EUR/USD, USD/JPY, EUR/GBP, GBP/JPY, EUR/JPY.

	δM
Доллар	8,0
Фунт	1,5
Евро	4,5
Иена	0,5

Задание 4.

В таблице приведены номинальные ставки и инфляция по основным валютам. Необходимо по формуле, связывающей реальную процентную ставку с номинальной ставкой и инфляцией, найти реальные процентные ставки по американскому доллару, британскому фунту, евро и японской иене.

Страна	Номинальные ставки	Инфляция	Реальные ставки
USA	6,5	2,05	
UK	6,5	1,96	
EU-11	4,5	1,35	
Japan	1,0	0,95	

3.6 Практические задания промежуточной аттестации

Задание 1.

Произвести расчет кредитного плеча по отношению к депозиту при следующих данных: депозит 2500 долларов, лот 1 = 0,03; лот 2 = 0,1.

Задание 2.

Произвести расчет стоимости 1 пункта по паре USD/CHF при лоте 0,08 и текущем курсе 1,2883.

Задание 3.

Фигура «голова и плечи» в основании. Высота от линии экстремума «головы» до «линии шеи» равна 152 пунктам. Определить целевой ориентир, если точка пробоя «линии шеи» равна 0,9850.

Задание 4.

Цена швейцарского франка изменилась с 1,7498 до 1,8048. Определите 38% и 62% уровни возможного отката (уровни Фибоначчи).

Методические материалы, определяющие процедуру оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций

4.1 Положение о формах, периодичности и порядке проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся: Положение о текущем контроле успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся П ВГАУ 1.1.01 – 2017, Положение о фонде оценочных средств П ВГАУ 1.1.13 – 2016.

4.2 Методические указания по проведению текущего контроля

1.	Сроки проведения текущего контроля	На практических занятиях
2.	Место и время проведения текущего контроля	В учебной аудитории в течение практического занятия
3.	Требования к техническому оснащению аудитории	в соответствии с ОПОП и рабочей программой
4.	Ф.И.О. преподавателя (ей), проводящих процедуру контроля	Пшеничников В.В.
5.	Вид и форма заданий	Собеседование
6.	Время для выполнения заданий	в течение занятия
7.	Возможность использования дополнительных материалов.	Обучающийся может пользоваться дополнительными материалами
8.	Ф.И.О. преподавателя (ей), обрабатывающих результаты	Пшеничников В.В.
9.	Методы оценки результатов	Экспертный
10.	Предъявление результатов	Оценка выставляется в журнал/доводится до сведения обучающихся в течение занятия
11.	Апелляция результатов	В порядке, установленном нормативными документами, регулирующими образовательный процесс в Воронежском ГАУ

4.3 Ключи (ответы) к контрольным заданиям, материалам, необходимым для оценки знаний

Ответы выделены знаком «☑» в разделе 3.2.