

Министерство сельского хозяйства Российской Федерации

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

**«ВОРОНЕЖСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АГРАРНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИМЕНИ ИМПЕРАТОРА ПЕТРА I»**

УТВЕРЖДАЮ

Декан экономического факультета

 А.Н. Черных

«21» мая 2024г.



РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Б1.В.24 Фундаментальный и технический анализ финансовых рынков

Направление подготовки **38.03.01 Экономика**

Направленность (профиль) **Финансы и кредит**

Квалификация выпускника **бакалавр**

Факультет **экономический**

Кафедра **финансов и кредита**

Преподаватель, подготовивший рабочую программу:
доцент кафедры финансов и кредита

Толстолуцкий Роман Олегович



Рабочая программа составлена в соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования - бакалавриат по направлению подготовки 38.03.01 Экономика (Приказ Министерства науки и высшего образования РФ от 12 августа 2020 г. N 954).

Рабочая программа утверждена на заседании кафедры финансов и кредита (протокол № 10 от 20.05.2024 г.)

Заведующий кафедрой



Агибалов А.В.

Рабочая программа рекомендована к использованию в учебном процессе методической комиссией экономического факультета (протокол № 9 от 21.05.2024 г.).

Председатель методической комиссии



Л.В.Брянцева

Рецензент: финансовый директор АО Управляющая компания ЭФКО Мезенов
П.В.

1. Общая характеристика дисциплины

1.1. Цель изучения дисциплины

Ознакомить студентов с теоретическими и методическими подходами к исследованию финансовых рынков; обучить их практическим приемам анализа и оценки рисков, ликвидности и стоимости финансовых активов на основе выявления закономерностей в ценовой динамике предшествующих периодов, а также изучения факторов, определяющих текущую и перспективную рыночную конъюнктуру.

1.2. Задачи изучения дисциплины

- изучение основных макроэкономических и отраслевых индикаторов статистики, оказывающих существенное влияние на цену финансовых активов;
- научиться оценивать и использовать в своей работе влияние макроэкономических факторов на поведение финансового рынка;
- овладение навыками графического и математического анализа финансовых инструментов;
- исследование инструментов денежно-кредитной и валютной политики центральных банков и характера их влияния на финансовые рынки.

1.3. Предмет дисциплины

Тенденции в динамике цен финансовых активов.

1.4. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Данная дисциплина относится к части, формируемой участниками образовательных отношений.

1.5. Взаимосвязь с другими дисциплинами

Дисциплина связана с изучением таких дисциплин, как Б1.О.12 Макроэкономика, Б1.О.22 Статистика, Б1.О.25 Экономический анализ, Б1.В.19 Финансовые рынки и институты.

2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Компетенция		Индикатор достижения компетенции	
Код	Название	Код	Содержание
ПК-4	Способен консультировать клиентов по использованию финансовых продуктов и услуг	Н6	мониторинга информационных источников финансовой информации
		Н7	анализа состояния и прогнозирование изменений инвестиционного и информационного рынков
		У8	производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг
		35	методы экономической диагностики рынка финансовых услуг

Обозначение в таблице: З – обучающийся должен знать; У – обучающийся должен уметь; Н – обучающийся должен иметь навыки и (или) опыт деятельности.

3. Объем дисциплины и виды учебной работы

3.1. Очная форма обучения

Показатели	Семестр	Всего
	8	
Общая трудоёмкость, з.е./ч	3 / 108	3 / 108
Общая контактная работа, ч	40,15	40,15
Общая самостоятельная работа, ч	67,85	67,85
Контактная работа при проведении учебных занятий, в т.ч. (ч)	40,00	40,00
лекции	14	14,00
практические-всего	26	26,00
Самостоятельная работа при проведении учебных занятий, ч	59,00	59,00
Контактная работа при проведении промежуточной аттестации обучающихся, в т.ч. (ч)	0,15	0,15
зачет	0,15	0,15
Самостоятельная работа при промежуточной аттестации, в т.ч. (ч)	8,85	8,85
подготовка к зачету	8,85	8,85
Форма промежуточной аттестации	зачет	зачет

3.2. Очно-заочная форма обучения

Показатели	Семестр	Всего
	9	
Общая трудоёмкость, з.е./ч	3 / 108	3 / 108
Общая контактная работа, ч	22,15	22,15
Общая самостоятельная работа, ч	85,85	85,85
Контактная работа при проведении учебных занятий, в т.ч. (ч)	22,00	22,00
лекции	8	8,00
практические-всего	14	14,00
Самостоятельная работа при проведении учебных занятий, ч	77,00	77,00
Контактная работа при проведении промежуточной аттестации обучающихся, в т.ч. (ч)	0,15	0,15
зачет	0,15	0,15
Самостоятельная работа при промежуточной аттестации, в т.ч. (ч)	8,85	8,85
подготовка к зачету	8,85	8,85
Форма промежуточной аттестации	зачет	зачет

4. Содержание дисциплины

4.1. Содержание дисциплины в разрезе разделов и подразделов

Раздел 1. Фундаментальный анализ

Подраздел 1.1. Фундаментальные новости и их влияние на динамику финансового рынка: понятие и виды фундаментальных новостей; цикл жизни фундаментальных факторов; значения фундаментальных показателей и уточненные значения фундаментальных индикаторов; политика, кризисные и природные явления; экономические циклы.

Подраздел 1.2. Макроэкономические индикаторы: валовой внутренний продукт; инфляционные показатели (виды инфляции, типы инфляции, измерение инфляции); средняя почасовая заработная плата; индекс стоимости рабочей силы; стоимость рабочей силы на единицу выпущенной продукции; средняя заработная плата за неделю; показатели рынка труда (уровень безработицы, численность работников, определяемая по платежным ведомостям (за исключением сельскохозяйственных рабочих), средняя рабочая неделя, статистика рынка труда, самостоятельная занятость, индекс потребности в рабочей силе, обращение за пособием по безработице, первоначальные обращения за пособием по безработице); показатели производственного сектора (индикатор промышленного производства, загруженность производственных мощностей, заказы промышленности, заказы на товары длительного пользования, коммерческие, или торговые, запасы, товарные запасы на складах оптовой торговли, индекс производительности и затрат); показатели международной торговли (баланс текущих операций (платежный баланс), торговый баланс, бюджетные показатели (государственный бюджет, бюджет Казначейства (баланс казначейского бюджета); индикаторы потребительского спроса (жилищное строительство и рынок жилья, разрешения на строительство новых домов, строительство новых домов и разрешения на строительство, продажи нового жилья, продажи жилья на вторичном рынке недвижимости, затраты на строительство); показатели розничной торговли (розничные продажи, продажи грузовых и легковых автомобилей, продажи автомобилей, еженедельный обзор розничных продаж «Рэдбук»); доходы населения (персональный доход, личные расходы (потребление), потребительский кредит), индексы настроения потребителя (индекс ожиданий потребителей, индекс уверенности потребителей, INSEE); индикаторы делового цикла (опережающий экономический индикатор); индексы делового оптимизма (ISM (NAPM), PMI — Индекс делового оптимизма (США), индекс деловой активности, индекс Чикагского управления по закупкам, индекс деловой активности Федерального резервного банка в Атланте, индекс деловой активности Федерального резервного банка Филадельфии, Empire State Manufacturing Survey, индекс APICS — APICS Business Outlook Index, индексы делового оптимизма других стран); календарь экономических событий.

Раздел 2. Технический анализ

Подраздел 2.1. Позиции, сделки, ордера: торговая позиция, цены покупки и продажи — BID и ASK, пункт, усиление и ослабление валют данной валютной пары, способы открытия и закрытия позиций, типы ордеров по отношению к итогам сделки, технологические типы ордеров, расчет результата сделок, учет спреда при выставлении ордеров, операции с открытой позицией.

Подраздел 2.2. Технический анализ, формы представления данных о ценах, графические фигуры: определение и постулаты, графические и математические методы прогнозирования цен

Подраздел 2.3. Формы представления данных о ценах

Подраздел 2.4. Тренды, линии, уровни: определения; свойства уровней, линий и трендов

Подраздел 2.5. Разрывы

Подраздел 2.6. Перелом

Подраздел 2.7. Разворотные фигуры (фигуры перелома): принципы формирования разворотных фигур, фигура «голова и плечи» (head and shoulders, H&S), кратные вершины и основания, неудавшийся размах, закругленные вершины и основания, расширяющаяся

формация, алмазная формация, восходящие и нисходящие треугольники, расширяющийся треугольник, клин, веерный принцип.

Подраздел 2.8. Фигуры продолжения тенденции: симметричный треугольник, восходящий треугольник, нисходящий треугольник, расширяющийся треугольник, вымпел, флаг, клин, прямоугольник, отмеренный ход.

Подраздел 2.9. Волновая теория Элиота

Подраздел 2.10. Пропорции Фибоначчи в анализе рыночных графиков

Подраздел 2.11. Трендовые индикаторы и осцилляторы, японские свечи: трендовые индикаторы (определение, скользящие средние, другие трендовые индикаторы); осцилляторы (сигналы, подаваемые осцилляторами, виды осцилляторов); подходы к определению параметров индикатора; подходы в анализе японских свечей.

Распределение контактной и самостоятельной работы при подготовке к занятиям по подразделам

Очная форма обучения

Разделы, подразделы дисциплины	Контактная работа		СР
	лекции	ПЗ	
Раздел 1. Фундаментальный анализ	4	12	30
Раздел 2. Технический анализ	10	14	29
Всего	14	26	59

Очно-заочная форма обучения

Разделы, подразделы дисциплины	Контактная работа		СР
	лекции	ПЗ	
Раздел 1. Фундаментальный анализ	4	6	38
Раздел 2. Технический анализ	4	8	39
Всего	8	14	77

4.2. Перечень тем и учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся

№ п/п	Разделы, подразделы дисциплины	Учебно-методическое обеспечение	Объём часов СР	
			очная	очно-заочная
Раздел 1. Фундаментальный анализ				
1.	Международный финансовый рынок в современной глобальной экономике	Звонова Е. А. Международный финансовый рынок [электронный ресурс]: Учебное пособие / Е. А. Звонова, В. К. Бурлачков, В. А. Галанов, В. А. Слепов; Российский экономический университет им. Г.В. Плеханова - Москва: Издательство "Магистр", 2018 - 368 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] — Глава 2, с. 45-49	2,5	3
2.	Валютный сектор международного финансового рынка	Звонова Е. А. Международный финансовый рынок [электронный ресурс]: Учебное пособие / Е. А. Звонова, В. К. Бурлачков, В. А. Галанов, В. А. Слепов; Российский экономический университет им. Г.В. Плеханова - Москва: Издательство "Магистр", 2018 - 368 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] — Глава 3, с. 50-85	2,5	3

№ п/п	Разделы, подразделы дисциплины	Учебно-методическое обеспечение	Объём часов СР	
			очная	очно-заочная
3.	Международный кредитный рынок	Звонова Е. А. Международный финансовый рынок [электронный ресурс]: Учебное пособие / Е. А. Звонова, В. К. Бурлачков, В. А. Галанов, В. А. Слепов; Российский экономический университет им. Г.В. Плеханова - Москва: Издательство "Магистр", 2018 - 368 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] — Глава 4, с. 94-130	2,5	3
4.	Суверенные долги на международном финансовом рынке	Звонова Е. А. Международный финансовый рынок [электронный ресурс]: Учебное пособие / Е. А. Звонова, В. К. Бурлачков, В. А. Галанов, В. А. Слепов; Российский экономический университет им. Г.В. Плеханова - Москва: Издательство "Магистр", 2018 - 368 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] — Глава 4, с. 111-119	2,5	3
5.	Международный фондовый рынок	Звонова Е. А. Международный финансовый рынок [электронный ресурс]: Учебное пособие / Е. А. Звонова, В. К. Бурлачков, В. А. Галанов, В. А. Слепов; Российский экономический университет им. Г.В. Плеханова - Москва: Издательство "Магистр", 2018 - 368 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] — Глава 4, с. 94-126— Глава 5, с. 131-166	2,5	3
6.	Международный рынок инвестиций	Звонова Е. А. Международный финансовый рынок [электронный ресурс]: Учебное пособие / Е. А. Звонова, В. К. Бурлачков, В. А. Галанов, В. А. Слепов; Российский экономический университет им. Г.В. Плеханова - Москва: Издательство "Магистр", 2018 - 368 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум]	2,5	3
7.	Международный рынок страхования	Каячев Г. Ф. Финансовые рынки и институты [электронный ресурс]: Учебное пособие / Г. Ф. Каячев, Л. В. Каячева - Красноярск: Сибирский федеральный университет, 2011 - — Глава 6, с. 102-136.	2,5	3
8.	Современный международный рынок золота	Каячев Г. Ф. Финансовые рынки и институты [электронный ресурс]: Учебное пособие / Г. Ф. Каячев, Л. В. Каячева - Красноярск: Сибирский федеральный университет, 2011 - — Глава 6, с. 102-136.	2,5	3
9.	Международный рынок производных финансовых инструментов	Галанов В. А. Производные финансовые инструменты [электронный ресурс]: Учебник / В. А. Галанов - Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2024 - 221 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум]	2,5	3
10.	Секьюритизация на международном финансовом рынке	Каячев Г. Ф. Финансовые рынки и институты [электронный ресурс]: Учебное пособие / Г. Ф. Каячев, Л. В. Каячева - Красноярск: Сибирский федеральный университет, 2011 - — Глава 6, с. 169-200.	2,5	3
11.	Система рисков на международном финансовом рынке	Каячев Г. Ф. Финансовые рынки и институты [электронный ресурс]: Учебное пособие / Г. Ф. Каячев, Л. В. Каячева - Красноярск: Сибирский федеральный университет, 2011 - — Глава 6, с. 169-200.	2,5	4

№ п/п	Разделы, подразделы дисциплины	Учебно-методическое обеспечение	Объём часов СР	
			очная	очно-заочная
12.	Платежная инфраструктура международного финансового рынка	Каячев Г. Ф. Финансовые рынки и институты [электронный ресурс]: Учебное пособие / Г. Ф. Каячев, Л. В. Каячева - Красноярск: Сибирский федеральный университет, 2011 - — Глава 1-3, с. 10-41.	2,5	4
Раздел 2. Технический анализ				
13.	Тренды, линии, уровни	Мэрфи Д. Технический анализ фьючерсных рынков: Теория и практика [электронный ресурс]: Аспирантура / Д. Мэрфи - Москва: ООО "Альпина Паблишер", 2016 -. — Глава 3, 4, с. 55-127	2,5	3,5
14.	Разрывы	Мэрфи Д. Технический анализ фьючерсных рынков: Теория и практика [электронный ресурс]: Аспирантура / Д. Мэрфи - Москва: ООО "Альпина Паблишер", 2016 -. — Глава 5, с. 128-163.	2,5	3,5
15.	Перелом	Мэрфи Д. Технический анализ фьючерсных рынков: Теория и практика [электронный ресурс]: Аспирантура / Д. Мэрфи - Москва: ООО "Альпина Паблишер", 2016 -. — Глава 5, с. 128-163.	2,5	3,5
16.	Разворотные фигуры (фигуры перелома)	Мэрфи Д. Технический анализ фьючерсных рынков: Теория и практика [электронный ресурс]: Аспирантура / Д. Мэрфи - Москва: ООО "Альпина Паблишер", 2016 -. — Глава 5, с. 128-163.	2,5	3,5
17.	Фигуры продолжения тенденции	Мэрфи Д. Технический анализ фьючерсных рынков: Теория и практика [электронный ресурс]: Аспирантура / Д. Мэрфи - Москва: ООО "Альпина Паблишер", 2016 - — Глава 6, 164-204.	2,5	3,5
18.	Волновая теория Элиота	Мэрфи Д. Технический анализ фьючерсных рынков: Теория и практика [электронный ресурс]: Аспирантура / Д. Мэрфи - Москва: ООО "Альпина Паблишер", 2016 -. — Глава 13, с. 418-464	2,5	3,5
19.	Пропорции Фибоначчи в анализе рыночных графиков	Мэрфи Д. Технический анализ фьючерсных рынков: Теория и практика [электронный ресурс]: Аспирантура / Д. Мэрфи - Москва: ООО "Альпина Паблишер", 2016 -. — Глава 13, с. 418-464	2,5	3,5
20.	Трендовые индикаторы	Мэрфи Д. Технический анализ фьючерсных рынков: Теория и практика [электронный ресурс]: Аспирантура / Д. Мэрфи - Москва: ООО "Альпина Паблишер", 2016 -. — Глава 9, 10, с. 266-366.	2,5	3,5

№ п/п	Разделы, подразделы дисциплины	Учебно-методическое обеспечение	Объём часов СР	
			очная	очно-заочная
21.	Осцилляторы	Мэрфи Д. Технический анализ фьючерсных рынков: Теория и практика [электронный ресурс]: Аспирантура / Д. Мэрфи - Москва: ООО "Альпина Паблишер", 2016 -. — Глава 9, 10, с. 266-366.	2,5	3,5
22.	Подходы к определению параметров индикатора	Мэрфи Д. Технический анализ фьючерсных рынков: Теория и практика [электронный ресурс]: Аспирантура / Д. Мэрфи - Москва: ООО "Альпина Паблишер", 2016 -. — Глава 9, 10, с. 266-366.	2,5	3,5
23.	Подходы в анализе японских свечей	Мэрфи Д. Технический анализ фьючерсных рынков: Теория и практика [электронный ресурс]: Аспирантура / Д. Мэрфи - Москва: ООО "Альпина Паблишер", 2016 -. — Глава 9, 10, с. 266-366.	4,0	4
Всего			59	77

5. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации и текущего контроля

5.1. Этапы формирования компетенций

Разделы, подразделы дисциплины	Компетенции и ИД
	ПК-4
Раздел 1. Финансовый рынок и его роль в финансировании экономики	35, У8, Н6
Раздел 2. Фундаментальные понятия рынка ценных бумаг	35, У8, Н7

5.2. Шкалы и критерии оценивания достижения компетенций

5.2.1. Шкалы оценивания достижения компетенций

Вид оценки	Оценки			
Академическая оценка по 4-х балльной шкале	неудовлетворительно	удовлетворительно	хорошо	отлично

Вид оценки	Оценки	
Академическая оценка по 2-х балльной шкале	не зачтено	зачтено

5.2.2. Критерии оценивания достижения компетенций

Критерии оценки на экзамене

Оценка, уровень достижения компетенций	Описание критериев
Отлично, высокий	Студент показал полные и глубокие знания программного материала, логично и аргументировано ответил на все вопросы экзаменационного билета, а также на дополнительные вопросы, способен самостоятельно решать сложные задачи дисциплины

Хорошо, продвинутый	Студент твердо знает программный материал, грамотно его излагает, не допускает существенных неточностей в ответе, достаточно полно ответил на вопросы экзаменационного билета и дополнительные вопросы, способен самостоятельно решать стандартные задачи дисциплины
Удовлетворительно, пороговый	Студент показал знание только основ программного материала, усвоил его поверхностно, но не допускал грубых ошибок или неточностей, требует наводящих вопросов для правильного ответа, не ответил на дополнительные вопросы, способен решать стандартные задачи дисциплины с помощью преподавателя
Неудовлетворительно, компетенция не освоена	Студент не знает основ программного материала, допускает грубые ошибки в ответе, не способен решать стандартные задачи дисциплины даже с помощью преподавателя

Критерии оценки на зачете

Оценка, уровень достижения компетенций	Описание критериев
Зачтено, высокий	Студент выполнил все задания, предусмотренные рабочей программой, отчитался об их выполнении, демонстрируя отличное знание освоенного материала и умение самостоятельно решать сложные задачи дисциплины
Зачтено, продвинутый	Студент выполнил все задания, предусмотренные рабочей программой, отчитался об их выполнении, демонстрируя хорошее знание освоенного материала и умение самостоятельно решать стандартные задачи дисциплины
Зачтено, пороговый	Студент выполнил все задания, предусмотренные рабочей программой, отчитался об их выполнении, демонстрируя знание основ освоенного материала и умение решать стандартные задачи дисциплины с помощью преподавателя
Не зачтено, компетенция не освоена	Студент выполнил не все задания, предусмотренные рабочей программой или не отчитался об их выполнении, не подтверждает знание освоенного материала и не умеет решать стандартные задачи дисциплины даже с помощью преподавателя

Критерии оценки тестов

Оценка, уровень достижения компетенций	Описание критериев
Отлично, высокий	Содержание правильных ответов в тесте не менее 90%
Хорошо, продвинутый	Содержание правильных ответов в тесте не менее 75%
Удовлетворительно, пороговый	Содержание правильных ответов в тесте не менее 50%
Неудовлетворительно, компетенция не освоена	Содержание правильных ответов в тесте менее 50%

Критерии оценки устного опроса

Оценка, уровень достижения компетенций	Описание критериев
Зачтено, высокий	Студент демонстрирует уверенное знание материала, четко выражает свою точку зрения по рассматриваемому вопросу, приводя соответствующие примеры

Зачтено, продвинутый	Студент демонстрирует уверенное знание материала, но допускает отдельные погрешности в ответе
Зачтено, пороговый	Студент демонстрирует существенные пробелы в знаниях материала, допускает ошибки в ответах
Не зачтено, компетенция не освоена	Студент демонстрирует незнание материала, допускает грубые ошибки в ответах

Критерии оценки решения задач

Оценка, уровень достижения компетенций	Описание критериев
Зачтено, высокий	Студент уверенно знает методику и алгоритм решения задачи, не допускает ошибок при ее выполнении.
Зачтено, продвинутый	Студент в целом знает методику и алгоритм решения задачи, не допускает грубых ошибок при ее выполнении.
Зачтено, пороговый	Студент в целом знает методику и алгоритм решения задачи, допускает ошибок при ее выполнении, но способен исправить их при помощи преподавателя.
Не зачтено, компетенция не освоена	Студент не знает методику и алгоритм решения задачи, допускает грубые ошибки при ее выполнении, не способен исправить их при помощи преподавателя.

5.3. Материалы для оценки достижения компетенций

5.3.1. Оценочные материалы промежуточной аттестации

5.3.1.1. Вопросы к зачету

№	Содержание	Компетенция	ИД
1	Понятие и виды фундаментальных новостей. Цикл жизни фундаментальных факторов	ПК-4	35
2	Значения фундаментальных показателей и уточненные значения фундаментальных индикаторов	ПК-4	35
3	Политика, кризисные и природные явления, их влияние на финансовые рынки	ПК-4	35
4	Экономические циклы и их влияние на финансовые рынки	ПК-4	35
5	Валовой внутренний продукт	ПК-4	35
6	Инфляционные показатели	ПК-4	35
7	Показатели рынок труда	ПК-4	35
8	Показатели производственного сектора	ПК-4	35
9	Показатели международной торговли	ПК-4	35
10	Бюджетные показатели	ПК-4	35
11	Индикаторы потребительского спроса	ПК-4	35
12	Показатели розничной торговли	ПК-4	35
13	Доходы населения и их индикаторы	ПК-4	35
14	Индексы настроения потребителя	ПК-4	35
15	Индикаторы делового цикла	ПК-4	35
16	Индексы делового оптимизма	ПК-4	35
17	Календарь экономических событий	ПК-4	35
18	Торговая позиция	ПК-4	35
19	Цены покупки и продажи — BID и ASK	ПК-4	35
20	Усиление и ослабление валют данной валютной пары	ПК-4	35
21	Способы открытия и закрытия позиций	ПК-4	35
22	Типы ордеров по отношению к итогам сделки	ПК-4	35
23	Технологические типы ордеров	ПК-4	35
24	Расчет результата сделок	ПК-4	35
25	Учет спреда при выставлении ордеров	ПК-4	35
26	Операции с открытой позицией	ПК-4	35

27	Технический анализ — определение и постулаты	ПК-4	35
28	Технический анализ как методы прогнозирования цен	ПК-4	35
29	Графические методы прогнозирования цен	ПК-4	35
30	Математические методы прогнозирования цен	ПК-4	35
31	Формы представления данных о ценах	ПК-4	35
32	Тренды, линии, уровни	ПК-4	35
33	Разрывы	ПК-4	35
34	Перелом тренда	ПК-4	35
35	Разворотные фигуры (фигуры перелома) и принципы формирования разворотных фигур	ПК-4	35
36	Фигура «голова и плечи» (head and shoulders, H&S)	ПК-4	35
37	Кратные вершины и основания	ПК-4	35
38	Неудавшийся размах	ПК-4	35
39	Закругленные вершины и основания	ПК-4	35
40	Расширяющаяся формация	ПК-4	35
41	Алмазная формация	ПК-4	35
42	Восходящие и нисходящие треугольники	ПК-4	35
43	Расширяющийся треугольник	ПК-4	35
44	Клин	ПК-4	35
45	Веерный принцип	ПК-4	35
46	Фигуры продолжения тенденции	ПК-4	35
47	Симметричный треугольник	ПК-4	35
48	Восходящий треугольник	ПК-4	35
49	Нисходящий треугольник	ПК-4	35
50	Расширяющийся треугольник	ПК-4	35
51	Вымпел	ПК-4	35
52	Флаг	ПК-4	35
53	Клин	ПК-4	35
54	Прямоугольник	ПК-4	35
55	Отмеренный ход	ПК-4	35
56	Волновая теория Эллиота	ПК-4	35
57	Пропорции Фибоначчи в анализе рыночных графиков	ПК-4	35
58	Скользящие средние и другие трендовые индикаторы	ПК-4	35
59	Осцилляторы. Сигналы, подаваемые осцилляторами.	ПК-4	35
60	Виды осцилляторов	ПК-4	35
61	Подходы к определению параметров индикатора	ПК-4	35
62	Подходы в анализе японских свечей	ПК-4	35

5.3.1.2. Задачи к зачету

№	Содержание	Компетенция	ИД
1	В таблице приведены цены на гамбургер «Биг Мак» в некоторых странах по данным на январь 2017 года. Исходя из концепции паритета покупательной способности (абсолютный вариант ППС) рассчитать курсы соответствующих валют по отношению к американскому доллару(на январь 2017 г.). Укажите местную валюту. Сравните курсы валют и соотношение стоимости	ПК-4	Н6, У8
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. 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.	ПК-4	Н6, У8

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.	ПК-4	Н6, У8
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.	ПК-4	Н6, У8
5	Произвести расчет кредитного плеча по отношению к депозиту при следующих данных: депозит 2500 долларов, лот 1 = 0,03; лот 2 = 0,1.	ПК-4	Н7, У8
6	Произвести расчет стоимости 1 пункта по паре USD/CHF при лоте 0,08 и текущем курсе 1,2883.	ПК-4	Н7, У8
7	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.	ПК-4	Н7, У8
8	Цена швейцарского франка изменилась с 1,7498 до 1,8048. Определите 38% и 62% уровни возможного отката (уровни Фибоначчи).	ПК-4	Н7, У8

5.3.2. Оценочные материалы текущего контроля

5.3.2.1. Вопросы тестов

№	Содержание	Компетенция	ИД
1	Макроэкономический показатель, отражающий рыночную стоимость всех конечных товаров и услуг (то есть предназначенных для непосредственного употребления, использования или применения), произведённых за год во всех отраслях экономики на территории конкретного государства для потребления, экспорта и накопления, вне зависимости от национальной принадлежности использованных факторов производства - это: (?) Валовая добавленная стоимость / Gross value added (GVA) (?) Валовой национальный продукт / Gross national product (GNP) (!) Валовой внутренний продукт / Gross domestic product (GDP) (?) Совокупный общественный продукт / Gross social product (GSP)	ПК-4	35
2	Отношение номинального ВВП к реальному ВВП называют: (?) стагнатором (?) мультипликатором (!) дефлятором (?) инфлятором	ПК-4	35
3	ВВП (GDP) по доходам определяется по формуле: (!) ВВП = заработная плата + арендная плата + процентные платежи + прибыль корпораций + амортизация + косвенные налоги — субсидии — чистый факторный доход из-за границы (?) ВВП = заработная плата + прибыль корпораций + амортизация + косвенные налоги — субсидии — чистый факторный доход из-за границы (?) ВВП = заработная плата + арендная плата + процентные платежи + прибыль корпораций — субсидии — чистый факторный доход из-за границы (?) ВВП = заработная плата + арендная плата + процентные платежи + прибыль корпораций + амортизация	ПК-4	35
4	ВВП (GDP) по расходам (по использованию) определяется по формуле: (?) ВВП = заработная плата (L) + арендная плата (R) + процентные платежи (P) + амортизация (A) (?) ВВП = конечное потребление (C) + валовое накопление капитала [инвестиции (I)] + амортизация (A) + государственные расходы (G) + чистый экспорт X_n [экспорт (Ex) – импорт (Im)] (?) ВВП = конечное потребление (C) + валовое накопление капитала [инвестиции	ПК-4	35

№	Содержание	Компетенция	ИД
	(I)] + амортизация (A) + рента (R) + государственные расходы (G) + чистый экспорт X_n [экспорт (Ex) – импорт (Im)] (!) ВВП = конечное потребление (C) + валовое накопление капитала [инвестиции (I)] + государственные расходы (G) + чистый экспорт X_n [экспорт (Ex) – импорт (Im)]		
5	ВВП (GDP) по добавленной стоимости (производственный метод) определяется по формуле: (?) ВВП = валовая добавленная стоимость (GVA) (!) ВВП = валовая добавленная стоимость (GVA) + косвенные налоги (T) — субсидии (F) (?) ВВП = валовая добавленная стоимость (GVA) — косвенные налоги (T) + субсидии (F) (?) ВВП = валовая добавленная стоимость (GVA) + амортизация (A) + косвенные налоги (T) — субсидии (F)	ПК-4	35
6	Чем больше отношение ВВП по паритету покупательной способности к величине номинального ВВП, тем: (?) более богатой является экономика (в терминах номинального ВВП на душу населения) (!) более бедной является экономика (в терминах номинального ВВП на душу населения) (?) не прослеживается зависимости между рейтингом страны в ранжированном списке ВВП на душу населения и паритетом покупательной способности	ПК-4	35
7	Сбережения в закрытой экономике равны: (?) сумме амортизации и ренты (?) потреблению (!) инвестициям (?) сумме арендных плат и процентных платежей	ПК-4	35
8	Вывоз капитала из страны в терминах макроэкономических показателей означает: (?) положительный чистый экспорт (Net exports) (?) отрицательный чистый экспорт (Net exports) (!) положительное сальдо счета текущих операций (Current account) (?) отрицательное сальдо счета текущих операций (Current account) (?) положительное сальдо счета движения капитала (Capital account)	ПК-4	35
9	В случае варианта закрытой экономики чему равны сбережения в макроэкономическом понимании: (?) разнице между значениями валового внутреннего продукта в отчетном и предшествующем периодах (!) инвестициям (?) сумме инвестиций и сальдо счета текущих операций (?) сумме инвестиций и оттоку капитала	ПК-4	35
10	В случае варианта открытой экономики чему равны сбережения в макроэкономическом понимании: (?) разнице между значениями валового внутреннего продукта в отчетном и предшествующем периодах (?) инвестициям (!) сумме инвестиций и сальдо счета текущих операций (?) сумме частных инвестиций и государственных расходов	ПК-4	35
11	При увеличении реальных процентных ставок объем инвестиций в экономике с высокой долей вероятности: (?) возрастет (!) снизится (?) останется без изменений	ПК-4	35
12	Равновесной ценой на финансовых рынках выступает:	ПК-4	35

№	Содержание	Компетенция	ИД
	(!) реальная процентная ставка (?) номинальная процентная ставка (?) чистая процентная ставка (?) ключевая ставка (?) ставка рефинансирования (?) учетная процентная ставка		
13	Реальная процентная ставка равна:</p> (!) номинальная процентная ставка за вычетом инфляции (?) сумма номинальной процентной ставки и инфляции (?) отношение номинальной процентной ставки к темпу инфляции (?) произведение номинальной процентной ставки и уровня инфляции	ПК-4	35
14	Валовые внутренние сбережения (Gross domestic savings) – это статистический показатель, который не:</p> (?) выражается в денежных единицах или в процентах от ВВП (!) может быть отрицательной величиной (?) рассчитывается как разница между ВВП и совокупным частным и государственным потреблением (?) показывает потенциально возможный объем национальных внутренних и внешних инвестиций	ПК-4	35
15	Валовой товарооборот (Gross trade turnover) - в экономической статистике финансовый показатель, равный:</p> (?) общей рыночной стоимости всех готовых товаров и услуг, произведённых на территории страны в течение года (!) сумме оптового и розничного объема продаж (?) объему розничного товарооборота (retail sales volume) (?) объему оптового товарооборота (wholesaling volume)	ПК-4	35
16	Индекс промышленного производства, Industrial production index (IPI) – это показатель динамики, рассчитываемый как:</p> (?) отношение общей рыночной стоимости всех готовых товаров и услуг, произведённых на территории страны в течение текущего периода, к величине общей рыночной стоимости всех готовых товаров и услуг, произведённых на территории страны в прошлом или базисном периоде (!) отношение объема промышленного производства в отчетном периоде в денежном выражении к объему промышленного производства в предыдущем или базисном периоде (?) отношение объема промышленного производства к общей рыночной стоимости всех готовых товаров и услуг, произведённых на территории страны в течение отчетного периода	ПК-4	35
17	Один из видов индексов цен, созданный для измерения среднего уровня изменения цен на товары и услуги потребительской корзины за определённый период в экономике:</p> (?) индекс бигмака (Big Mac Index) (?) дефлятор ВВП (!) индекс потребительских цен (ИПЦ) / Consumer Price Index (CPI) (?) индекс цен производителей / Producer Price Index (PPI) (?) индекс цен на импорт (Import and Export Price Indexes) (?) индекс базовой инфляции (Core Consumer Price Index / Core CPI)	ПК-4	35
18	При расчете индекса базовой инфляции (Core Consumer Price Index / Core CPI):</p> (?) исключают динамику цен на продукты питания (?) исключают динамику цен на энергоносители (!) исключают динамику цен на продукты питания и энергоносители (?) используют только динамику цен на продукты питания и энергоносители (?) используют только динамику цен на продукты питания (?) используют только динамику цен на продукты энергоносители	ПК-4	35

№	Содержание	Компетенция	ИД
19	Способ определения реального обменного курса валюты, который основан на теории паритета покупательной способности, по которой валютный курс должен уравнивать стоимость корзины товаров в разных странах, построен на использовании: (!) индекса бигмака (Big Mac Index) (?) дефлятора ВВП (?) индекса потребительских цен (ИПЦ) / Consumer Price Index (CPI) (?) индекса цен производителей / Producer Price Index (PPI) (?) индекса цен на импорт (Import and Export Price Indexes) (?) индекса базовой инфляции (Core Consumer Price Index / Core CPI)	ПК-4	35
20	Показатель среднего уровня изменения цен на сырье, материалы и товары промежуточного потребления относительно базисного периода называется: (?) индексом бигмака (Big Mac Index) (?) дефлятором ВВП (?) индексом потребительских цен (ИПЦ) / Consumer Price Index (CPI) (!) индексом цен производителей / Producer Price Index (PPI) (?) индексом цен на импорт (Import and Export Price Indexes) (?) индексом базовой инфляции (Core Consumer Price Index / Core CPI)	ПК-4	35
21	Какой из показателей обладает признаками двойного счета: (?) Валовая добавленная стоимость / Gross value added (GVA) (?) Валовой национальный продукт / Gross national product (GNP) (?) Валовой внутренний продукт / Gross domestic product (GDP) (!) Совокупный общественный продукт / Gross social product (GSP)	ПК-4	35
22	Уровень безработицы (Unemployment rate) определяется, как: (?) отношение количества безработных в отчетном периоде к количеству безработных в прошлом или базисном периоде (?) количество безработных в процентах от населения (!) количество безработных в процентах от рабочей силы (!) количество безработных в процентах от образованного населения (включая выпускников общеобразовательных школ)	ПК-4	35
23	Экономический показатель, полученный на основе ежемесячных опросов компаний частного сектора, – это: (?) Индекс опережающих индикаторов (Leading indicators index / LII) (?) Индекс потребительского настроения (Consumer sentiment index / CSI) (!) Индекс менеджеров по закупкам (Purchasing managers' index / PMI)	ПК-4	35
24	Данные индекса менеджеров по закупкам (Purchasing managers' indexes / PMI) представлены в виде диффузионного индекса, который рассчитывается следующим образом: (?) $PMI = (P1 \times 1) + (P2 \times 2)$, где P1 - процент ответов, сообщающих об улучшении, а P2 – процентное количество ответов, которые сообщили об отсутствии изменений (?) $PMI = (P1 \times 1) + (P2 \times (-1))$, где P1 - процент ответов, сообщающих об улучшении, а P2 – процентное количество ответов, которые сообщили об отсутствии изменений (!) $PMI = (P1 \times 1) + (P2 \times 0,5)$, где P1 - процент ответов, сообщающих об улучшении, а P2 – процентное количество ответов, которые сообщили об отсутствии изменений (?) $PMI = (P1 \times 2) + (P2 \times 1)$, где P1 - процент ответов, сообщающих об улучшении, а P2 – процентное количество ответов, которые сообщили об отсутствии изменений	ПК-4	35
25	Какой из перечисленных индикаторов не относится к числу опережающих индикаторов делового цикла: (?) Average weekly hours (manufacturing) / Среднее количество рабочих часов в неделю (производство) (?) Average weekly initial jobless claims for unemployment insurance / Средние еженедельные первоначальные заявки на пособие по безработице для страхования по безработице (?) Manufacturers' new orders for consumer goods/materials / Новые заказы	ПК-4	35

№	Содержание	Компетенция	ИД
	производителей на потребительские товары/материалы (?) Vendor performance (slower deliveries diffusion index) / Производительность поставщика (индекс распространения более медленных поставок) (?) Manufacturers' new orders for non-defense capital goods / Новые заказы производителей на капитальные товары (?) Building permits / Разрешение на строительство нового частного жилья (?) Stock prices of 500 common stocks / Цены на 500 обыкновенных акций (?) Money Supply (M2) / Денежная масса (M2) (?) Interest rate spread (10-year Treasury vs. Federal Funds target) / Спред процентных ставок (10-летних гособлигаций против ставки ФРС) (?) Index of consumer expectations / Индекс потребительских ожиданий (!) The value of outstanding commercial and industrial loans / Стоимость непогашенных коммерческих и промышленных кредитов		
26	Какой из перечисленных индикаторов не относится к числу запаздывающих индикаторов делового цикла: (?) The average duration of unemployment (inverted) / Средняя продолжительность безработицы (инвертированная) (?) The value of outstanding commercial and industrial loans / Объем непогашенных коммерческих и промышленных долгов (!) Interest rate spread (10-year Treasury vs. Federal Funds target) / Спред процентных ставок (10-летних гособлигаций против ставки ФРС) (?) The change in the Consumer Price Index for services / Изменение индекса потребительских цен на услуги (?) The change in labour cost per unit of output / Изменение стоимости труда на единицу времени (?) The ratio of manufacturing and trade inventories to sales / Отношение производственных и торговых запасов к объему продаж (?) The ratio of consumer credit outstanding to personal income / Отношение непогашенных потребительских кредитов к личным доходам (?) The average prime rate charged by banks / Средняя базовая ставка, взимаемая банками	ПК-4	35
27	Какой из перечисленных индикаторов не относится к числу совпадающих индикаторов, использующихся для определения постфактум дат пиков и спадов в деловом цикле: (?) валовой внутренний продукт (ВВП) / Gross Domestic Product (GDP) (?) индекс промышленного производства (ИПП) / industrial production index (IPI) (?) личный доход / personal income (?) розничные продажи / retail sales (!) денежная масса (M2) / money supply (M2)	ПК-4	35
28	Укажите эмпирическое правило для определения начала рецессии в экономике: (?) индекс промышленного производства менее 100 к уровню предшествующего квартала (?) рост инфляции на 10% в течение двух последовательных кварталов (!) отрицательный рост ВВП два последовательных квартала (?) рост безработицы на 5% в течение двух последовательных кварталов	ПК-4	35
29	Макроэкономические показатели, которые мало или совсем не связаны с деловым циклом: они могут расти или падать, когда в целом дела в экономике идут хорошо, и могут расти или падать, когда дела идут плохо, называются: (?) проциклическими (?) контрциклическими (!) ациклическими	ПК-4	35
30	При инверсивной кривой доходностей активы с длинной дюрацией по сравнению с активами с короткой дюрацией: (?) более доходны (!) менее доходны	ПК-4	35

№	Содержание	Компетенция	ИД
	(?) одинаково доходны		
31	Инвестиционный кредитный рейтинг находится в диапазоне между: (!) AAA и BBB включительно (?) AAA и A включительно (?) CCC и D включительно	ПК-4	35
32	Исходя из формулы цены облигации, ее доходность к погашению равна: (!) ставке дисконтирования (?) коэффициенту Шарпа (?) коэффициенту Бета (?) стандартному отклонению	ПК-4	35
33	Критерии выставления рейтинговой оценки определяются: (?) Эмитентом (!) Рейтинговым агентством (?) Органом государственного регулирования ценных бумаг (?) Инвестором, если он является заказчиком рейтинга	ПК-4	35
34	Вероятность получения положительного или отрицательного результата (выигрыш или потери) называют: (!) спекулятивным риском (?) случайным риском (?) чистым риском (?) системным риском (?) несистемным риском	ПК-4	35
35	Для оценки финансовых рисков, под которыми понимается вероятность неполучения ожидаемой доходности, применяют показатель: (?) волатильное отклонение (!) стандартное отклонение (?) среднегеометрическое отклонение	ПК-4	35
36	Какова вероятность попадания доходности в доверительный интервал по правилу 3 сигм нормального распределения: (!) 99,7% (?) 95,5% (?) 68,3% (?) 50% (?) 33%	ПК-4	35
37	Эффективность инструмента аналогична эффективности рынка, если: (?) Бета = 0 (!) Бета > 0 (?) Бета < 0	ПК-4	35
38	Риск инвестиций ниже, чем в среднем по рынку, если: (?) Бета = 1 (?) Бета > 1 (!) Бета < 1	ПК-4	35
39	Показатель эффективности инвестиционного портфеля (актива), который вычисляется как отношение средней премии за риск к стандартному отклонению портфеля: (!) коэффициент Шарпа (?) коэффициент Сортино (?) коэффициент Трейнора (?) коэффициент Альфа (?) коэффициент Бета (?) коэффициент вариации	ПК-4	35

№	Содержание	Компетенция	ИД
40	Коэффициент Шарпа учитывает следующий вид риска:</p> (!) совокупный риск (?) систематический (?) несистематический (?) риск падения цен	ПК-4	35
41	Уменьшение спреда в биржевой торговле свидетельствует:</p> (?) о росте доходности инструмента (?) о снижении доходности инструмента (!) о росте ликвидности инструмента (?) о снижении ликвидности инструмента	ПК-4	35
42	Вероятность получения отрицательного результата (потери) называют:</p> (?) спекулятивным риском (?) случайным риском (!) чистым риском (?) системным риском (?) несистемным риском	ПК-4	35
43	Для расчета стандартного отклонения:</p> (?) находят корень квадратный из среднего квадрата дисперсии (?) находят корень кубический из дисперсии (!) находят корень квадратный из среднего квадрата отклонений всех значений ряда доходностей от среднеарифметической доходности (?) находят корень квадратный из среднего квадрата отклонений всех отрицательных значений ряда доходностей от среднегеометрической доходности	ПК-4	35
44	Какова вероятность попадания доходности в доверительный интервал по правилу 1 сигмы нормального распределения?</p> (?) 99,7% (?) 95,5% (!) 68,3% (?) 50% (?) 33%	ПК-4	35
45	Для системного риска на рынке ценных бумаг характерно следующее:</p> (?) Системный риск – это риск, связанный с принятием органами государственной власти неэффективных решений в области экономической политики (!) Системный риск – это риск, связанный с падением рынка в целом (?) Системный риск – это риск, обусловленный изменением курса валюты (?) Системный риск – это риск, связанный с вложением в конкретные ценные бумаги	ПК-4	35
46	Показатель, позволяющий оценить доходность и риск инвестиционного инструмента (портфеля или стратегии), в котором вместо волатильности портфеля используется так называемая «волатильность вниз», рассчитываемая по доходностям ниже минимального допустимого уровня доходности портфеля:</p> (?) коэффициент Шарпа (!) коэффициент Сортино (?) коэффициент Трейнора (?) коэффициент Альфа (?) коэффициент Бета (?) коэффициент вариации	ПК-4	35
47	Коэффициент Трейнора учитывает следующий вид риска:</p> (?) совокупный риск (!) систематический (?) несистематический (?) риск падения цен	ПК-4	35

№	Содержание	Компетенция	ИД
48	Классическая портфельная теория Г.Марковица в качестве показателя риска использует: (?) коэффициент Шарпа (?) коэффициент Альфа (?) коэффициент Бэта (?) коэффициент Сортино (?) коэффициент Трейнора (?) коэффициент вариации (!) стандартное отклонение (?) размах вариации	ПК-4	35
49	В случае постоянного или фиксированного купона облигации при снижении процентных ставок выигрывает: (?) эмитент (!) инвестор (?) выигрывают оба (?) оба проигрывают	ПК-4	35
50	Цена облигации тем выше, чем: (!) чаще производятся купонные платежи (?) реже производятся купонные платежи (?) не зависит от частоты купонных платежей По мере приближения даты погашения цена облигации стремится: (!) к номиналу (?) к нулю (?) к максимуму	ПК-4	35
51	Доходность бескупонных облигаций формируется величиной: (?) дисконта (?) мультипликатора (!) дисконта и срока обращения (?) срока обращения (?) мультипликатора и срока обращения	ПК-4	35
52	Показатель, равный отношению капитализации компании к величине ее чистой прибыли: (?) P/C (Price to Capital) (?) P/S (Price to Sales) (!) P/E (Price to Earnings) (?) P/B (Price to Book) (?) P/P (Price to Profit)	ПК-4	35
53	Показатель, равный отношению капитализации компании к валюте ее баланса: (?) P/C (Price to Capital) (?) P/S (Price to Sales) (?) P/E (Price to Earnings) (!) P/B (Price to Book) (?) P/P (Price to Profit)	ПК-4	35
54	Показатель, равный отношению капитализации компании к ее выручке от продаж: (?) P/C (Price to Capital) (!) P/S (Price to Sales) (?) P/E (Price to Earnings) (?) P/B (Price to Book) (?) P/P (Price to Profit)	ПК-4	35
55	DY (Dividend Yield) - дивидендная или текущая доходность, рассчитывается, как:	ПК-4	35

№	Содержание	Компетенция	ИД
	(?) сумма дивидендов за период в расчете на 1 акцию (!) отношение суммы дивидендов, выплаченных компанией за период, к ее текущей капитализации (?) P/D (Price to Dividend) отношение текущей рыночной цены 1 акции к сумме дивидендов, выплаченных компанией за период		
56	TR (Total Return) - общая доходность акции для инвесторов, включая курсовой и дивидендный доход, рассчитывается, как: (?) сумма отношения цен акции на начало и конец периода и полученных за это время дивидендами (!) разность цен акции на конец и начало периода складывается с полученными за это время дивидендами, а затем делится на цену акции в начале периода (?) отношение суммы цены акции на конец периода и выплаченных за период дивидендов на 1 акцию к цене акции на начало периода	ПК-4	35
57	Показатель доходности акционерного капитала (обыкновенных акций) в процентах годовых, рассчитываемый как отношение чистой прибыли за год к величине капитала, принадлежащего владельцам обыкновенных акций: (!) ROE (Return on common Equity) (?) ROA (Return on total Assets) (?) ROS (Return on Sales или Profit Margin)	ПК-4	35
58	Показатель доходности всех активов в процентах годовых, рассчитываемый, как отношение чистой прибыли за период к сумме всех активов: (?) ROE (Return on common Equity) (!) ROA (Return on total Assets) (?) ROS (Return on Sales или Profit Margin)	ПК-4	35
59	Показатель доходности по отношению к объему реализации или рентабельность, в процентах годовых, рассчитываемый как отношение чистой прибыли к объему реализации за год: (?) ROE (Return on common Equity) (!) ROA (Return on total Assets) (?) ROS (Return on Sales или Profit Margin)	ПК-4	35
60	Рентабельность активов ROA (Return On Assets) можно определить, как: (?) произведение чистой прибыли на остаточную стоимость активов (?) отношение выручки от продаж к балансовой стоимости активов (!) произведение рентабельности продаж на коэффициент оборачиваемости активов (?) отношение рыночной стоимости активов к их первоначальной стоимости	ПК-4	35
61	Коэффициент рентабельности продаж ROS (Return On Sales) можно определить, как: (?) отношение чистой прибыли к величине коммерческих расходов (?) произведение чистой прибыли на выручку (?) доля рентабельных продаж в структуре выручки (!) отношение рентабельности активов к коэффициенту их оборачиваемости	ПК-4	35
62	Коэффициент рентабельности собственного капитала ROE (Return On Equity) нельзя определить, как: (?) произведение рентабельности продаж на коэффициент оборачиваемости активов и на коэффициент капитализации (финансового рычага) (?) отношение чистой прибыли к средней величине собственного капитала (?) произведение рентабельности активов на коэффициент капитализации (финансового рычага) (!) отношение рентабельности активов к коэффициенту их оборачиваемости	ПК-4	35
63	Показатель, отражающий стоимость собственных активов предприятия, приходящихся на одну акцию: (!) BV (Book Value per Share) (?) EPS (Earnings per Share)	ПК-4	35

№	Содержание	Компетенция	ИД
	(?) EG (Earnings per Share Growth)		
64	Показатель, отражающий чистая прибыль на одну обыкновенную акцию: (?) BV (Book Value per Share) (!) EPS (Earnings per Share) (?) EG (Earnings per Share Growth)	ПК-4	35
65	Показатель, отражающий рост объема реализации, в процентах за год: (?) BV (Book Value per Share) (?) EPS (Earnings per Share) (?) EG (Earnings per Share Growth) (!) RG (Revenue Growth)	ПК-4	35
66	Показатель, отражающий рост чистой прибыли, приходящейся на одну акцию, в процентах годовых: (?) BV (Book Value per Share) (?) EPS (Earnings per Share) (!) EG (Earnings per Share Growth) (?) RG (Revenue Growth)	ПК-4	35
67	Укажите неверно рассчитанный показатель EBIT (Earnings Before Interest and Tax) - прибыль до выплаты процентов и налогов: (?) EBIT = EBITDA – Расходы на износ и амортизацию (?) EBIT = Чистая прибыль + Проценты + Налоги (!) EBIT = Валовая прибыль – Коммерческие, общехозяйственные и административные расходы (?) EBIT = EBT + Проценты (?) EBIT = Выручка – Операционные расходы (OPEX) + внереализационные доходы – внереализационные расходы	ПК-4	35
68	Укажите неверно рассчитанный показатель EBITDA (Earnings Before Interest, Tax, Depreciation and Amortization) - прибыль до выплаты процентов, налогов и неденежных расходов: (?) EBITDA = EBIT + Расходы на износ и амортизацию (?) EBITDA = Чистая прибыль + Проценты + Налоги + Расходы на износ и амортизацию (!) EBITDA = EBT + Налоги + Расходы на износ и амортизацию (?) EBITDA = EBT + Проценты + Расходы на износ и амортизацию (?) EBITDA = Валовая прибыль – Коммерческие, общехозяйственные и административные расходы	ПК-4	35
69	EV (Enterprise value) – «справедливая», или рыночная оценка компании, определяется как: (?) EV = рыночная капитализация (обыкновенные) + долгосрочный долг + краткосрочный долг – денежные средства (и эквиваленты) (?) EV = рыночная капитализация (обыкновенные) + долгосрочный долг + краткосрочный долг + денежные средства (и эквиваленты) (!) EV = рыночная капитализация (обыкновенные) + рыночная капитализация (привилегированные) + долгосрочный долг + краткосрочный долг – денежные средства (и эквиваленты) (?) EV = рыночная капитализация (обыкновенные) + рыночная капитализация (привилегированные) + долгосрочный долг + краткосрочный долг + денежные средства (и эквиваленты)	ПК-4	35
70	Показатель применяется для сопоставления компаний, работающих в разных системах учета и налогообложения и даже в разных микроэкономических условиях (так как в этом коэффициенте не учитывается влияние амортизации, налогообложения, валютного курса и инфляции), он показывает, как рынок оценивает единицу прибыли компании: (?) EV/B	ПК-4	35

№	Содержание	Компетенция	ИД
	(!) EV/EBITDA (?) EV/S		
71	Показатель может применяться для сравнения компаний, использующих различные стандарты учета. Он показывает, насколько рыночная оценка компании сопоставима с ее оборотом: (?) EV/B (?) EV/EBITDA (!) EV/S	ПК-4	35
72	Показатель оборачиваемость всех активов компании TAT (Total Assets Turnover) не: (?) характеризует интенсивность эксплуатации всех имеющихся активов (?) рассчитывается как отношение объема реализации за год к сумме всех активов (!) показывает величину прибыли на единицу выручки	ПК-4	35
73	Показатель доли заемных средств D/A (Debt to Assets) не: (?) рассчитывается как отношение долга компании к сумме всех ее активов (?) характеризует уровень долговой нагрузки (!) показывает величину долга на единицу выручки	ПК-4	35
74	Один из видов инвестиционного анализа, базирующийся на анализе финансовой отчетности компаний и рыночной конъюнктуры, учитывающий общее состояние экономики и макроэкономические факторы, включая процентные ставки, производство, доходы, занятость, инфляцию и другие: (?) технический (?) макроэкономический (?) количественный (!) фундаментальный	ПК-4	35
75	Один из видов инвестиционного анализа, включающий в себя макроэкономический анализ, анализ отрасли, анализ компании-эмитента: (?) технический (?) макроэкономический (?) количественный (!) фундаментальный	ПК-4	35
76	Один из видов инвестиционного анализа, при котором аналитики оценивают исторические тренды, диапазоны и тенденции в уровне цен, чтобы предсказать их будущее движение, а также считают, что изменения тенденций подтверждают изменения настроений, а узнаваемые модели ценовых графиков могут быть обнаружены благодаря эмоциональной реакции инвесторов на движение цен: (!) технический (?) макроэкономический (?) количественный (?) фундаментальный	ПК-4	35
77	Один из видов инвестиционного анализа, в котором инвесторы используют подход «сверху вниз» или «снизу вверх»: (?) технический (?) макроэкономический (?) количественный (!) фундаментальный	ПК-4	35
78	Гипотеза финансовой экономики, которая утверждает, что цены на активы отражают всю доступную информацию. Прямым следствием этого является то, что невозможно постоянно «обыгрывать рынок» с поправкой на риск, поскольку рыночные цены должны реагировать только на новую информацию: (?) модель ценообразования капитальных активов (CAPM) (?) гипотеза случайного блуждания (!) гипотеза эффективного рынка (ЕМН)	ПК-4	35

№	Содержание	Компетенция	ИД
79	Методика для анализа конкуренции в отрасли и выработки стратегии бизнеса, разработанная Майклом Портером в Гарвардской школе бизнеса в 1979 году основана на анализе пяти сил Портера (Porter five forces analysis). Анализ какой из перечисленных сил не входит в структуру методики: (?) угрозы появления продуктов-заменителей; (?) угрозы появления новых игроков; (!) угрозы изменений в области государственной политики (?) рыночной власти поставщиков; (?) рыночной власти потребителей; (?) уровня конкурентной борьбы.	ПК-4	35
80	На анализ каких аспектов внешней среды не направлен PEST-анализ: (?) политических (Political) (?) экономических (Economic) (!) исторических (Historical) (?) социальных (Social) (?) технологических (Technological)	ПК-4	35
81	SWOT-анализ, как метод стратегического планирования, заключающийся в выявлении факторов внутренней и внешней среды организации и разделении их на четыре категории, какую из указанных категорий не включает: (?) Weaknesses (слабые стороны) (?) Strengths (сильные стороны) (!) Overcomings (преодоления) (?) Threats (угрозы) (?) Opportunities (возможности)	ПК-4	35
82	При определении прогнозного значения цены с помощью простой скользящей средней (simple moving average — sma) основной принцип расчета базируется на том, что: (!) рассчитывается среднее арифметическое от предшествующих значений n. (?) каждой из цен анализируемого промежутка времени придается «вес», например, увеличивающийся в направлении к текущему дню (?) делаются корректировки предыдущего прогнозного значения с учетом ошибки	ПК-4	35
83	Экспоненциальное скользящее среднее (exponentially moving average — ema) определяется как метод прогноза, строящийся на том, что: (?) рассчитывается среднее арифметическое от предшествующих значений n. (?) каждой из цен анализируемого промежутка времени придается «вес», например, увеличивающийся в направлении к текущему дню (!) делаются корректировки предыдущего прогнозного значения с учетом ошибки	ПК-4	35
84	Метод взвешенных скользящих средних (weighted moving average — wma) строится на том, что: (?) рассчитывается среднее арифметическое от предшествующих значений n. (!) каждой из цен анализируемого промежутка времени придается «вес», например, увеличивающийся в направлении к текущему дню (?) делаются корректировки предыдущего прогнозного значения с учетом ошибки	ПК-4	35
85	Уровень поддержки – это: (?) уровень на графике, при прохождении которого цена не меняет свое направление (?) уровень на графике, от которого цена отскакивала вниз, при движении в восходящем тренде (!) уровень на графике, от которого цена отскакивала вверх при движении в нисходящем тренде.	ПК-4	35
86	Уровень сопротивления – это: (?) уровень на графике, при прохождении которого цена не меняет свое направление (!) уровень на графике, от которого цена отскакивала вниз, при движении в	ПК-4	35

№	Содержание	Компетенция	ИД
	восходящем тренде (?) уровень на графике, от которого цена отскакивала вверх при движении в нисходящем тренде.		
87	Зеркальный уровень – это: (?) уровень, при столкновении с которым, цена отражается от него и идет в противоположном направлении (!) уровень сопротивления, после пробития которого он становится уровнем поддержки, или наоборот, уровень поддержки, после пробития которого становится уровнем сопротивления	ПК-4	35
88	Сколько точек касания ценой достаточно для построения уровня: (!) 2 точки касания (?) 1 точка касания (?) 4 точки касания	ПК-4	35
89	Волновой принцип Эллиотта базируется на числах из последовательности : (!) Фибоначчи (?) Бернулли (?) Элера (?) Каталана (?) Мерсенна	ПК-4	35
90	Числа Фибоначчи – это ряд чисел,; (!) каждый следующий член которого равен сумме двух предыдущих (?) где каждое следующее число в 2 раза больше предыдущего (?) которые увеличиваются по геометрической прогрессии.	ПК-4	35
91	Ценовой канал представляет собой пространство на ценовом графике, внутри которого движется цена, заключенное между: (!) линией максимумов и линией минимумов (?) ценой открытия и ценой закрытия (?) ценой спроса (Bid) и ценой предложения (Ask)	ПК-4	35
92	Назовите виды рыночных трендов: (!) восходящий, нисходящий, боковой (?) расширяющийся, сужающийся, параллельный (?) прямой, волнообразный, зигзагообразный.	ПК-4	35
93	Термин в техническом анализе, которым описывается ситуация существенной разницы между ценой закрытия предыдущего таймфрейма (элемента графика) и ценой открытия следующего, визуально ему соответствует «разрыв» между соседними элементами на графике цены: (!) гэп (?) спрэд (?) сплит	ПК-4	35
94	Верхняя и нижняя граница тени японской свечи, как вида интервального графика и технический индикатор, применяемый для отображения изменений биржевых котировок, отображают: (!) максимум и минимум цены за соответствующий период (?) цену открытия и закрытия (?) ценой спроса (Bid) и ценой предложения (Ask)	ПК-4	35
95	Границы тела японской свечи, как вида интервального графика и технический индикатор, применяемый для отображения изменений биржевых котировок, отображают: (?) максимум и минимум цены за соответствующий период (!) цену открытия и закрытия (?) ценой спроса (Bid) и ценой предложения (Ask)	ПК-4	35

№	Содержание	Компетенция	ИД
96	Если тело японской свечи, как вида интервального графика и технический индикатор, применяемый для отображения изменений биржевых котировок, белое, то: (?) цены снизились, нижняя граница тела отражает цену закрытия, верхняя – цену открытия (!) цены выросли, нижняя граница тела отражает цену открытия, верхняя – цену закрытия (?) цены не изменились	ПК-4	35
97	Если тело японской свечи, как вида интервального графика и технический индикатор, применяемый для отображения изменений биржевых котировок, черное, то: (!) цены снизились, нижняя граница тела отражает цену закрытия, верхняя – цену открытия (?) цены выросли, нижняя граница тела отражает цену открытия, верхняя – цену закрытия (?) цены не изменились	ПК-4	35
98	Инвестиционный кредитный рейтинг находится в диапазоне между AAA и _____ включительно.	ПК-4	35
99	Исходя из формулы цены облигации, ее доходность к погашению равна ставке _____	ПК-4	35
100	Эффективность инструмента аналогична эффективности рынка, если коэффициент Бета _____ 0	ПК-4	35
101	Термин в техническом анализе, которым описывается ситуация существенной разницы между ценой закрытия предыдущего таймфрейма (элемента графика) и ценой открытия следующего, визуально ему соответствует «разрыв» между соседними элементами на графике цены – _____	ПК-4	35

5.3.2.2. Вопросы для устного опроса

№	Содержание	Компетенция	ИД
1	Понятие и виды фундаментальных новостей. Цикл жизни фундаментальных факторов	ПК-4	35
2	Значения фундаментальных показателей и уточненные значения фундаментальных индикаторов	ПК-4	35
3	Политика, кризисные и природные явления, их влияние на финансовые рынки	ПК-4	35
4	Экономические циклы и их влияние на финансовые рынки	ПК-4	35
5	Валовой внутренний продукт	ПК-4	35
6	Инфляционные показатели	ПК-4	35
7	Показатели рынка труда	ПК-4	35
8	Показатели производственного сектора	ПК-4	35
9	Показатели международной торговли	ПК-4	35
10	Бюджетные показатели	ПК-4	35
11	Индикаторы потребительского спроса	ПК-4	35
12	Показатели розничной торговли	ПК-4	35
13	Доходы населения и их индикаторы	ПК-4	35
14	Индексы настроения потребителя	ПК-4	35
15	Индикаторы делового цикла	ПК-4	35
16	Индексы делового оптимизма	ПК-4	35
17	Календарь экономических событий	ПК-4	35
18	Торговая позиция	ПК-4	35
19	Цены покупки и продажи — BID и ASK	ПК-4	35
20	Усиление и ослабление валют данной валютной пары	ПК-4	35
21	Способы открытия и закрытия позиций	ПК-4	35

22	Типы ордеров по отношению к итогам сделки	ПК-4	35
23	Технологические типы ордеров	ПК-4	35
24	Расчет результата сделок	ПК-4	35
25	Учет спреда при выставлении ордеров	ПК-4	35
26	Операции с открытой позицией	ПК-4	35
27	Технический анализ — определение и постулаты	ПК-4	35
28	Технический анализ как методы прогнозирования цен	ПК-4	35
29	Графические методы прогнозирования цен	ПК-4	35
30	Математические методы прогнозирования цен	ПК-4	35
31	Формы представления данных о ценах	ПК-4	35
32	Тренды, линии, уровни	ПК-4	35
33	Разрывы	ПК-4	35
34	Перелом тренда	ПК-4	35
35	Разворотные фигуры (фигуры перелома) и принципы формирования разворотных фигур	ПК-4	35
36	Фигура «голова и плечи» (head and shoulders, H&S)	ПК-4	35
37	Кратные вершины и основания	ПК-4	35
38	Неудавшийся размах	ПК-4	35
39	Закругленные вершины и основания	ПК-4	35
40	Расширяющаяся формация	ПК-4	35
41	Алмазная формация	ПК-4	35
42	Восходящие и нисходящие треугольники	ПК-4	35
43	Расширяющийся треугольник	ПК-4	35
44	Клин	ПК-4	35
45	Веерный принцип	ПК-4	35
46	Фигуры продолжения тенденции	ПК-4	35
47	Симметричный треугольник	ПК-4	35
48	Восходящий треугольник	ПК-4	35
49	Нисходящий треугольник	ПК-4	35
50	Расширяющийся треугольник	ПК-4	35
51	Вымпел	ПК-4	35
52	Флаг	ПК-4	35
53	Клин	ПК-4	35
54	Прямоугольник	ПК-4	35
55	Отмеренный ход	ПК-4	35
56	Волновая теория Эллиота	ПК-4	35
57	Пропорции Фибоначчи в анализе рыночных графиков	ПК-4	35
58	Скользкие средние и другие трендовые индикаторы	ПК-4	35
59	Осцилляторы. Сигналы, подаваемые осцилляторами.	ПК-4	35
60	Виды осцилляторов	ПК-4	35
61	Подходы к определению параметров индикатора	ПК-4	35
62	Подходы в анализе японских свечей	ПК-4	35

5.3.2.3. Задачи для проверки умений и навыков

№	Содержание	Компетенция	ИД
1	В таблице приведены цены на гамбургер «Биг Мак» в некоторых странах по данным на январь 2017 года. Исходя из концепции паритета покупательной способности (абсолютный вариант ППС) рассчитать курсы соответствующих валют по отношению к американскому доллару (на январь 2017 г.). Укажите местную валюту. Сравните курсы валют и соотношение стоимости	ПК-4	Н6, У8
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.	ПК-4	Н6, У8

	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.		
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.	ПК-4	Н6, У8
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.	ПК-4	Н7, У8
5	Произвести расчет кредитного плеча по отношению к депозиту при следующих данных: депозит 2500 долларов, лот 1 = 0,03; лот 2 = 0,1.	ПК-4	Н7, У8
6	Произвести расчет стоимости 1 пункта по паре USD/CHF при лоте 0,08 и текущем курсе 1,2883.	ПК-4	Н6, У8
7	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.	ПК-4	Н7, У8
8	Цена швейцарского франка изменилась с 1,7498 до 1,8048. Определите 38% и 62% уровни возможного отката (уровни Фибоначчи).	ПК-4	Н7, У8

5.4. Система оценивания достижения компетенций

5.4.1. Оценка достижения компетенций в ходе промежуточной аттестации

Код	Содержание компетенций и индикаторов	Номера вопросов и задач			
		вопросы к зачету	задачи к зачету	вопросы к экзамену	вопросы по курсовому проекту
ПК-4 Способен консультировать клиентов по использованию финансовых продуктов и услуг					
Н6	мониторинг информационных источников финансовой информации		1-4		
Н7	анализ состояния и прогнозирование изменений инвестиционного и информационного рынков		5-8		
У8	производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг		1-8		
35	методы экономической диагностики рынка финансовых услуг	1-62			

5.4.2. Оценка достижения компетенций в ходе текущего контроля

Код	Содержание компетенций и индикаторов	Номера вопросов и задач		
		вопросы тестов	вопросы устного опроса	задачи для проверки умений и навыков
ПК-4 Способен консультировать клиентов по использованию финансовых продуктов и услуг				
Н6	мониторинг информационных источников финансовой информации			1-4

Н7	анализ состояния и прогнозирование изменений инвестиционного и информационного рынков			5-8
У8	производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг			1-8
35	методы экономической диагностики рынка финансовых услуг	1-101	1-62	

6. Учебно-методическое обеспечение дисциплины

6.1. Рекомендуемая литература

Тип рекомендаций	Перечень и реквизиты литературы (автор, название, год и место издания)	Количество экз. в библиотеке
1	2	3
2.1. Учебные издания	Галанов В. А. Производные финансовые инструменты [электронный ресурс]: Учебник / Российский экономический университет им. Г.В. Плеханова - Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2024 - 221 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/document?id=430790	-
	Галанов В. А. Рынок ценных бумаг [электронный ресурс]: Учебник / Российский экономический университет им. Г.В. Плеханова - Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2023 - 414 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/document?id=418725	-
	Зверев В. А. Азбука частного инвестора: путеводитель по финансовому рынку [электронный ресурс]: Научно-популярная литература / Национальный исследовательский университет ИТМО - Москва: Издательско-торговая корпорация "Дашков и К", 2023 - 248 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/document?id=431546	-
	Звонова Е. А. Международный финансовый рынок [электронный ресурс]: Учебное пособие / Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации; Российский экономический университет им. Г.В. Плеханова - Москва: Издательство "Магистр", 2018 - 368 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/document?id=372068	-
	Каячев Г. Ф. Финансовые рынки и институты [электронный ресурс]: Учебное пособие / Сибирский федеральный университет - Красноярск: Сибирский федеральный университет, 2011 - 240 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/document?id=143462	-
	Кириянов И. В. Рынок ценных бумаг и биржевое дело [электронный ресурс]: Учебное пособие / И. В. Кириянов - Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2018 - 264 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/document?id=300462	-
	Мэрфи Д. Технический анализ фьючерсных рынков: Теория и практика [электронный ресурс]: Практическое пособие / Д. Мэрфи - Москва: ООО "Альпина Паблишер", 2016 - 610 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/document?id=98360	-

Тип рекомендаций	Перечень и реквизиты литературы (автор, название, год и место издания)	Количество экз. в библиотеке
1	2	3
	Николаева И. П. Рынок ценных бумаг [электронный ресурс]: Учебник / Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации - Москва: Издательско-торговая корпорация "Дашков и К", 2022 - 254 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/document?id=431839	-
	Селищев А. С. Финансовые рынки и институты Китая [электронный ресурс]: Монография / Российский экономический университет им. Г.В. Плеханова, Минский ф-л; Российский экономический университет им. Г.В. Плеханова, Минский ф-л - Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2019 - 258 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/document?id=343378	-
	Слепов В. А. Финансы [электронный ресурс]: Учебник / Российский экономический университет им. Г.В. Плеханова - Москва: Издательство "Магистр", 2022 - 336 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/document?id=399410	-
	Слепов В. А. Финансы [электронный ресурс]: Учебник / Российский экономический университет им. Г.В. Плеханова - Москва: Издательство "Магистр", 2024 - 336 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/document?id=436656	-
	Сребник Б. В. Финансовые рынки: профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг [электронный ресурс]: Учебное пособие / Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации - Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2022 - 366 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/document?id=399976	-
	Чижик В. П. Финансовые рынки и институты [электронный ресурс]: Учебное пособие / ОМГУ ИМ. Ф.М. ДОСТОЕВСКОГО - Москва: Издательство "ФОРУМ", 2022 - 384 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/document?id=423095	-
2.2. Методические издания	Фундаментальный и технический анализ финансовых рынков [Электронный ресурс]: учебно-методическое пособие для освоения дисциплины и самостоятельной работы обучающихся направления 38.03.01 "Экономика" профиль "Финансы и кредит" / Воронежский государственный аграрный университет ; [сост. А. А. Рубан] - Воронеж: Воронежский государственный аграрный университет, 2021 [ПТ] URL: http://catalog.vsau.ru/elib/metod/m165653.pdf	1
2.3. Периодические издания	Деньги и кредит: ежемесячный журнал - Москва: Госфиниздат, 1955-	1
	Рынок ценных бумаг: Аналитический журнал - М.: Б.и., 2001-	1
	Финансы и кредит: журнал / учредитель : Издательский дом "Финансы и кредит" - Москва: Б.и., 1995-	1

6.2. Ресурсы сети Интернет

6.2.1. Электронные библиотечные системы

№	Название	Размещение
1	Лань	https://e.lanbook.com
2	ZNANIUM.COM	http://znanium.com/
3	ЮРАЙТ	http://www.biblio-online.ru/
4	E-library	https://elibrary.ru/
5	Электронная библиотека ВГАУ	http://library.vsau.ru/

6.2.2. Профессиональные базы данных и информационные системы

№	Название	Адрес доступа
1.	Единая межведомственная информационно-статистическая система	https://fedstat.ru/
2.	База данных показателей муниципальных образований	http://www.gks.ru/free_doc/new_site/bd_munst/munst.htm
3.	Портал открытых данных РФ	https://data.gov.ru/
4.	Справочная правовая система Гарант	http://ivo.garant.ru
5.	Справочная правовая система Консультант Плюс	http://www.consultant.ru/
6.	Профессиональные справочные системы «Кодекс»	https://texэксперт.сайт/sistema-kodeks

6.2.3. Сайты и информационные порталы

№	Название	Адрес доступа
	Официальный сайт Правительства Российской Федерации	http://www.gov.ru
2.	Официальный сайт Президента Российской Федерации	http://www.kremlin.ru
3.	Официальный сайт Минфина РФ:	https://minfin.gov.ru/ru/
4.	Счетная палата Российской Федерации	http://www.ach.gov.ru
5.	Professional Risk Managers' International Association	http://www.prmia.org
6.	Global Association of Risk Professionals	http://www.garp.com
7.	International Organization of Securities Commissions	http://www.iosco.org
8.	Basle Committee on Banking Supervision	http://www.bis.org
9.	Национальная Фондовая Ассоциация	http://www.nfa.ru
10.	Министерство финансов Воронежской области	https://www.govvrn.ru/organizacia/-/~id/844246
11.	Воронежская областная Дума	http://www.vrnoblduma.ru/

7. Материально-техническое и программное обеспечение дисциплины

7.1. Помещения для ведения образовательного процесса и оборудование

Наименование помещений для проведения всех видов учебной деятельности, предусмотренной учебным планом, в том числе помещения для самостоятельной работы, с указанием перечня основного оборудования, учебно-наглядных пособий и используемого программного обеспечения	Адрес(местоположение) помещений для проведения всех видов учебной деятельности, предусмотренной учебным планом (в случае реализации образовательной программы в сетевой форме дополнительно указывается наименование организации, с которой заключен договор)
<i>Учебные аудитории для проведения учебных занятий</i> Комплект учебной мебели, демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия, компьютерная техника с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду, используемое программное обеспечение MS Windows / Linux (ALT Linux)/ Ред ОС, Office MS Windows / OpenOffice / LibreOffice, Adobe Reader / DjVu Reader, Яндекс Браузер / Mozilla Firefox / Internet Explorer, DrWeb ES, 7-Zip, MediaPlayer Classic	Российская Федерация, Воронежская область, городской округ город Воронеж, город Воронеж, улица Мичурина, дом 1
<i>Учебные аудитории для проведения учебных занятий</i> Комплект учебной мебели, демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия, компьютерная техника с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду, используемое программное обеспечение MS Windows / Linux (ALT Linux)/ Ред ОС, Office MS Windows / OpenOffice / LibreOffice, Adobe Reader / DjVu Reader, Яндекс Браузер / Mozilla Firefox / Internet Explorer, DrWeb ES, 7-Zip, MediaPlayer Classic, «Гарант», «Консультант Плюс», AST Test	Российская Федерация, Воронежская область, городской округ город Воронеж, город Воронеж, улица Мичурина, дом 1
<i>Учебные аудитории для проведения учебных занятий (в т.ч. Лаборатория «Учебный банк»)</i> Комплект учебной мебели, демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия: коммутатор, стенд-карта МИНБ, стенд Парус-2, табло котировок валют, кассовая кабина, рабочее место кассира, банковская стойка, банковский барьер; используемое программное обеспечение MS Windows / Linux (ALT Linux)/ Ред ОС, Office MS Windows / OpenOffice / LibreOffice, Adobe Reader / DjVu Reader, Яндекс Браузер / Mozilla Firefox / Internet Explorer, DrWeb ES, 7-Zip, MediaPlayer Classic	Российская Федерация, Воронежская область, городской округ город Воронеж, город Воронеж, улица Мичурина, дом 1 -ауд. 374
<i>Учебные аудитории для проведения учебных занятий</i> Комплект учебной мебели, демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия	Российская Федерация, Воронежская область, городской округ город Воронеж, город Воронеж, улица Мичурина, дом 1
<i>Помещения для самостоятельной работы</i> Комплект учебной мебели, демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия, компьютерная техника с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду, используемое программное обеспечение MS Windows / Linux (ALT Linux)/ Ред ОС, Office MS Windows / OpenOffice / LibreOffice, Adobe Reader / DjVu Reader, Яндекс Браузер / Mozilla Firefox / Internet Explorer, DrWeb ES, 7-Zip, MediaPlayer Classic, «Гарант», «Консультант Плюс»	Российская Федерация, Воронежская область, городской округ город Воронеж, город Воронеж, улица Мичурина, дом 1 (ауд. 113, 115, 116, 119 120, 122, 123а, 126, 219, 220, 224, 241, 273 - с 16.00 до 20.00), 232а

7.2. Программное обеспечение

7.2.1. Программное обеспечение общего назначения

№	Название	Размещение
1	Операционные системы MS Windows /Linux /Ред ОС	ПК в локальной сети ВГАУ

2	Пакеты офисных приложений MS Office / OpenOffice/LibreOffice	ПК в локальной сети ВГАУ
3	Программы для просмотра файлов Adobe Reader / DjVu Reader	ПК в локальной сети ВГАУ
4	Браузеры Яндекс Браузер / Mozilla Firefox / Microsoft Edge	ПК в локальной сети ВГАУ
5	Антивирусная программа DrWeb ES	ПК в локальной сети ВГАУ
6	Программа-архиватор 7-Zip	ПК в локальной сети ВГАУ
7	Мультимедиа проигрыватель MediaPlayer Classic	ПК в локальной сети ВГАУ
8	Платформа онлайн-обучения eLearning server	ПК в локальной сети ВГАУ
9	Система компьютерного тестирования AST Test	ПК в локальной сети ВГАУ

7.2.2. Специализированное программное обеспечение

Не требуется

8. Междисциплинарные связи

Протокол согласования рабочей программы с другими дисциплинами:

Дисциплина, с которой необходимо согласование	Кафедра, на которой преподается дисциплина	Подпись заведующего кафедрой
Б1.О.12 Макроэкономика	Экономической теории и мировой экономики	
Б1.О.22 Статистика	Экономического анализа, статистики и прикладной математики	
Б1.О.25 Экономический анализ	Экономического анализа, статистики и прикладной математики	
Б1.В.19 Финансовые рынки и институты	Финансов и кредита	

Лист периодических проверок рабочей программы и информация о внесенных изменениях

Должностное лицо, проводившее проверку: Ф.И.О., должность	Дата	Потребность в корректировке указанием соответствующих разделов рабочей программы	Информация о внесенных изменениях
Заведующий кафедрой А.В. Агibalов	протокол №11 от 16.06.2025 г.	Имеется п.6.1, п.7.1 Рабочая программа актуализирована на 2025-2026 учебный год	Скорректирована рекомендуемая литература, уточнены адреса (местоположение) помещений для проведения всех видов учебной деятельности,

			предусмотренной учебным планом
Заведующий кафедрой А.В. Агибалов	протокол №11 от 25.05.202 6 г.	Рабочая программа актуализирована на 2026-2027 учебный год	нет