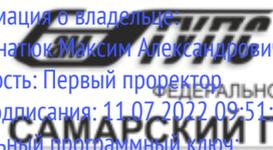


Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Гнаток Максим Александрович
Должность: Первый проректор
Дата подписания: 11.07.2022 09:51:21
Уникальный программный ключ:
8873f497f100e798ae8c92c0d38e105c818d5410



МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ АГЕНТСТВО ЖЕЛЕЗНОДОРОЖНОГО ТРАНСПОРТА
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
САМАРСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПУТЕЙ СООБЩЕНИЯ

Приложение
к рабочей программе дисциплины

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ
АТТЕСТАЦИИ ПО ДИСЦИПЛИНЕ**

**Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках
(ФТАФР)**

(наименование дисциплины)

Направление подготовки
38.04.01 «Экономика»
(код и наименование)

Направленность (профиль)

«Учет, анализ и аудит»
(наименование)

заочное обучение

Содержание

1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы.
2. Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания.
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.
4. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций.

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

Основными этапами формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы является их формирование в процессе освоения дисциплин, практик, подготовки ВКР и т.д.

Этапность формирования компетенций прямо связана с местом дисциплины в образовательной программе (раздел 2 РПД)

Перечень компетенций, формируемых дисциплиной

Б1.В.01 Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках

код компетенции	определение компетенции
ОК-2	готовностью действовать в нестандартных ситуациях, нести социальную ответственность за принятые решения
ОПК-3	способностью принимать организационно-управленческие решения
ПК-9	способностью анализировать и использовать различные источники информации для проведения экономических расчетов

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

Основными этапами формирования компетенций обучающихся при освоении дисциплины являются последовательное изучение содержательно связанных между собой разделов (тем) учебных занятий. Результаты текущего контроля и промежуточной аттестации позволяют определить уровень освоения компетенций обучающимися.

Планируемые результаты обучения приведены в разделе 1 рабочей программы дисциплины.

Матрица оценки результатов обучения по дисциплине				
Код компетенции	Дескрипторы	Оценочные средства/формы контроля		
		Тестовое задание	Дискуссия	Зачет
ОК-2	Знает	+	+	+
	Умеет	+		+
	Владеет			+
ОПК-3	Знает	+	+	+
	Умеет	+		+
	Владеет			+
ПК-9	Знает	+	+	+
	Умеет	+		+
	Владеет		+	+

Критерии формирования оценок по выполнению тестовых заданий

«Отлично» (5 баллов) – получают обучающиеся с правильным количеством ответов на тестовые вопросы – 100 – 90% от общего объёма заданных тестовых вопросов.

«Хорошо» (4 балла) – получают обучающиеся с правильным количеством ответов на тестовые вопросы – 89 – 70% от общего объёма заданных тестовых вопросов.

«Удовлетворительно» (3 балла) – получают обучающиеся с правильным количеством ответов на тестовые вопросы – 69 – 60% от общего объёма заданных тестовых вопросов.

«Неудовлетворительно» (0 баллов) - получают обучающиеся с правильным количеством ответов на тестовые вопросы – 59% и менее от общего объёма заданных тестовых вопросов.

Критерии формирования оценок по зачету

«Зачтено» - обучающийся демонстрирует знание основных разделов программы изучаемого курса: его базовых понятий и фундаментальных проблем; приобрел необходимые умения и навыки, освоил вопросы практического применения полученных знаний, не допустил фактических ошибок при ответе, достаточно последовательно и логично излагает теоретический материал, допуская лишь незначительные нарушения последовательности изложения и некоторые неточности.

«Не зачтено» - выставляется в том случае, когда обучающийся демонстрирует фрагментарные знания основных разделов программы изучаемого курса: его базовых понятий и фундаментальных проблем. У экзаменуемого слабо выражена способность к самостоятельному аналитическому мышлению, имеются затруднения в изложении материала, отсутствуют необходимые умения и навыки, допущены грубые ошибки и незнание терминологии, отказ отвечать на дополнительные вопросы, знание которых необходимо для получения положительной оценки

Критерии формирования оценок по выполнению контрольных работ

«Зачтено» – ставится за работу, выполненную полностью без ошибок и недочетов в соответствии с заданием, выданным для выполнения контрольной работы. Обучающийся полностью владеет информацией о нормативных документах, регулирующих хозяйственные процессы в организации; на основании данных о финансовой деятельности может решить все поставленные в задании задачи.

«Не зачтено» - ставится за работу, если обучающийся правильно выполнил менее 2/3 всей работы, использовал при выполнении работы устаревшую нормативную базу, в качестве исходных данных выступили данные учебника, а не реальной организации.

Шкала оценивания уровней освоения компетенций

Шкала оценивания	Уровень освоения компетенции
отлично	высокий
хорошо	продвинутый
удовлетворительно	базовый
неудовлетворительно	компетенция не сформирована

Оценка «зачтено» соответствует критериям оценок от «отлично» до «удовлетворительно».

Оценка «не зачтено» соответствует критерию оценки «неудовлетворительно».

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

Перечень оценочных средств по дисциплине, их краткая характеристика и представление оценочного средства в фонде приведены в таблице.

Каждое оценочное средство представлено в фонде в виде единого документа или в виде комплекта документов.

Перечень оценочных средств для текущего контроля и промежуточной аттестации по дисциплине

Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в фонде
Текущий контроль		
Тестовое задание	Система стандартизированных заданий, позволяющая автоматизировать процедуру измерения уровня знаний и умений обучающегося	Фонд тестовых заданий по разделам и темам. Критерии оценки
Промежуточная аттестация		
Контрольная работа	Средство проверки умений и навыков применять полученные знания для решения задач определенного типа по определенным темам или разделам	Комплект контрольных заданий по вариантам. Критерии оценки
Зачет	Форма промежуточной аттестации по дисциплине, позволяющая оценить результаты обучения и уровень сформированности компетенций на этапе изучения дисциплины.	Теоретические вопросы и практические задания для подготовки. Комплект вопросов и практических заданий к зачету, банк тестов. Критерии оценки.

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

Описание процедуры оценивания «Тестирование». Тестирование по дисциплине проводится с использованием ресурсов электронной образовательной среды «Moodle» (режим доступа: <http://do.samgups.ru/moodle/>). Количество тестовых заданий и время задается системой. Во время проведения тестирования обучающиеся могут пользоваться программой дисциплины, справочной литературой, калькулятором. Результат каждого обучающегося оценивается в соответствии с универсальной шкалой, приведенной в пункте 2.

Описание процедуры оценивания «Зачет». Зачет может проводиться как в форме устного или письменного ответа на вопросы билета, так и в иных формах (тестирование, коллоквиум, диспут, кейс, эссе, деловая или ролевая игра, презентация проекта или портфолио). Форма определяется преподавателем. Исходя из выбранной формы, описывается методика процедуры оценивания.

При проведении зачета в форме устного ответа на вопросы билета обучающемуся предоставляется 20 минут на подготовку. Опрос обучающегося по билету не должен превышать 0,25 часа. Ответ обучающегося оценивается в соответствии с критериями, описанными в пункте 2.

При проведении зачета в форме тестирования в системе «Moodle» (режим доступа: <http://do.samgups.ru/moodle/>) количество тестовых заданий и время задается системой. Во время проведения зачета обучающиеся могут пользоваться программой дисциплины, справочной литературой, калькулятором. Результат каждого обучающегося оценивается в соответствии с универсальной шкалой, приведенной в пункте 2.

Описание процедуры оценивания «Контрольная работа». Оценивание проводится преподавателем. По результатам проверки контрольной работы обучающийся допускается к собеседованию при соблюдении следующих условий:

- выполнены все задания;

- сделаны выводы;
- отсутствуют ошибки;
- оформлено в соответствии с требованиями.

В том случае, если работа не отвечает предъявляемым требованиям, то она возвращается автору на доработку. Обучающийся должен переделать работу с учетом замечаний и предоставить для проверки вариант с результатами работы над ошибками. Если сомнения вызывают отдельные аспекты контрольной работы, то в этом случае они рассматриваются во время устного собеседования. Ответ обучающегося оценивается преподавателем в соответствии с критериями, описанными в пункте 2.

МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ АГЕНТСТВО ЖЕЛЕЗНОДОРОЖНОГО ТРАНСПОРТА
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
САМАРСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПУТЕЙ
СООБЩЕНИЯ
(СамГУПС)

Факультет «Экономика, логистика и менеджмент»

Кафедра «Экономика и финансы»

Фонд тестовых заданий
по дисциплине «Фундаментальный и технический анализ на
финансовых рынках»

1. Дидактические цели выполнения тестовых заданий: выявить уровень знаний обучающихся, оценить степень усвоения ими учебного курса и практического владения теоретическим материалом, а также стимулировать активность их самостоятельной работы.

2. Критерии формирования оценок по выполнению тестовых заданий

«Отлично» (5 баллов) – получают обучающиеся с правильным количеством ответов на тестовые вопросы – 100 – 90% от общего объёма заданных тестовых вопросов.

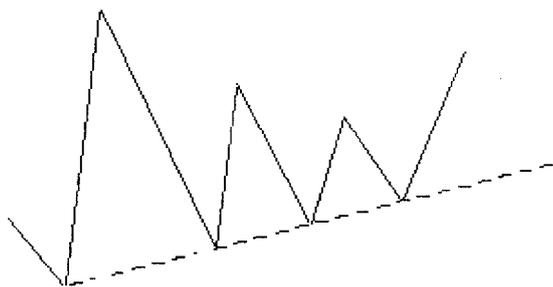
«Хорошо» (4 балла) – получают обучающиеся с правильным количеством ответов на тестовые вопросы – 89 – 70% от общего объёма заданных тестовых вопросов.

«Удовлетворительно» (3 балла) – получают обучающиеся с правильным количеством ответов на тестовые вопросы – 69 – 60% от общего объёма заданных тестовых вопросов.

«Неудовлетворительно» (0 баллов) - получают обучающиеся с правильным количеством ответов на тестовые вопросы – 59% и менее от общего объёма заданных тестовых вопросов.

3. Методические материалы

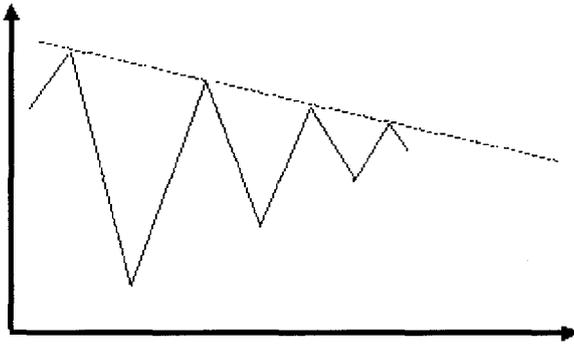
1. На рисунке сплошной линией изображен график изменения цен,



при этом пунктиром обозначена линия, которая называется:

- А) Линия поддержки
- В) Линия сопротивления
- С) Возрастающий тренд цен
- Д) Ограничение цен

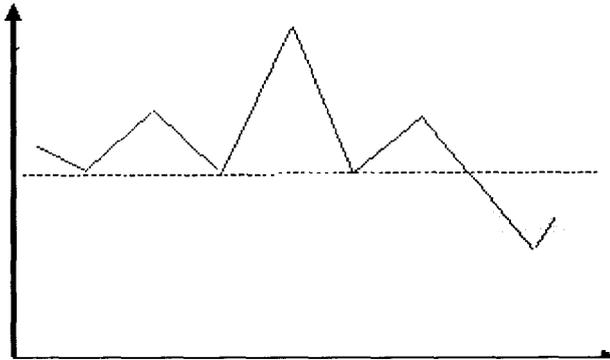
2. На рисунке изображен график изменения цен:



при этом пунктиром обозначена линия, которая называется:

- А) Линия сопротивления
- В) Линия поддержки
- С) Убывающий тренд цен
- Д) Ограничение цен

3. На рисунке:



сплошной линией изображена фигура, называемая

- А) "Голова и плечи"
- В) "Перевернутые голова и плечи"
- С) "Двойное дно"
- В) "Убывающий тренд"

4. Какие ключевые параметры используются в фундаментальном анализе для сравнения и отбора акций?

- I EP8
 - II P/E
 - III НАУ
 - IV Текущий курс акции
 - V Коэффициент бета
- А) Только I, II и III
 - В) Только I, II, III и V
 - С) Только III, IV и V
 - Д) Все перечисленные

5. Какие ключевые показатели из перечисленных ниже используются в фундаментальном анализе?

- I Доход на акцию
- II Стоимость чистых активов
- III Объем торговли за период
- IV Индекс относительной силы

- А) Только I, II и IV
- В) Только I, III и IV
- С) Только I и II
- Д) Все приведенные.

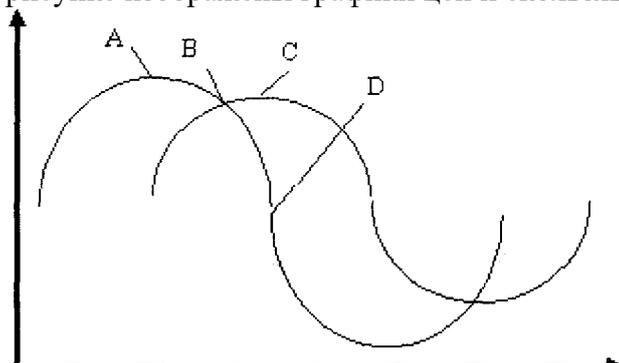
6. Для оценки стоимости каких из ниже перечисленных акций применяется модель Гордона?

- А) Акции с постоянным на протяжении рассматриваемого периода размером дивиденда
- В) Акции, размер дивиденда по которым увеличивается с постоянным темпом прироста
- С) Акции, размер дивиденда по которым увеличивается с переменным темпом прироста
- Д) Акции, размер дивиденда по которым на протяжении рассматриваемого периода изменяется случайным образом

7. Какому из ниже перечисленных показателей в наибольшей степени соответствует понятие внутренней стоимости компании?

- А) Капитализация компании
- В) Балансовая стоимость активов компании
- С) Текущая стоимость будущих доходов компании

8. На рисунке изображены графики цен и скользящего среднего.



В какой из отмеченных точек имеется сигнал к продаже?

- А) В точке А
- В) В точке В
- С) В точке С
- Д) В точке О

9. Чем определяется "качество" эмитента облигаций?

- А) Доходностью облигаций эмитента
- В) Информационной прозрачностью эмитента
- С) Чувствительностью цены облигаций к изменению процентной ставки на рынке
- В) Риском невыплаты процентов и/или основной суммы долга

10. Что отражает разрыв в доходности государственных облигаций и облигаций частной компании?

- А) Риск изменения рыночных процентных ставок
- В) Риск реинвестирования купона
- С) Кредитный риск

11. На каких исходных положениях базируется фундаментальный анализ?

- I Анализируемая компания в будущем будет действующим предприятием
- II Предприятие имеет внутреннюю стоимость, которую можно определить путем анализа данных о компании
- III В каждый момент внутренняя стоимость предприятия совпадает с его рыночной стоимостью
- IV Внутренняя стоимость предприятия будет признана рынком в долгосрочной перспективе

- A) Только I, II и III
- B) Только I, II и IV
- C) Только I и III
- D) Только II и IV

12. Какое из нижеперечисленных утверждений соответствует одному из постулатов технического анализа?

- A) Цены на финансовых рынках изменяются случайным образом
- B) Колебание цен на финансовых рынках имеет циклический характер
- C) В динамике цен на финансовых рынках проявляются устойчивые тенденции
- D) Изменение цен на финансовых рынках обусловлено только экономическими факторами

13. Для какой из перечисленных ниже целей применяется технический анализ?

- A) Отбор ценных бумаг при формировании портфеля
- B) Выбор времени покупки и продажи ценных бумаг
- C) Прогнозирование значения рыночной цены на следующий день
- D) Анализ рисков на фондовом рынке

14. Что соединяет на ценовом графике линия повышательного тренда?

- A) Несколько последовательных максимумов цен
- B) Несколько последовательных минимумов цен
- C) Цены закрытия торгов
- D) Несколько зон консолидации цен

15. В каком из нижеперечисленных случаев понижательный ценовой тренд будет считаться прерванным?

- A) Если после пересечения линии тренда цена возрастает более чем на 3%
- B) Если после пересечения линии тренда цены идут вверх в течение двух дней
- C) Ни в одном из перечисленных случаев
- D) В обоих случаях

16. Что обычно происходит на рынке после образования формации "голова и плечи"?

- A) Перелом повышательной тенденции
- B) Консолидация цен
- C) Образование временной паузы в ходе роста цен
- D) Усиление повышательной тенденции

17. Что из нижеперечисленного позволяют определить индикаторы тренда?

- A) Вероятные моменты перелома ценового тренда
- B) Вероятные моменты ослабления ценового тренда
- C) Наличие ценового тренда и его направление
- D) Все вышеперечисленное

18. В каком из нижеперечисленных случаев скользящая средняя подает сигнал на покупку?

- A) Цены находятся над скользящей средней
- B) Цены находятся под скользящей средней

- С) Цены пересекают скользящую среднюю сверху вниз
- Д) Цены пересекают скользящую среднюю снизу вверх

19. Каким кредитным рейтингом должны обладать облигации "инвестиционного качества"?

- А) Не ниже А
- В) ВВВ и выше
- С) Не ниже ВВ
- Д) ССС и выше

20. Что является предметом изучения в техническом анализе?

- А) Конфиденциальная информация о деятельности компаний
- В) Временные ряды цен сделок и объемов торгов
- С) Показатели доходности финансовых инструментов
- Д) Психология участников рынка

21. Какая из перечисленных ниже фигур не относится к формациям продолжения?

- А) Треугольник
- В) Флаг
- С) Блюдце
- Д) Клин

22. Скользящие средние расположены выше графика цен в следующем порядке сверху вниз: 18-дневная, 9-дневная, 4-дневная. Эта комбинация дает сигнал....

- А) На покупку
- В) На продажу

23. Укажите правильные утверждения в отношении осцилляторов, используемых в техническом анализе?

- I Осцилляторы подают опережающие сигналы
 - II Осцилляторы предупреждают о возможных моментах начала, замедления и перелома тренда
 - III Осцилляторы эффективны в периоды консолидации цен
- А) Только I
 - В) Только II
 - С) Только I и II
 - Д) Все перечисленные

24. В каком случае следует ожидать снижение цены акций компании в долгосрочном периоде?

- А) Темп роста прибыли от реализации продукции превышает темп роста объема продаж
- В) Темп роста дивидендов превышает темп роста балансовой прибыли
- С) Темп роста дебиторской задолженности ниже темпа роста объема продаж
- Д) Темп роста собственного капитала превышает темп роста долгосрочных обязательств

25. Из ниже перечисленных укажите признак, наиболее характерный для недооцененных акций

- А) Устойчивое снижение цен акций
- В) Устойчивый рост цен акций
- С) Небольшое количество заявок на покупку акций
- Д) Внутренняя стоимость акций меньше их рыночной цены

САМАРСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПУТЕЙ
СООБЩЕНИЯ
(СамГУПС)

Факультет «Экономика, логистика и менеджмент»

Кафедра «Экономика и финансы»

Вопросы к зачету
по дисциплине «Фундаментальный и технический анализ на
финансовых рынках»

Вопросы к зачету

1. Понятие и предмет фундаментального анализа
2. Общеэкономический аспект проведения фундаментального анализа
3. Отраслевой и региональный аспекты проведения фундаментального анализа
4. Проведение фундаментального анализа на уровне компании
5. Методы проведения фундаментального анализа на общеэкономическом уровне
6. Методы проведения фундаментального анализа на отраслевом и региональном уровнях
7. Методы проведения фундаментального анализа компании
8. Система показателей общеэкономического фундаментального анализа
9. Система показателей отраслевого и регионального фундаментального анализа
10. Система показателей фундаментального анализа компании
11. Понятие и предмет технического анализа
12. Общеэкономический аспект проведения технического анализа
13. Отраслевой и региональный аспекты проведения технического анализа
14. Проведение технического анализа на уровне компании
15. Методы проведения технического анализа на общеэкономическом уровне
16. Методы проведения технического анализа на отраслевом и региональном уровнях
17. Методы проведения технического анализа компании
18. Система показателей общеэкономического технического анализа
19. Система показателей отраслевого и регионального технического анализа
20. Система показателей технического анализа компании

Критерии формирования оценок по зачету

«Зачтено» - обучающийся демонстрирует знание основных разделов программы изучаемого курса: его базовых понятий и фундаментальных проблем; приобрел необходимые умения и навыки, освоил вопросы практического применения полученных знаний, не допустил фактических ошибок при ответе, достаточно последовательно и логично излагает теоретический материал, допуская лишь незначительные нарушения последовательности изложения и некоторые неточности.

«Не зачтено» - выставляется в том случае, когда обучающийся демонстрирует фрагментарные знания основных разделов программы изучаемого курса: его базовых понятий и фундаментальных проблем. У экзаменуемого слабо выражена способность к самостоятельному аналитическому мышлению, имеются затруднения в изложении материала, отсутствуют необходимые умения и навыки, допущены грубые ошибки и незнание терминологии, отказ отвечать на дополнительные вопросы, знание которых необходимо для получения положительной оценки

МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ АГЕНТСТВО ЖЕЛЕЗНОДОРОЖНОГО ТРАНСПОРТА
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
САМАРСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПУТЕЙ
СООБЩЕНИЯ
(СамГУПС)

Факультет «Экономика, логистика и менеджмент»

Кафедра «Экономика и финансы»

Темы контрольных работ
по дисциплине «Фундаментальный и технический анализ на
финансовых рынках»

1. Сфера применения фундаментального анализа
2. Этапы проведения фундаментального анализа
3. Отраслевой и региональный аспекты фундаментального анализа
4. Фундаментальный анализ на уровне компании
5. Фундаментальный анализ на общеэкономическом уровне
6. Методы проведения технического анализа
7. Инструментарий проведения фундаментального анализа
8. Целевые показатели фундаментального и технического анализа
9. Индикаторы технического анализа
10. Система показателей финансового анализа компании

Описание процедуры оценивания «Контрольная работа». Оценивание проводится преподавателем. По результатам проверки контрольной работы обучающийся допускается к собеседованию при соблюдении следующих условий:

- выполнены все задания;
- сделаны выводы;
- отсутствуют ошибки;
- оформлено в соответствии с требованиями.

В том случае, если работа не отвечает предъявляемым требованиям, то она возвращается автору на доработку. Обучающийся должен переделать работу с учетом замечаний и предоставить для проверки вариант с результатами работы над ошибками. Если сомнения вызывают отдельные аспекты контрольной работы, то в этом случае они рассматриваются во время устного собеседования. Ответ обучающегося оценивается преподавателем в соответствии с критериями, описанными в пункте 2.