

ФЕДЕРАЛЬНОЕ АГЕНТСТВО ЖЕЛЕЗНОДОРОЖНОГО ТРАНСПОРТА  
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Иркутский государственный университет путей сообщения»  
(ФГБОУ ВО ИрГУПС)

**Забайкальский институт железнодорожного транспорта** –  
филиал Федерального государственного бюджетного образовательного учреждения  
высшего образования «Иркутский государственный университет путей сообщения»  
(ЗабИЖТ ИрГУПС)

УТВЕРЖДЕНА  
приказом и. о. ректора  
от «17» июня 2022 г. № 77

## Б1.В.ДВ.03.02 Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках рабочая программа дисциплины

Направление подготовки – 38.03.01 Экономика

Профиль – Финансы и кредит

Квалификация выпускника – бакалавр

Форма и срок обучения – 4 года очная форма

Кафедра-разработчик программы – Экономика и управление

Общая трудоемкость в з.е. – 7

Формы промежуточной аттестации в семестрах

Часов по учебному плану (УП) – 252

очная форма обучения: зачет 6 семестр, экзамен 7 семестр, курсовая работа 7 семестр

В том числе в форме практической  
подготовки (ПП) – 4 (очная)

Очная форма обучения	Распределение часов дисциплины по семестрам			
	Семестр	6	7	Итого
Число недель в семестре		17	14	
Вид занятий		Часов по УП	Часов по УП	Часов по УП
<b>Аудиторная контактная работа по видам учебных занятий/в т.ч. в форме ПП</b>		<b>51/4</b>	<b>42</b>	<b>93/4</b>
– лекции		17	14	31
– практические		34/4	28	62/4
– лабораторные работы		-	-	-
<b>Самостоятельная работа</b>		<b>57</b>	<b>66</b>	<b>123</b>
<b>Зачет</b>				
<b>Экзамен</b>			<b>36</b>	<b>36</b>
<b>Итого</b>		<b>108</b>	<b>144</b>	<b>252</b>

\* В форме ПП – в форме практической подготовки.

ЧИТА

Электронный документ выгружен из ЕИС ФГБОУ ВО ИрГУПС и соответствует оригиналу

Подписант ФГБОУ ВО ИрГУПС Трофимов Ю.А.

00920FD815CE68F8C4CA795540563D259C с 07.02.2024 05:46 по 02.05.2025 05:46 GMT+03:00

Подпись соответствует файлу документа



Рабочая программа дисциплины разработана в соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования – бакалавриат по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, утвержденным приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от 12.08.2020 г. № 954.

Программу составил:  
к.э.н., доцент кафедры

Е.П. Овечкина

Рабочая программа рассмотрена и одобрена для использования в учебном процессе на заседании кафедры «Экономика и управление», протокол от «20» мая 2022 г. № 8.

Зав. кафедрой, к.э.н., доцент

О.Л. Быстрова

<b>1 ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ</b>	
<b>1.1 Цель преподавания дисциплины</b>	
1	сформировать системное представление о финансовой экономике в единстве теории, методологии и практики реализации финансовых отношений в современной рыночной системе
2	привить обучающимся навыки по вопросам принятия инвестиционных решений как на основе анализа фундаментальных показателей макросреды, отраслевой динамики и специфических характеристик публичных компаний (ключевых финансовых коэффициентов, структуры собственного капитала, качества корпоративного управления), делающих их привлекательными в глазах рыночных инвесторов, так и на основе анализа графического поведения цен
<b>1.2 Задачи дисциплины</b>	
1	формирование навыков работы с финансовой информацией и обучение различным видам ее представления, необходимым для фундаментального и технического анализа
2	приобретение навыков работы с информационно-торговыми системами
3	определение границ применения технического анализа и его использования в сочетании с другими методами для проведения комплексного всестороннего анализа финансовых инструментов
<b>1.3 Цель воспитания и задачи воспитательной работы в рамках дисциплины</b>	
Профессионально-трудовое воспитание обучающихся	
Цель профессионально-трудового воспитания – формирование у обучающихся осознанной профессиональной ориентации, понимания общественного смысла труда и значимости его для себя лично, ответственного, сознательного и творческого отношения к будущей деятельности, профессиональной этики, способности предвидеть изменения, которые могут возникнуть в профессиональной деятельности, и умению работать в изменённых, вновь созданных условиях труда.	
Цель достигается по мере решения в единстве следующих задач:	
– формирование сознательного отношения к выбранной профессии;	
– воспитание чести, гордости, любви к профессии, сознательного отношения к профессиональному долгу, понимаемому как личная ответственность и обязанность;	
– формирование психологии профессионала;	
– формирование профессиональной культуры, этики профессионального общения;	
– формирование социальной компетентности и другие задачи, связанные с имиджем профессии и авторитетом транспортной отрасли	
Научно-образовательное воспитание обучающихся	
Цель научно-образовательного воспитания – создание условий для реализации научно-образовательного потенциала обучающихся в форме наставничества, тьюторства, научного творчества.	
Цель достигается по мере решения в единстве следующих задач:	
– формирование системного и критического мышления, мотивации к обучению, развитие интереса к творческой научной деятельности;	
– создание в студенческой среде атмосферы взаимной требовательности к овладению знаниями, умениями и навыками;	
– популяризация научных знаний среди обучающихся;	
– содействие повышению привлекательности науки, поддержка научно-технического творчества;	
– создание условий для получения обучающимися достоверной информации о передовых достижениях и открытиях мировой и отечественной науки, повышения заинтересованности в научных познаниях об устройстве мира и общества;	
– совершенствование организации и планирования самостоятельной работы обучающихся как образовательной технологии формирования будущего специалиста путем индивидуальной познавательной и исследовательской деятельности	

<b>2 МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП</b>	
Блок/часть ОПОП	Блок 1. Дисциплины / Часть, формируемая участниками образовательных отношений
<b>2.1 Требования к предварительной подготовке обучающегося</b>	
1	Б1.В.ДВ.02.01 Экономический анализ
2	Б1.В.ДВ.02.02 Управленческий анализ
3	Б1.В.ДВ.05.01 Финансовый мониторинг
4	Б1.В.ДВ.05.02 Финансовый контроль
5	Б1.В.ДВ.06.01 Рынок ценных бумаг
6	Б1.В.ДВ.06.02 Практика инвестиционного проектирования
<b>2.2 Дисциплины и практики, для которых изучение данной дисциплины необходимо как предшествующее</b>	
1	Б1.В.ДВ.07.01 Банковское дело
2	Б1.В.ДВ.07.02 Расчетные и платежные системы
3	Б1.В.ДВ.08.01 Страхование

4	Б1.В.ДВ.08.02 Производные финансовые инструменты
5	Б1.В.ДВ.13.01 Финансовый менеджмент
6	Б1.В.ДВ.13.02 Финансовый и валютный дилинг
7	Б2.О.04(Пд) Производственная - преддипломная практика
8	Б3.01(Д) Подготовка к процедуре защиты выпускной квалификационной работы
9	Б3.02(Д) Защита выпускной квалификационной работы

### 3 ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ, СООТНЕСЕННЫЕ С ТРЕБОВАНИЯМИ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Планируемые результаты обучения
ПК-2.1 - Способен проводить исследования финансового рынка и систематизацию предложений финансовых услуг (включая действующие правила и условия, тарифной политики и действующих форм документации)	ПК-2.1.1 - Осуществляет сбор информации по спросу на рынке финансовых услуг	<b>Знать:</b> основные общенаучные методы научных исследований и методики применения на рынке финансовых услуг
		<b>Уметь:</b> использовать для анализа состояния различных сегментов финансового рынка доступные информационные источники для проведения финансово-экономических расчетов; применять правила, принципы и нормы, регулирующие функционирование финансовых рынков; работать с различными информационными базами и системами
		<b>Владеть:</b> современными технологиями моделирования финансовых рынков; навыками составления аналитических обзоров по состоянию финансового рынка в целом и по отдельным его сегментам; навыками составления рекомендаций по принятию решений на финансовых рынках
	ПК-2.1.3. Проводит мониторинг информационных источников финансовой информации	<b>Знать:</b> понятийно-категориальный аппарат мониторинга информационных источников финансовой информации
		<b>Уметь:</b> применять мониторинг информационных источников финансовой информации
		<b>Владеть:</b> навыками проведения мониторинга информационных источников финансовой информации
ПК-2.2- Способен организовывать и поддерживать долгосрочные отношения со стратегическими партнерскими организациями (рейтинговыми агентствами, аудиторскими организациями, оценочными фирмами, информационными агентствами)	ПК-2.2.2 - Анализирует состояние и прогнозирует изменения инвестиционного и информационного рынков	<b>Знать:</b> параметры состояния инвестиционного и информационного рынков
		<b>Уметь:</b> проводить анализ состояний инвестиционного и информационного рынков
		<b>Владеть:</b> навыками анализа и прогнозирования состояния инвестиционного и информационного рынков
ПК-2.3 Способен взаимодействовать с потенциальными потребителями финансовых услуг с целью выявления	ПК-2.3.2 - Владеет навыкам сравнения параметров финансовых продуктов	<b>Знать:</b> параметры финансовых продуктов
		<b>Уметь:</b> проводить процесс сравнения параметров финансовых продуктов

платежеспособного спроса и мониторинга финансовых возможностей клиента	<b>Владеть:</b> навыкам сравнения параметров финансовых продуктов
--	---

4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ							
Код	Наименование разделов, тем и видов работы	Очная форма					*Код индикатора достижения компетенции
		Се- местр	Часы				
			Лек	Пр	Л	СР	
1.0	<b>Раздел 1. Фундаментальный и технический анализ</b>	6	17	34/4		57	ПК - 2.1.1 ПК - 2.1.3 ПК - 2.2.2 ПК - 2.3.2
1.1	Тема 1 Основные понятия и предпосылки фундаментального анализа	6	2				ПК - 2.1.1
1.2	Тема 1 Основные понятия и предпосылки фундаментального анализа	6		5			ПК - 2.1.1
1.3	Тема 1. Основные понятия и предпосылки фундаментального анализа Проработка лекционного материала, подготовка докладов, подготовка к тестированию	6				8	ПК - 2.1.1
1.4	Тема 2 Особенности аналитической работы на финансовых рынках	6	2				ПК - 2.1.1
1.5	Тема 2 Особенности аналитической работы на финансовых рынках Представление докладов	6		5			ПК - 2.1.1
1.6	Тема 2 Особенности аналитической работы на финансовых рынках Проработка лекционного материала, подготовка докладов, подготовка к тестированию	6				8	ПК - 2.1.1
1.7	Тема 3. Два направления проведения фундаментального анализа: «сверху-вниз» и «снизу- вверх»	6	2				ПК - 2.1.3
1.8	Тема 3. Два направления проведения фундаментального анализа: «сверху-вниз» и «снизу- вверх» Представление докладов, решение разноуровневых задач	6		5/2			ПК - 2.1.3
1.9	Тема 3. Два направления проведения фундаментального анализа: «сверху-вниз» и «снизу- вверх» Проработка лекционного материала, подготовка докладов, подготовка к тестированию, решение разноуровневой задачи	6				8	ПК - 2.1.3
1.10	Тема 4 Рыночные мультипликаторы в фундаментальном анализе (сопоставление фондовых рынков и акций)	6	3				ПК - 2.2.2
1.11	Тема 4 Рыночные мультипликаторы в фундаментальном анализе (сопоставление фондовых рынков и акций) Представление докладов, решение разноуровневых задач	6		5			ПК - 2.2.2

4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ							
Код	Наименование разделов, тем и видов работы	Очная форма				*Код индикатора достижения компетенции	
		Се-местр	Часы				
			Лек	Пр	Л		СР
1.12	Тема 4 Рыночные мультипликаторы в фундаментальном анализе (сопоставление фондовых рынков и акций) Проработка лекционного материала, подготовка докладов, решение разноуровневых задач подготовка к тестированию	6				8	ПК - 2.2.2
1.13	Тема 5. Моделирование положения инвестора и ценообразование финансовых активов. Модификации моделей с учетом возможностей формирования параметров и недиверсифицированной позиции инвесторов	6	3				ПК - 2.2.2
1.14	Тема 5. Моделирование положения инвестора и ценообразование финансовых активов. Модификации моделей с учетом возможностей формирования параметров и недиверсифицированной позиции инвесторов Представление докладов, решение разноуровневых задач	6		4			ПК - 2.2.2
1.15	Тема 5. Моделирование положения инвестора и ценообразование финансовых активов. Модификации моделей с учетом возможностей формирования параметров и недиверсифицированной позиции инвесторов Проработка лекционного материала, решение разноуровневых задач подготовка докладов, подготовка к тестированию	6				8	ПК - 2.2.2
1.16	Тема 6 Анализ ликвидности финансовых активов (акций)	6	3				ПК - 2.3.2
1.17	Тема 6 Анализ ликвидности финансовых активов (акций) Представление докладов, решение разноуровневых задач	6		5/2			ПК - 2.3.2
1.18	Тема 6 Анализ ликвидности финансовых активов (акций) Проработка лекционного материала, подготовка докладов, подготовка к тестированию, решение разноуровневой задачи	6				8	ПК - 2.3.2
1.19	Тема 7 Основные постулаты и предпосылки технического анализа. Принципы графического анализа ценных бумаг	6	2				ПК - 2.3.2
1.20	Тема 7 Основные постулаты и предпосылки технического анализа. Принципы графического анализа ценных бумаг Представление докладов, решение разноуровневых задач	6		5			ПК - 2.3.2
1.21	Тема 7 Основные постулаты и предпосылки технического анализа. Принципы графического анализа ценных бумаг Проработка лекционного материала, решение разноуровневых задач, подготовка докладов, подготовка к тестированию	6				9	ПК - 2.3.2

4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ							
Код	Наименование разделов, тем и видов работы	Очная форма				*Код индикатора достижения компетенции	
		Се-местр	Часы				
			Лек	Пр	Л		СР
	Форма промежуточной аттестации - зачет					ПК - 2.1.1 ПК - 2.1.3 ПК – 2.2.2 ПК – 2.3.2	
<b>2.0</b>	<b>Раздел 2. Инструменты и методы анализа</b>	<b>7</b>	<b>14</b>	<b>28</b>		<b>66</b> ПК - 2.1.1 ПК - 2.1.3 ПК - 2.2.2 ПК - 2.3.2	
2.1	Тема 8 Тенденции на рынке ценных бумаг и принципы их выявления	7	3			ПК - 2.1.1	
2.2	Тема 8 Тенденции на рынке ценных бумаг и принципы их выявления Представление докладов, решение разноуровневых задач	7		6		ПК - 2.1.1	
2.3	Тема 8 Тенденции на рынке ценных бумаг и принципы их выявления Проработка лекционного материала, решение разноуровневых задач, подготовка докладов, подготовка к тестированию	7			6	ПК - 2.1.1	
2.4	Тема 9 Графические модели перелома и продолжения тенденции	7	4			ПК - 2.1.3	
2.5	Тема 9 Графические модели перелома и продолжения тенденции Представление докладов, решение разноуровневых задач	7		6		ПК - 2.1.3	
2.6	Тема 9 Графические модели перелома и продолжения тенденции Проработка лекционного материала, подготовка докладов, решение разноуровневых задач, подготовка к тестированию	7			6	ПК - 2.1.3	
2.7	Тема 10 Индикаторы технического анализа: виды и применение для построения торговых стратегий	7	3			ПК - 2.2.2	
2.8	Тема 10 Индикаторы технического анализа: виды и применение для построения торговых стратегий Представление докладов, решение разноуровневых задач	7		5		ПК - 2.2.2	
2.9	Тема 10 Индикаторы технического анализа: виды и применение для построения торговых стратегий Проработка лекционного материала, подготовка докладов, подготовка к тестированию	7			6	ПК - 2.2.2	
2.10	Тема 11 Осцилляторы: виды и применение для построения торговых стратегий	7	3			ПК - 2.3.2	
2.11	Тема 11 Осцилляторы: виды и применение для построения торговых стратегий Представление докладов, решение разноуровневых задач	7		6		ПК - 2.3.2	
2.12	Тема 11 Осцилляторы: виды и применение для построения торговых стратегий Проработка лекционного материала, подготовка докладов, подготовка к тестированию	7			6	ПК - 2.3.2	

4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ							
Код	Наименование разделов, тем и видов работы	Очная форма				*Код индикатора достижения компетенции	
		Се-местр	Часы				
			Лек	Пр	Л		СР
2.13	Тема 12 Специальные методы технического анализа ценных бумаг. Практические аспекты построения торговых стратегий на российском фондовом рынке	7	3				ПК - 2.3.2
2.14	Тема 12 Специальные методы технического анализа ценных бумаг. Практические аспекты построения торговых стратегий на российском фондовом рынке Представление докладов, решение разноуровневых задач	7		5			ПК - 2.3.2
2.15	Тема 12 Специальные методы технического анализа ценных бумаг. Практические аспекты построения торговых стратегий на российском фондовом рынке Проработка лекционного материала, подготовка докладов, подготовка к тестированию	7				6	ПК - 2.3.2
	Выполнение курсовой работы	7				36	ПК - 2.1.1 ПК - 2.1.3 ПК – 2.2.2 ПК – 2.3.2
	Форма промежуточной аттестации - экзамен					36	ПК - 2.1.1 ПК - 2.1.3 ПК – 2.2.2 ПК – 2.3.2

\* Код индикатора достижения компетенции проставляется или для всего раздела, или для каждой темы, или для каждого вида работы.

Примечание. В разделе через косую черту указываются часы, реализуемые в форме практической подготовки.

5 ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ
Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по дисциплине оформлен в виде приложения № 1 к рабочей программе дисциплины и размещен в электронной информационно-образовательной среде Института, доступной обучающемуся через его личный кабинет

6 УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ		
6.1 Учебная литература		
6.1.1 Основная литература		
	Библиографическое описание	Кол-во экз. в библиотеке/онлайн
6.1.1.1	Галанов, В. А. Производные финансовые инструменты : учебник / В.А. Галанов. — 2-е изд, перераб. и доп. — Москва : ИНФРА-М, 2022. — 221 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). — DOI 10.12737/21804. - ISBN 978-5-16-012272-4. - Текст : электронный. - URL: <a href="https://znanium.com/catalog/product/1859839">https://znanium.com/catalog/product/1859839</a> (дата обращения: 23.04.2024)	онлайн



6.1.1.2	Селюков, В. К. Производные финансовые инструменты : учебник / В. К. Селюков. — Сочи : РосНОУ, 2015. — 328 с. — ISBN 978-5-89789-097-2. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <a href="https://e.lanbook.com/book/162181">https://e.lanbook.com/book/162181</a> (дата обращения: 23.04.2024)	онлайн
<b>6.1.2 Дополнительная литература</b>		
	Библиографическое описание	Кол-во экз. в библиотеке/онлайн
6.1.2.1	Павлова, Е. В. Ценные бумаги и производные финансовые инструменты : учебное пособие / Е. В. Павлова. — Тольятти : ТГУ, 2016. — 182 с. — ISBN 978-5-8259-0957-8. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <a href="https://e.lanbook.com/book/139777">https://e.lanbook.com/book/139777</a> (дата обращения: 23.04.2024)	онлайн
6.1.2.2	Смирнов, И. Ф. Производные финансовые инструменты : учебное пособие / И. Ф. Смирнов. — Санкт-Петербург : ИЭО СПбУТУиЭ, 2011. — 313 с. — ISBN 978-5-94047-422-7. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <a href="https://e.lanbook.com/book/63980">https://e.lanbook.com/book/63980</a> (дата обращения: 23.04.2024)	онлайн
6.1.2.3	Федотова, М. Ю. Финансовые рынки и финансово-кредитные институты : учебное пособие / М. Ю. Федотова. — Пенза : ПГАУ, 2020. — 212 с. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <a href="https://e.lanbook.com/book/170947">https://e.lanbook.com/book/170947</a> (дата обращения: 23.04.2024)	онлайн
<b>6.1.3 Учебно-методические разработки (в т. ч. для самостоятельной работы обучающихся)</b>		
	Библиографическое описание	Кол-во экз. в библиотеке/онлайн/ЭИОС
6.1.3.1	Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках: учебно-методическое пособие для практических занятий и самостоятельных работ	рукопись
6.1.3.2	Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках: методические указания по выполнению курсовых работ	рукопись
<b>6.2 Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»</b>		
6.2.1	АСУ Библиотека ЗаБИЖТ <a href="http://zabizht.ru">http://zabizht.ru</a>	
6.2.2	ЭБС «Лань» <a href="https://e.lanbook.com">https://e.lanbook.com</a>	
	ЭБС «Знаниум» <a href="http://znanium.com/">http://znanium.com/</a>	
<b>6.3 Программное обеспечение и информационные справочные системы</b>		
<b>6.3.1 Базовое программное обеспечение</b>		
6.3.1.1	Microsoft Windows 7 Professional, лицензия № 49156201, государственный контракт от 03.10.2011 г. № 139/53-ОАЭ-11	
6.3.1.2	Microsoft Office 2007 Standard, лицензия № 45777622, государственный контракт от 10.08.2009 г. №64/17-ОА-09; Microsoft Office 2007 Standard, лицензия № 44718393, государственный контракт от 18.10.2008 г. № 92/32А-08	
6.3.1.3	Яндекс. Браузер. Прикладное программное обеспечение общего назначения, Офисные приложения, лицензия – свободно распространяемое программное обеспечение по лицензии BSD License	
6.3.1.4	АСУ «Библиотека», свидетельство о государственной регистрации программы для ЭВМ № 2009611107, зарегистрировано в Реестре программ для ЭВМ 19.02.2009	
6.3.1.5	БД АСУ «Библиотека», свидетельство о государственной регистрации программы для ЭВМ № 2009620102, зарегистрировано в Реестре программ для ЭВМ 27.02.2009	
<b>6.3.2 Специализированное программное обеспечение</b>		
6.3.2.1	Не предусмотрено	
<b>6.3.3 Информационные справочные системы</b>		
6.3.3.1	Информационно-справочная система «Гарант»	
<b>6.4 Правовые и нормативные документы</b>		
6.4.1	Не предусмотрено	

**7 ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ УЧЕБНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ**

1	Учебный и лабораторный корпуса ЗаБИЖТ ИрГУПС находятся по адресу: 672040 Забайкальский
---	--

	край, город Чита, улица Магистральная, дом 11
2	Учебная аудитория 4.31 для проведения лекционных и практических занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, укомплектованная специализированной мебелью и техническими средствами обучения (мультимедиапроектор, экран, ноутбук (переносной)), служащими для представления учебной информации большой аудитории. Для проведения занятий лекционного типа имеются учебно-наглядные пособия (презентации, плакаты), обеспечивающие тематические иллюстрации содержания дисциплины
3	Учебная аудитория 4.33 для проведения практических занятий, лабораторных работ, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, укомплектованная специализированной мебелью и техническими средствами обучения (мультимедиапроектор, экран, компьютерная техника с подключением к сети Интернет, обеспечивающая доступ в электронную информационно-образовательную среду ЗаБИЖТ ИрГУПС)
4	Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены специализированной мебелью и компьютерной техникой, подключенной к информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», и обеспечены доступом в электронную информационно-образовательную среду ЗаБИЖТ. Помещения для самостоятельной работы обучающихся: - читальный зал; - 3.24, 4.15.
5	Помещение 3.25 для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования. Оснащенность: компьютеры, ручной слесарный инструмент, электротехнический инструмент, принадлежности для пайки, мебель, учебно-наглядные пособия

## 8 МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

Вид учебной деятельности	Организация учебной деятельности обучающегося
Лекция	<p>На лекциях обучающиеся получают самые необходимые данные, во многом дополняющие и корректирующие учебники. Умение сосредоточенно слушать лекции, активно, творчески воспринимать излагаемые сведения является непременным условием их глубокого и прочного усвоения, а также развития умственных способностей.</p> <p>Лекция (от латинского «lectio» – чтение) – вид аудиторных учебных занятий. Лекция: закладывает основы научных знаний в систематизированной, последовательной, обобщенной форме; раскрывает состояние и перспективы развития соответствующей области науки и техники; концентрирует внимание обучающихся на наиболее сложных, узловых вопросах; стимулирует познавательную активность обучающихся.</p> <p>Во время лекционных занятий обучающийся должен уметь сконцентрировать внимание на изучаемых проблемах и включить в работу все виды памяти: словесную, образную и моторно-двигательную. Для этого весь материал, излагаемый преподавателем, обучающемуся необходимо конспектировать. В конспект рекомендуется выписывать определения, формулировки и т.п. На полях конспекта следует помечать вопросы, выделенные обучающимся для консультации с преподавателем. Полезно составить краткий справочник, содержащий определения важнейших понятий дисциплины. К каждой лекции следует разобрать материал предыдущей лекции. Изучая материал по учебнику или конспекту лекций, следует переходить к следующему вопросу только в том случае, когда хорошо усвоен предыдущий вопрос. При этом необходимо воспроизводить на бумаге все рассуждения, как имеющиеся в учебнике или конспекте. Ряд вопросов дисциплины может быть вынесен на самостоятельное изучение. Такое задание требует оперативного выполнения. В конспекте лекций необходимо оставить место для освещения упомянутых вопросов. Обозначить вопросы, термины, материал, который вызывает трудности, пометить и попытаться найти ответ в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удастся разобраться в материале, то необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на консультации, на практическом занятии</p>
Практическое занятие	<p>Практическое занятие – вид аудиторных учебных занятий, целенаправленная форма организации учебного процесса, при реализации которой обучающиеся по заданию и под руководством преподавателя выполняют практические задания. Практические задания направлены на углубление научно-теоретических знаний и овладение определенными методами работы, в процессе которых вырабатываются умения и навыки выполнения тех или иных учебных действий в данной сфере науки.</p>

	<p>Практические занятия развивают научное мышление и речь, позволяют проверить знания обучающихся, выступают как средства оперативной обратной связи; цель практических занятий – углублять, расширять, детализировать знания, полученные на лекции, в обобщенной форме и содействовать выработке навыков профессиональной деятельности.</p> <p>На практических занятиях подробно рассматриваются основные вопросы дисциплины, разбираются основные типы задач, ситуации. К каждому практическому занятию следует заранее самостоятельно выполнить домашнее задание и выучить лекционный материал к следующей теме. Систематическое выполнение домашних заданий обязательно и является важным фактором, способствующим успешному усвоению дисциплины.</p> <p>Практическая подготовка, включаемая в практические занятия, предполагает выполнение обучающимся отдельных элементов работ, связанных с будущей профессиональной деятельностью и направленных на формирование умений и практических навыков.</p>
Самостоятельная работа	<p>Обучение по дисциплине предусматривает активную самостоятельную работу обучающегося. В разделе 4 рабочей программы, который называется «Структура и содержание дисциплины», все часы самостоятельной работы расписаны по темам и вопросам. Обучающийся изучает учебный материал и если, несмотря на изученный материал, задания выполнить не удастся, то в обязательном порядке необходимо посетить консультацию преподавателя, ведущего практические занятия и/или консультацию лектора.</p> <p>Самостоятельная работа обучающегося является основным средством овладения учебным материалом во время, свободное от обязательных учебных занятий. Самостоятельная работа обучающегося над усвоением учебного материала может выполняться в библиотеке, аудиториях для самостоятельной работы, а также в домашних условиях. Учебный материал учебной дисциплины, предусмотренный учебным планом для усвоения обучающимся в процессе самостоятельной работы, выносится на промежуточную аттестацию наряду с учебным материалом, который разрабатывался при проведении учебных занятий.</p> <p>Содержание самостоятельной работы обучающегося определяется учебной программой дисциплины, методическими материалами, заданиями и указаниями преподавателя.</p> <p>Самостоятельная работа обучающихся осуществляется в аудиторной и внеаудиторной формах</p>
<p>Комплекс учебно-методических материалов по всем видам учебной деятельности, предусмотренным рабочей программой дисциплины, размещен в электронной информационно-образовательной среде ЗаБИЖТ ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет</p>	

# **Приложение № 1 к рабочей программе**

## **ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ**

**для проведения текущего контроля успеваемости  
и промежуточной аттестации**

## 1. Общие положения

Фонд оценочных средств (ФОС) является составной частью нормативно-методического обеспечения системы оценки качества освоения обучающимися образовательной программы.

Фонды оценочных средств предназначены для использования обучающимися, преподавателями, администрацией Института, а также сторонними образовательными организациями для оценивания качества освоения образовательной программы и уровня сформированности компетенций у обучающихся.

В соответствии с требованиями действующего законодательства в сфере образования, оценочные средства представляются в виде ФОС для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине, практике. С учетом действующего в Институте Положения о формах, периодичности и порядке текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся (высшее образование – бакалавриат, специалитет, магистратура), в состав ФОС для проведения промежуточной аттестации по дисциплине, практике включаются оценочные средства для проведения текущего контроля успеваемости обучающихся.

Задачами ФОС являются:

- оценка достижений обучающихся в процессе изучения дисциплины или прохождения практики;
- обеспечение соответствия результатов обучения задачам будущей профессиональной деятельности через совершенствование традиционных и внедрение инновационных методов обучения в образовательный процесс;
- самоподготовка и самоконтроль обучающихся в процессе обучения.

Фонд оценочных средств сформирован на основе ключевых принципов оценивания: валидность, надежность, объективность, эффективность.

Для оценки уровня сформированности компетенций используется трехуровневая система:

- минимальный уровень освоения, обязательный для всех обучающихся по завершению освоения ОПОП; дает общее представление о виде деятельности, основных закономерностях функционирования объектов профессиональной деятельности, методов и алгоритмов решения практических задач;
- базовый уровень освоения, превышение минимальных характеристик сформированности компетенций; позволяет решать типовые задачи, принимать профессиональные и управленческие решения по известным алгоритмам, правилам и методикам;
- высокий уровень освоения, максимально возможная выраженность характеристик компетенций; предполагает готовность решать практические задачи повышенной сложности, нетиповые задачи, принимать профессиональные и управленческие решения в условиях неполной определенности, при недостаточном документальном, нормативном и методическом обеспечении.

## 2. Перечень компетенций, в формировании которых участвует дисциплина. Программа контрольно-оценочных мероприятий. Показатели оценивания компетенций, критерии оценки

Дисциплина «Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках» участвует в формировании компетенции:

ПК-2.1 - Способен проводить исследования финансового рынка и систематизацию предложений финансовых услуг (включая действующие правила и условия, тарифной политики и действующих форм документации)

ПК-2.2- Способен организовывать и поддерживать долгосрочные отношения со стратегическими партнерскими организациями (рейтинговыми агентствами, аудиторскими организациями, оценочными фирмами, информационными агентствами)

ПК-2.3 Способен взаимодействовать с потенциальными потребителями финансовых услуг с целью выявления платежеспособного спроса и мониторинга финансовых возможностей клиента

### Программа контрольно-оценочных мероприятий очная форма обучения

№	Наименование контрольно-оценочного мероприятия	Объект контроля (раздел/тема дисциплины)	Код индикатора достижения компетенции	Наименование оценочного средства (форма проведения*)
<b>6 семестр</b>				
1	Текущий контроль	Тема 1 Основные понятия и предпосылки фундаментального анализа	ПК - 2.1.1	Доклад (устно)
2	Текущий контроль	Тема 2 Особенности аналитической работы на финансовых рынках	ПК - 2.1.1	Доклад (устно)
3	Текущий контроль	Тема 3. Два направления проведения фундаментального анализа: «сверху-вниз» и «снизу-вверх»	ПК - 2.1.3	Доклад (устно), тестирование (компьютерные технологии) В рамках ПП***: решение разноуровневых задач (письменно)
4	Текущий контроль	Тема 4 Рыночные мультипликаторы в фундаментальном анализе (сопоставление фондовых рынков и акций)	ПК - 2.2.2	Доклад (устно), решение разноуровневых задач (письменно)
5	Текущий контроль	Тема 5. Моделирование положения инвестора и ценообразование финансовых активов. Модификации моделей с учетом возможностей формирования параметров и недиверсифицированной позиции инвесторов	ПК - 2.2.2	Доклад (устно), решение разноуровневых задач (письменно)
6	Текущий контроль	Тема 6 Анализ ликвидности финансовых активов (акций)	ПК - 2.3.2	Доклад (устно), В рамках ПП***: решение разноуровневых задач (письменно)
7	Текущий контроль	Тема 7 Основные постулаты и предпосылки технического анализа. Принципы графического анализа ценных бумаг	ПК - 2.3.2	Доклад (устно), решение разноуровневых задач (письменно)
9	Форма промежуточной аттестации	Раздел 1. Фундаментальный и технический анализ	ПК - 2.1.1 ПК - 2.1.3 ПК - 2.2.2 ПК - 2.3.2	Зачет (собеседование), зачет - тестирование (компьютерные технологии)
<b>7 семестр</b>				

10	Текущий контроль	Тема 8 Тенденции на рынке ценных бумаг и принципы их выявления	ПК - 2.1.1	Доклад (устно), решение разноуровневых задач (письменно)
11	Текущий контроль	Тема 9 Графические модели перелома и продолжения тенденции	ПК - 2.1.3	Доклад (устно), решение разноуровневых задач (письменно)
12	Текущий контроль	Тема 10 Индикаторы технического анализа: виды и применение для построения торговых стратегий	ПК - 2.2.2	Доклад (устно), решение разноуровневых задач (письменно)
13	Текущий контроль	Тема 11 Осцилляторы: виды и применение для построения торговых стратегий	ПК - 2.3.2	Доклад (устно), решение разноуровневых задач (письменно)
14	Текущий контроль	Тема 12 Специальные методы технического анализа ценных бумаг. Практические аспекты построения торговых стратегий на российском фондовом рынке	ПК - 2.3.2	Доклад (устно), решение разноуровневых задач (письменно)
	Текущий контроль	Раздел 2. Инструменты и методы анализа	ПК - 2.1.1 ПК - 2.1.3 ПК - 2.2.2 ПК - 2.3.2	Тестирование (компьютерные технологии)
	Текущий контроль	Раздел 1. Фундаментальный и технический анализ Раздел 2. Инструменты и методы анализа	ПК - 2.1.1 ПК - 2.1.3 ПК - 2.2.2 ПК - 2.3.2	Выполнение курсовой работы (письменно)
18	Форма промежуточной аттестации	Раздел 1. Фундаментальный и технический анализ Раздел 2. Инструменты и методы анализа	ПК - 2.1.1 ПК - 2.1.3 ПК - 2.2.2 ПК - 2.3.2	Экзамен (собеседование), экзамен - тестирование (компьютерные технологии), защита курсовой работы (устно)

\*Форма проведения контрольно-оценочного мероприятия: устно, письменно, компьютерные технологии.

\*\*ПП – практическая подготовка.

### **Описание показателей и критериев оценивания компетенций. Описание шкал оценивания**

Контроль качества освоения дисциплины включает в себя текущий контроль успеваемости и промежуточную аттестацию. Текущий контроль успеваемости и промежуточная аттестация обучающихся проводятся в целях установления соответствия достижений обучающихся поэтапным требованиям образовательной программы к результатам обучения и формирования компетенций.

Текущий контроль успеваемости – основной вид систематической проверки знаний, умений, навыков обучающихся. Задача текущего контроля – оперативное и регулярное управление учебной деятельностью обучающихся на основе обратной связи и корректировки. Результаты оценивания учитываются в виде средней оценки при проведении промежуточной аттестации.

Для оценивания результатов обучения используется двухбалльная шкала: «зачтено», «не зачтено» и четырехбалльная оценочная шкала: «отлично», «хорошо», «удовлетворительно» и «неудовлетворительно».

Перечень оценочных средств, используемых для оценивания компетенций на различных этапах их формирования, а также краткая характеристика этих средств приведены в таблице

№	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в ФОС
1	Доклад	Продукт самостоятельной работы обучающегося, представляющий собой публичное выступление по	Темы докладов

		представлению полученных результатов решения определенной учебно-практической, учебно-исследовательской или научной темы. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	
2	Разноуровневые задачи	Различают задачи: – репродуктивного уровня, позволяющие оценивать и диагностировать знание фактического материала (базовые понятия, алгоритмы, факты) и умение правильно использовать специальные термины и понятия, узнавание объектов изучения в рамках определенного раздела дисциплины; может быть использовано для оценки знаний и умений обучающихся; – реконструктивного уровня, позволяющие оценивать и диагностировать умения синтезировать, анализировать, обобщать фактический и теоретический материал с формулированием конкретных выводов, установлением причинно-следственных связей; может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся; – творческого уровня, позволяющие оценивать и диагностировать умения, интегрировать знания различных областей, аргументировать собственную точку зрения; может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Типовые разноуровневые задачи
3	Тестирование (компьютерные технологии)	Система стандартизированных заданий, позволяющая автоматизировать процедуру измерения уровня знаний и умений обучающегося. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Фонд тестовых заданий
4	Выполнение курсовой работы	Позволяет оценить умения обучающихся самостоятельно конструировать свои знания в процессе решения практических задач и проблем, ориентироваться в информационном пространстве и уровень сформированности аналитических, исследовательских навыков, навыков практического и творческого мышления. Может выполняться в индивидуальном порядке или группой обучающихся. Может быть использовано для оценки умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся в предметной или межпредметной областях	Типовое задание для выполнения курсовой работы

### Промежуточная аттестация

1	Защита курсовой работы	Позволяет оценить умения обучающихся самостоятельно конструировать свои знания в процессе решения практических задач и проблем, ориентироваться в информационном пространстве и уровень сформированности аналитических, исследовательских навыков, навыков практического и творческого мышления. Может выполняться в индивидуальном порядке или группой обучающихся. Может быть использовано для оценки умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся в предметной или межпредметной областях	Типовые вопросы для защиты курсовой работы
2	Зачет	Средство, позволяющее оценить знания, умения, навыков и (или) опыта деятельности обучающегося по дисциплине. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Перечень теоретических вопросов и типовое (ые) практическое (ие) задание (я) к зачету



3	Экзамен	Средство, позволяющее оценить знания, умения, навыков и (или) опыта деятельности обучающегося по дисциплине. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Перечень теоретических вопросов и типовое (ые) практическое (ие) задание (я) к экзамену (образец экзаменационного билета)
4	Тест – промежуточная аттестация в форме зачета	Система автоматизированного контроля освоения компетенций (части компетенций) обучающимся по дисциплине с использованием информационно-коммуникационных технологий. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Фонд тестовых заданий
5	Тест – промежуточная аттестация в форме экзамена	Система автоматизированного контроля освоения компетенций (части компетенций) обучающимся по дисциплине с использованием информационно-коммуникационных технологий. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Фонд тестовых заданий

**Критерии и шкалы оценивания компетенций в результате изучения дисциплины при проведении промежуточной аттестации в форме зачета. Шкала оценивания уровня освоения компетенций**

Шкала оценивания	Критерии оценивания	Уровень освоения компетенции
«зачтено»	Обучающийся правильно ответил на теоретические вопросы. Показал отличные знания в рамках учебного материала. Правильно выполнил практические задания. Показал отличные умения и владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Ответил на все дополнительные вопросы	Высокий
	Обучающийся с небольшими неточностями ответил на теоретические вопросы. Показал хорошие знания в рамках учебного материала. С небольшими неточностями выполнил практические задания. Показал хорошие умения и владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Ответил на большинство дополнительных вопросов	Базовый
	Обучающийся с существенными неточностями ответил на теоретические вопросы. Показал удовлетворительные знания в рамках учебного материала. С существенными неточностями выполнил практические задания. Показал удовлетворительные умения и владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Допустил много неточностей при ответе на дополнительные вопросы	Минимальный
«не зачтено»	Обучающийся при ответе на теоретические вопросы и при выполнении практических заданий продемонстрировал недостаточный уровень знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. При ответах на дополнительные вопросы было допущено	Компетенция не сформирована

	множество неправильных ответов	
--	--------------------------------	--

**Критерии и шкалы оценивания компетенций в результате изучения дисциплины при проведении промежуточной аттестации в форме экзамена. Шкала оценивания уровня освоения компетенций**

Шкалы оценивания	Критерии оценивания	Уровень освоения компетенции
«отлично»	Обучающийся правильно ответил на теоретические вопросы. Показал отличные знания в рамках учебного материала. Правильно выполнил практические задания. Показал отличные умения и владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Ответил на все дополнительные вопросы	Высокий
«хорошо»	Обучающийся с небольшими неточностями ответил на теоретические вопросы. Показал хорошие знания в рамках учебного материала. С небольшими неточностями выполнил практические задания. Показал хорошие умения и владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Ответил на большинство дополнительных вопросов	Базовый
«удовлетворительно»	Обучающийся с существенными неточностями ответил на теоретические вопросы. Показал удовлетворительные знания в рамках учебного материала. С существенными неточностями выполнил практические задания. Показал удовлетворительные умения и владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Допустил много неточностей при ответе на дополнительные вопросы	Минимальный
«неудовлетворительно»	Обучающийся при ответе на теоретические вопросы и при выполнении практических заданий продемонстрировал недостаточный уровень знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. При ответах на дополнительные вопросы было допущено множество неправильных ответов	Компетенция не сформирована

**Защита курсовой работы**

Шкала оценивания	Критерии оценивания
«отлично»	Содержание курсовой работы полностью соответствует заданию. Представлены результаты обзора литературных и иных источников. Структура контрольной работы логически и методически выдержана. Все выводы и предложения убедительно аргументированы. Оформление контрольной работы и полученные результаты полностью отвечают требованиям, изложенным в методических указаниях. При защите контрольной работы обучающийся правильно и уверенно отвечает на вопросы преподавателя, демонстрирует глубокое знание теоретического материала, способен аргументировать собственные утверждения и выводы
«хорошо»	Содержание курсовой работы полностью соответствует заданию. Представлены результаты обзора литературных и иных источников. Структура контрольной работы логически и методически выдержана. Большинство выводов и предложений аргументировано. Оформление контрольной работы и полученные результаты в целом отвечают требованиям, изложенным в методических указаниях. Имеются одна-две несущественные ошибки в использовании терминов, в построенных диаграммах и схемах. Наличествует незначительное количество грамматических и/или стилистических ошибок. Программа демонстрирует устойчивую работу на тестовых наборах исходных данных, подготовленных обучающимся, но обрабатывает не все исключительные ситуации. При защите контрольной работы обучающийся правильно и уверенно отвечает на большинство вопросов преподавателя, демонстрирует хорошее

	знание теоретического материала, но не всегда способен аргументировать собственные утверждения и выводы. При навоящих вопросах преподавателя исправляет ошибки в ответе
«удовлетворительно»	Содержание курсовой работы частично не соответствует заданию. Результаты обзора литературных и иных источников представлены недостаточно полно. Есть нарушения в логике изложения материала. Аргументация выводов и предложений слабая или отсутствует. Имеются одно-два существенных отклонений от требований в оформлении курсового проекта. Полученные результаты в целом отвечают требованиям, изложенным в методических указаниях. Имеются одна-две существенных ошибки в использовании терминов, в построенных диаграммах и схемах. Много грамматических и/или стилистических ошибок. Программа работает неустойчиво, не обрабатывает исключительные ситуации, тестовые наборы исходных данных не подготовлены. При защите контрольной работы обучающийся допускает грубые ошибки при ответах на вопросы преподавателя и /или не дал ответ более чем на 30% вопросов, демонстрирует слабое знание теоретического материала, в большинстве случаев не способен уверенно аргументировать собственные утверждения и выводы
«неудовлетворительно»	Содержание курсовой работы в целом не соответствует заданию. Имеются более двух существенных отклонений от требований в оформлении курсового проекта. Большое количество существенных ошибок по сути работы, много грамматических и стилистических ошибок и др. Полученные результаты не отвечают требованиям, изложенным в методических указаниях. Программа не разработана и/или находится в нерабочем состоянии. При защите контрольной работы обучающийся демонстрирует слабое понимание программного материала. Контрольная работа не представлена преподавателю. Обучающийся не явился на защиту контрольной работы

#### Тест – промежуточная аттестация в форме зачета:

Шкала оценивания	Критерии оценивания
«зачтено»	Обучающийся верно ответил на 70 % и более тестовых заданий при прохождении тестирования
«не зачтено»	Обучающийся верно ответил на 69 % и менее тестовых заданий при прохождении тестирования

#### Тест – промежуточная аттестация в форме экзамена:

Шкала оценивания	Критерии оценивания
«отлично»	Обучающийся верно ответил на 90 – 100 % тестовых заданий при прохождении тестирования
«хорошо»	Обучающийся верно ответил на 80 – 89 % тестовых заданий при прохождении тестирования
«удовлетворительно»	Обучающийся верно ответил на 70 – 79 % тестовых заданий при прохождении тестирования
«неудовлетворительно»	Обучающийся верно ответил на 69 % и менее тестовых заданий при прохождении тестирования

### Критерии и шкалы оценивания результатов обучения при проведении текущего контроля успеваемости

#### Доклад

Шкала оценивания	Критерии оценивания
«отлично»	Доклад создан с использованием компьютерных технологий (презентация Power Point, Flash–презентация, видео-презентация и др.) Используются дополнительные источники информации. Содержание заданной темы раскрыто в полном объеме. Отражена структура доклада (вступление, основная часть, заключение, присутствуют выводы и примеры). Оформление работы. Оригинальность выполнения (работа сделана самостоятельно, представлена впервые)
«хорошо»	Доклад создан с использованием компьютерных технологий (презентация Power

	Point, Flash–презентация, видео-презентация и др.) Содержание доклада включает в себя информацию из основных источников (методическое пособие), дополнительные источники информации не использовались. Содержание заданной темы раскрыто не в полном объеме. Структура доклада сохранена (вступление, основная часть, заключение, присутствуют выводы и примеры)
«удовлетворительно»	Доклад сделан устно, без использования компьютерных технологий. Содержание доклада ограничено информацией только из методического пособия. Содержание заданной темы раскрыто не в полном объеме. Отсутствуют выводы и примеры. Оригинальность выполнения низкая
«неудовлетворительно»	Доклад сделан устно, без использования компьютерных технологий и других наглядных материалов. Содержание ограничено информацией только из методического пособия. Заданная тема доклада не раскрыта, основная мысль сообщения не передана

### Разноуровневые задачи

Шкала оценивания	Критерии оценивания
«отлично»	Демонстрирует очень высокий/высокий уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Все требования, предъявляемые к заданию, выполнены
«хорошо»	Демонстрирует достаточно высокий/выше среднего уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Все требования, предъявляемые к заданию, выполнены
«удовлетворительно»	Демонстрирует средний уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Большинство требований, предъявляемых к заданию, выполнены. Демонстрирует низкий/ниже среднего уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Многие требования, предъявляемые к заданию, не выполнены
«неудовлетворительно»	Демонстрирует очень низкий уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Не ответа. Не было попытки выполнить задание

### Выполнение курсовой работы

Шкала оценивания	Критерии оценивания
«зачтено»	Раздел(ы) курсовой работы выполнен(ы) в установленный срок в полном объеме. В ходе выполнения раздела(ов) курсовой работы обучающийся демонстрирует высокий уровень теоретических знаний, практических умений и навыков (компетенций), позволяющих самостоятельно решать профессиональные задачи, делать теоретические обобщения и практические выводы. Раздел(ы) курсовой работы выполнен без замечаний
	Раздел(ы) курсовой работы выполнен(ы) в установленный срок в полном объеме. В ходе выполнения раздела(ов) курсовой работы обучающийся демонстрирует базовый уровень теоретических знаний, практических умений и навыков (компетенций), позволяющих решать профессиональные задачи, делать теоретические обобщения и практические выводы. В ходе разработки раздела(ов) курсовой работы обучающимся допущены небольшие неточности
	Раздел(ы) курсовой работы выполнен(ы) с задержкой в не полном объеме. В ходе выполнения раздела(ов) курсовой работы обучающийся демонстрирует минимальный уровень теоретических знаний, практических умений и навыков (компетенций), позволяющих решать профессиональные задачи, делать теоретические обобщения и практические выводы. В ходе разработки раздела(ов) курсовой работы обучающимся допущены серьезные ошибки и неточности
«не зачтено»	Раздел(ы) курсовой работы не выполнен(ы) или выполнен не по заданию преподавателя. Обучающийся не отвечает на вопросы преподавателя, связанные с ходом выполнения раздела(ов) курсовой работы, не демонстрирует теоретических знаний, практических умений и навыков (компетенций), позволяющих решать профессиональные задачи, делать теоретические обобщения и практические выводы

### Тестирование – текущий контроль:

Шкала оценивания	Критерии оценивания
«отлично»	Обучающийся верно ответил на 90 – 100 % тестовых заданий при прохождении

	тестирования
«хорошо»	Обучающийся верно ответил на 80 – 89 % тестовых заданий при прохождении тестирования
«удовлетворительно»	Обучающийся верно ответил на 70 – 79 % тестовых заданий при прохождении тестирования
«неудовлетворительно»	Обучающийся верно ответил на 69 % и менее тестовых заданий при прохождении тестирования

### **3. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности**

#### **3.1 Темы докладов**

Темы докладов выложены в электронной информационно-образовательной среде ЗаБИЖТ ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.

Ниже приведены темы докладов, предусмотренные рабочей программой дисциплины

##### Темы докладов

1. Концепция «разумного инвестирования» Б.Грэхема.
2. Гипотеза рационального поведения инвестора.
3. Методы анализа рыночных тенденций: ретроспективный анализ, прогнозирование будущих трендов.
4. Задачи отраслевого анализа.
5. Повышение значимости отраслевого прогнозирования и третье направление в фундаментальном анализе
6. Понятие ликвидности финансовых активов и ранжирование активов по ликвидности.
7. Индикаторы ликвидности (плотность, глубина, упругость, расчет относительного «бид-аск» спреда).
8. Понятие тенденции. Виды тенденций.
9. Графическое отображение тенденций. Графическое отображение параметров рынка ценных бумаг.
10. Растущий, падающий и боковой рынки.

#### **3.2 Типовые разноуровневые задачи (в рамках практической подготовки)**

Разноуровневые задачи выложены в электронной информационно-образовательной среде ЗаБИЖТ ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.

Ниже приведен образец разноуровневых задач по теме, предусмотренной рабочей программой дисциплины.

##### Образец разноуровневых задач, выполняемых в рамках практической подготовки

Задача 1. По компании на конец 2019 года известны следующие данные: рыночная цена акции 10 рублей, номинал акции 1 рубль, в обращении находится 1 млн. акций, на бирже обращается 10% акций от акций, находящихся на руках. Долгосрочный долг составляет 3 млн. рублей, краткосрочный 1 млн. рублей. Финансовый рычаг (долг/собственный капитал) равен единице. Денежные средства на счете и в кассе по отчетности равны 0,2 млн. рублей. Годовая выручка составила 3 млн. рублей, маржа операционной прибыли 30%.

Найдите рыночную капитализацию?

Найдите общую капитализацию (EV)?

Чему равна балансовая оценка одной акции?

Какой мультипликатор может использоваться для диагностирования инвестиционной привлекательности? Рассчитайте

Оцените показатель EBIT за 2019 год

Задача 2. Среднее значение мультипликатора P/e по отрасли равно 8, а средний мультипликатор M/BV (market to book) равен 3. По компании А этой отрасли составлены на следующий год прогнозные отчеты о прибылях и убытках и балансовый отчет. Прибыль следующего года оценивается на уровне 16 млн. дол., а значение собственного капитала по прогнозному балансу (сумма уставного капитала, добавочного и нераспределенной прибыли с резервами) составляет 45 млн. дол. Дайте прогноз оценки собственного капитала мультипликаторным методом (иначе называемом методом рыночных сравнений).

Задача 3. Активы компании ХХ на начало 2019 года 1000 млн. рублей, на конец 2019 года 2000 млн. рублей. Выручка за 2009 год составила 2800 млн. рублей. Маржа операционной прибыли (рентабельность продаж, РМ) 30%. Эффективная ставка налога на прибыль 28%. Оцените операционную прибыль за 2019 год и рассчитайте доходность активов (бизнеса). Что можно сказать о деятельности компании в 2019 году, если среднеотраслевая отдача по капиталу составляет 30%? Что можно сказать о положении владельца собственного капитала, если ROE по компании составляет 35% за 2019 год?

Задача 4. Выручка компании «Московские зонтики» за 2019 год составила 50 млн. рублей. Маржа (норма) чистой прибыли 5%. Оборачиваемость постоянно используемого капитала равна 3 (это устойчивое значение по компании, наблюдаемое за ряд лет). Финансовый рычаг (как отношение заемного капитала к собственному) равен единице. Оцените ROE по компании за 2019 год.

Задача 5. По компании коэффициент текущей ликвидности равен 1,5, а коэффициент быстрой ликвидности равен 0,1. Если разность текущих активов и денежных средств, их эквивалентов и краткосрочных ценных бумаг составляет 2,8 млн. рублей, чему равна величина текущих активов и краткосрочных обязательств.

Задача 6. Предприятие ООО «Агрегат» осуществляет следующие виды деятельности: производство агрегатов для дорожно-строительных машин; производство автозапчастей. Предприятие располагает значительными возможностями по выпуску продукции для автомобильной промышленности. За последний год, несмотря на рост выручки от реализации, наблюдается снижение уровня прибыльности предприятия. Совет директоров поручил финансовой службе провести анализ финансовой деятельности и предоставить доклад по итогам его проведения.

Используя баланс и отчет о финансовых результатах предприятия необходимо оценить финансовое состояние предприятия по следующим направлениям.

1. Анализ состава, структуры и динамики имущества и источников его формирования:

вертикальный анализ баланса; горизонтальный анализ баланса.

2. Оценка финансового положения:

анализ ликвидности баланса; анализ коэффициентов платёжеспособности; оценка финансовой устойчивости.

3. Оценка результативности:

оценка деловой активности; анализ неудовлетворительной структуры баланса неплатёжеспособных предприятий.

4. Оценка устойчивости экономического роста.

#### Баланс

АКТИВ	На 31.12.200n-1г.	На 31.12.200n1г.
Внеоборотные активы	63150	84675
Оборотные активы	141283	338330
В т.ч.:		
Запасы	34609	79845

Дебиторская задолженность	91510	227248
Краткосрочные финансовые вложения	15000	31221
Денежные средства	20	17
Баланс	204434	423006
<b>ПАССИВ</b>		
Капитал и резервы	652	679
Долгосрочные обязательства	27060	19846
Краткосрочные обязательства	176722	402480
В т.ч. Займы и кредиты	69018	120968
Кредиторская задолженность	107704	281512
Баланс	204434	423006

### Отчёт о финансовых результатах

ПОКАЗАТЕЛЬ	За 200n г.	За 200n-1 г.
Выручка от продажи товаров	629 640	419 934
Себестоимость проданных товаров	(553 965)	(382 325)
Валовая прибыль	75 675	37 609
Управленческие расходы	(28 671)	(23 140)
Прибыль от продаж	47 004	14 407
Проценты к получению	2 487	196
Проценты к уплате	(15 184)	(9 890)
Прочие доходы	604	4 552
Прочие расходы	(34 850)	(7 536)
Прибыль до налогообложения	61	1729
Налог на прибыль	(34)	(979)
Чистая прибыль	27	750

### 3.3 Типовое задание для выполнения курсовой работы

Типовое задание для выполнения курсовой работы выложено в электронной информационно-образовательной среде ЗаБИЖТ ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.

Ниже приведен образец типового задания для выполнения курсовой работы, предусмотренной рабочей программой дисциплины.

#### Образец типового задания для выполнения курсовой работы

Цель курсовой работы – изучение основ организации и технических приемов проведения финансового анализа, приобретение практических навыков в выполнении аналитических расчетов при оценке итоговых показателей финансовой деятельности организаций, экономическая интерпретация полученных в результате анализа данных и определение основных направлений поиска резервов и повышения эффективности деятельности. Анализ выполняется по публикуемым данным о работе организации).

Курсовую работу следует выполнять в строгой последовательности ее разделов, так как информационная база последующих разделов во многом основывается на сформированной, систематизированной и проверенной исходной информации предыдущих разделов.



Выполните курсовую работу на одну из тем:

1. Понятие справедливой рыночной стоимости и инвестиционные стратегии на фондовом рынке.
2. Многообразие показателей в рамках рыночного видения публичной компании.
3. Процесс выбора компаний. Методы и техники анализа переоцененности фондовых индексов.
4. Классические инвестиционные стратегии выбора рынков и отдельных компаний, строящиеся на анализе мультипликаторов.
5. Обоснование выбора мультипликатора и требования к обработке финансовых данных. Коррекция мультипликаторов на отраслевую специфику
6. Сбор информации для диагностирования ликвидности.
7. Переход от ликвидности отдельных активов к диагностированию динамики

### 3.4 Типовые вопросы для защиты курсовой работы

Типовые вопросы для защиты курсовой работы выложены в электронной информационно-образовательной среде ЗаБИЖТ ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.

Ниже приведен примерный перечень вопросов для защиты курсовой работы.

Примерный перечень вопросов для защиты курсовой работы

1. Назовите основные инвестиционные цели участника рынка ценных бумаг.
2. На чем базируется фундаментальный анализ рынка ценных бумаг?
3. Опишите направление проведения фундаментального анализа «сверху-вниз».
4. Что такое осцилляторы?
5. Назовите индикаторы ликвидности.
6. Назовите достоинства метода графического анализа.

### 3.5 Типовые контрольные задания для проведения тестирования

Фонд тестовых заданий по дисциплине содержит тестовые задания, распределенные по разделам и темам, с указанием их количества и типа.

Структура фонда тестовых заданий по дисциплине  
«Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках» (6 семестр)

Индикатор достижения компетенции	Тема в соответствии с РПД	Характеристика ТЗ	Количество тестовых заданий, типы ТЗ
ПК-2.1.1 - Осуществляет сбор информации по спросу на рынке финансовых услуг	Основные понятия и предпосылки фундаментального анализа	Знание	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Действие	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
	Особенности аналитической работы на финансовых рынках	Знание	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Действие	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-2.1.3. Проводит мониторинг информационных источников	Два направления проведения фундаментального анализа: «сверху-вниз» и «снизу- вверх»	Знание	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ

финансовой информации		Действие	2 – ОТЗ 0 – ЗТЗ
ПК-2.2.2 - Анализирует состояние и прогнозирует изменения инвестиционного и информационного рынков	Рыночные мультипликаторы в фундаментальном анализе (сопоставление фондовых рынков и акций)	Знание	2 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Умение	2 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Действие	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
	Моделирование положения инвестора и ценообразование финансовых активов. Модификации моделей с учетом возможностей формирования параметров и недиверсифицированной позиции инвесторов	Знание	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Действие	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-2.3.2 - Владеет навыкам сравнения параметров финансовых продуктов	Анализ ликвидности финансовых активов (акций)	Знание	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Действие	2 – ОТЗ 0 – ЗТЗ
	Основные постулаты и предпосылки технического анализа. Принципы графического анализа ценных бумаг	Знание	2 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Умение	2 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Действие	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
Автор Овечкина Е.П.	Итого		90: 45 – ОТЗ 45 – ЗТЗ

Полный комплект ФТЗ хранится в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС и обучающийся имеет возможность ознакомиться с демонстрационным вариантом ФТЗ.

Ниже приведен образец типового варианта итогового теста, предусмотренного рабочей программой дисциплины.

Образец типового варианта итогового теста,  
предусмотренного рабочей программой дисциплины

1 Основные инвестиционные цели участника рынка ценных бумаг:

- а) Поддержание уровня ликвидности вложений
- б) Формирование контрольного пакета акций
- в) Обеспечение доходности (рост курсовой стоимости)
- г) Формирование пропорциональной структуры производства
- д) Достижение безопасности вложений

2 Положения, характеризующие соответствие инвестиционных целей: доходность и надежность <:.....> пропорциональны.

3 Выберите правильные положения, характеризующие технический анализ рынка ценных бумаг:

- а) Включает микроанализ и макроанализ
- б) Требуется глубокого анализа предприятия-эмитента
- в) Считает, что «история повторяется»
- г) Базируется на фильтрующих, осцилляторных и концептуальных методах
- д) Базируется на всестороннем анализе состояния экономики в целом
- е) Исследует динамику цен на рынке ценных бумаг

- ё) Исследует динамику цен и объемы торгов на рынке ценных бумаг
- ж) Предполагает анализ спроса и предложения на рынке ценных бумаг

4 Положения, характеризующие фундаментальный анализ рынка ценных бумаг:

- а) Считает, что «история повторяется»
- б) Базируется на всестороннем анализе состояния экономики в целом
- в) Требуется глубокого анализа предприятия-эмитента
- г) Включает микроанализ и макроанализ
- д) Предполагает анализ только рынка ценных бумаг
- е) Базируется на фильтрующих, осцилляторных и концептуальных методах

5 <:.....:> – это совокупность активов, приобретенных инвестором в целях получения прибыли.

6 Нарастивать свои вложения в чистом виде (обеспечивать рост курсовой стоимости) могут <:.....:>.

7 Положение, характеризующее соответствие инвестиционных целей:

- а) Доходность и надежность обратно пропорциональны
- б) Доходность и надежность прямо пропорциональны
- в) Доходность и надежность – независимые величины

8<:.....:> – это торговый метод, основанный на проведении разнонаправленных сделок (купля-продажа) с подобными друг другу активами при возникновении в их стоимости финансовой разницы.

9 Договор доверительного управления при инвестициях в ПАММ называется <:.....:>.

10 Размещение рекламы на форекс форуме:

- а) Дает брокеру преимущество;
- б) Не дает брокеру никакого преимущества;
- в) Преимущество зависит от количества и места размещения рекламы;
- г) Исключает возможность попадания брокера в «Черный список».

11 6 постулатов технического анализа фондовых рынков были сформулированы в 1980 году (кем) <:.....:>.

12 Рост индексов и ценных бумаг на фондовых биржах носит название «биржевого <:.....:> »:

13 Проверка гипотезы эффективного рынка не возможна из-за

- а) отсутствия необходимых рядов данных (информации для принятия решения);
- б) не отражения в стандартной финансовой отчетности фактических событий в компании;
- в) проблемы совместного теста;
- г) ограниченного арбитража

14 Гипотеза «поведенческого инвестирования» отстаивает позиции о несоответствии реальных рынков предпосылкам фундаментального анализа

- а) об институциональных условиях функционирования;
- б) о поведении (мотивах, стимулах) участников рынка;

- в) о влиянии государства и регуляторов на условия функционирования рынков;  
 г) об уровне конкуренции на рынках

15 Аналитиков инвестиционных компаний, обслуживающих широкий круг инвесторов (клиентов), принято называть <:.....>.

16. Гарантия платежа по ценным бумагам — это <:.....>.

17. Сопоставьте понятие с подходящим определением

Фундаментальный анализ	метод оценки ценных бумаг, принадлежащих компании. Их можно рассмотреть, изучая бухгалтерские и финансовые отчеты организации.
Технический анализ	прогнозирование изменения цен в ближайшем будущем. Прогноз составляется на основе того, как цены менялись в прошлом при аналогичных обстоятельствах.

18. Укажите последовательность процедуры эмиссии (выпуска) ценных бумаг:

1	государственная регистрация отчета об итогах выпуска (дополнительного выпуска) ценных бумаг
2	утверждение решения о выпуске (дополнительном выпуске) ценных бумаг
3	изготовление сертификатов ценных бумаг (для документарной формы выпуска)
4	размещение ценных бумаг
5	принятие эмитентом решения о размещении эмиссионных ценных бумаг
6	государственная регистрация выпуска (дополнительного выпуска) ценных бумаг

### Структура фонда тестовых заданий по дисциплине

#### «Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках» (7 семестр)

Индикатор достижения компетенции	Тема в соответствии с РПД	Характеристика ТЗ	Количество тестовых заданий, типы ТЗ
ПК-2.1.1 - Осуществляет сбор информации по спросу на рынке финансовых услуг	Тенденции на рынке ценных бумаг и принципы их выявления	Знание	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Действие	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
ПК-2.1.3. Проводит мониторинг информационных источников финансовой информации	Графические модели перелома и продолжения тенденции	Знание	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Действие	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
ПК-2.2.2 - Анализирует состояние и прогнозирует изменения инвестиционного и информационного рынков	Индикаторы технического анализа: виды и применение для построения торговых стратегий	Знание	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Действие	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
ПК-2.3.2 - Владеет навыкам сравнения параметров финансовых продуктов	Осцилляторы: виды и применение для построения торговых стратегий	Знание	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Действие	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
	Специальные методы технического анализа ценных бумаг. Практические аспекты построения торговых стратегий на российском фондовом	Знание	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ

	рынке	Действие	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
Автор Овечкина Е.П.		Итого	90: 45 – ОТЗ 45 – ЗТЗ

Полный комплект ФТЗ хранится в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС и обучающийся имеет возможность ознакомиться с демонстрационным вариантом ФТЗ.

Ниже приведен образец типового варианта итогового теста, предусмотренного рабочей программой дисциплины.

Образец типового варианта итогового теста,  
предусмотренного рабочей программой дисциплины

1. Что такое рынок ценных бумаг?

- а) совокупность сделок, связанных с покупкой и продажей валюты;
- б) совокупность сделок с ценными бумагами;
- в) сделки с недвижимостью.

2. Что является главной задачей рынка ценных бумаг?

- а) привлечение капитала для политического развития;
- б) удовлетворение общественных потребностей;
- в) привлечение капитала для экономического развития.

3. Кто занимается осуществлением организованного рынка ценных бумаг? Ответ:

<:.....:>

4. Фьючерсные контракты обращаются только на <:.....:>.

5. Что из ниже перечисленного не является ценной бумагой?

- а) ваучер;
- б) чек;
- в) платежное поручение;
- г) опцион.

6. <:.....:> облигации – это облигации, которые могут быть обменены на акции.

7. Какие функции выполняет андеррайтер ценных бумаг?

- а) поддержки курса ценной бумаги
- б) гарантирования выполнения обязательств по ценным бумагам
- в) выкупа всего или части выпуска
- г) подготовки проспекта ценных бумаг
- д) спекулятивной игры на вторичном рынке в пользу эмитента

8. <:.....:> – это эмиссионная ценная бумага, закрепляющая права ее владельца на получение части прибыли акционерного общества в виде дивидендов на участие управлением акционерного общества и на часть имущества остающегося после его ликвидации.

9. К какой разновидности относятся ЦБ, которые выражают отношение совладения и предоставляющие их владельцу право долевого участия как в собственности, так и в прибыли эмитента? Ответ: <:.....:> ЦБ.

10. Выберите того, кто может обязываться векселем в РФ:

- а) только юридические лица
- б) только физические лица
- в) юридические и физические лица

11. <:.....:> - это именная ценная бумага, подтверждающая право владельца на долю в имуществе паевого инвестиционного фонда.

12. <:.....:> - активы за минусом обязательств.

13. Посредством чего производится уступка прав требования по именованным депозитам?

- а) бланкового индоссамент
- б) простого вручения
- в) цессией
- г) записью в реестре владельцев именных ценных бумаг
- д) именованным индоссаментом

14. Что происходит при покупке колл-опциона? Ответ: держатель опциона играет на повышение, а подписатель – <:.....:>.

15. Дайте определение понятию «учетная стоимость акции (NAV)».

- а) стоимость чистых активов АО в расчете на номинальную стоимость;
- б) стоимость чистых активов АО в расчете на акцию.+

16. Ценная бумага (ЦБ), которая закрепляет совокупность имущественных и неимущественных прав, подлежащих удостоверению, уступке и безусловному осуществлению с соблюдением форм и порядка – это <:.....:> ЦБ.

17. Установите соответствие между видами ценных бумаг и их характеристиками

Долевые	дают владельцу право на долю в уставном капитале компании. К категории долевым ценным бумагам относятся акции (как обыкновенные, так и привилегированные). Владельцы обыкновенных акций имеют право голоса на собрании акционеров
Производственные	удостоверяют, что эмитент должен держателю некую сумму (или передать держателю некое имущество). По сути, долговая расписка. В этой категории выпускают облигации, векселя, депозитные и сберегательные сертификаты банков и другие разновидности долговых ценных бумаг. Но не всегда расписка — ценная бумага. Например, коносаменты использовались во внешней торговле для подтверждения наличия договора о транспортировке товара.
Долговые	инструменты инвестирования, которые дают право (или обязывают) купить (или продать) базовый актив на оговоренных условиях. Базовым биржевым активом может быть ценная бумага (например, биржевой лот акций какой-либо компании), иностранная валюта или товар (например, баррель нефти определенного сорта). В этот класс входят фьючерсы, форварды, опционы эмитента и т. д.

18. Установите соответствие между видом ценной бумаги и определением:

Акции	государственная ценная бумага, обеспеченная залогом
«Золотой сертификат»	не дают право на участие в управлении предприятием
Облигации	форма вложения капитала
Привилегированные акции	именная государственная ценная бумага, обеспеченная и погашаемая

### **3.6 Перечень теоретических вопросов к зачету** (для оценки знаний)

1. Концепция «разумного инвестирования» Б.Грэхема.
2. Гипотеза рационального поведения инвестора.
3. Понятие справедливой рыночной стоимости и инвестиционные стратегии на фондовом рынке.
4. Многообразие показателей в рамках рыночного видения публичной компании.
5. Методы анализа рыночных тенденций: ретроспективный анализ, прогнозирование будущих трендов.
6. Повышение значимости отраслевого прогнозирования и третье направление в фундаментальном анализе.
7. Процесс выбора компаний.
8. Методы и техники анализа переоцененности фондовых индексов.
9. Классические инвестиционные стратегии выбора рынков и отдельных компаний, строящиеся на анализе мультипликаторов.

### **3.7 Типовое практическое задания к зачету** (для оценки умений)

Распределение практических заданий к зачету находится в закрытом для обучающихся доступе. Разработанный комплект типовых практических заданий к зачету не выставляется в электронную информационно-образовательную среду ЗаБИЖТ ИрГУПС, а хранится на кафедре-разработчике в составе ФОС по дисциплине.

Ниже приведен образец типового практического задания к зачету.

Образец типового практического задания к зачету

Ответьте на вопросы:

1. Графическое отображение параметров рынка ценных бумаг.
2. Растущий, падающий и боковой рынки.
3. Понятие графической фигуры на финансовом рынке
4. Состоявшиеся и несостоявшиеся фигуры на финансовом рынке
5. Основные предпосылки построения фигур и их применение в анализе ценных бумаг.
6. Достоинства и недостатки методов графического анализа.

### **3.8 Типовые практические задания к зачету** (для оценки навыков и (или) опыта деятельности)

Распределение практических заданий к зачету находится в закрытом для обучающихся доступе. Разработанный комплект типовых практических заданий к зачету не выставляется в электронную информационно-образовательную среду ЗаБИЖТ ИрГУПС, а хранится на кафедре-разработчике в составе ФОС по дисциплине.

Ниже приведен образец типовых практических заданий к зачету.

Образец типовых практических заданий к зачету

1. Понятие осциллятора. Основные предпосылки построения осцилляторов.
2. Основные правила разработки осцилляторов.
3. Основные виды осцилляторов и их интерпретация.
4. Достоинства и недостатки осциллятора «индекс относительной силы».

5. Достоинства и недостатки осциллятора «моментум».
6. Достоинства и недостатки стохастического осциллятора.
7. Достоинства, недостатки и область применения осцилляторов.

### **3.9 Перечень теоретических вопросов к экзамену** (для оценки знаний)

1. Коррекция мультипликаторов на отраслевую специфику
2. Понятие ликвидности финансовых активов и ранжирование активов по ликвидности.
3. Индикаторы ликвидности (плотность, глубина, упругость, расчет относительного «бид-аск» спреда).
4. Сбор информации для диагностирования ликвидности.
5. Переход от ликвидности отдельных активов к диагностированию динамики ликвидности
6. Основоположники фундаментального анализа.
7. Принципы проведения фундаментального анализа и выставления рекомендаций заинтересованным лицам
8. Инструменты прогнозирования на фондовом рынке. Роль опережающих индикаторов.
9. Сбор информации для диагностирования ликвидности.
10. Переход от ликвидности отдельных активов к диагностированию динамики ликвидности рынков
11. Определения технического анализа.
12. Классификация методов технического анализа.
13. Область применения методов технического анализа

### **3.10 Типовые практические задания к экзамену** (для оценки умений)

Распределение практических заданий к экзамену находится в закрытом для обучающихся доступе. Разработанный комплект типовых практических заданий к экзамену не выставляется в электронную информационно-образовательную среду ЗаБИЖТ ИрГУПС, а хранится на кафедре-разработчике в составе ФОС по дисциплине.

Ниже приведен образец типового практического задания к экзамену.

#### Образец типового практического задания к экзамену

1. Волновая теория Эллиотта. Основные понятия, принципы выявления
2. Численные соотношения
3. Числа Фибоначчи: понятие и применение в техническом анализе.
4. Методы «крестики-нолики» и «японские свечи» как альтернатива методам графического анализа ценных бумаг.
5. Психологические методы технического анализа
6. Специальные методы технического анализа ценных бумаг.
7. Тенденции на финансовых рынках и методы их выявления.
8. Графические фигуры как метод технического анализа
9. Основные понятия, и предпосылки технического анализа. Теория Доу.
10. Классификация методов технического анализа.
11. Краткая характеристика и история становления школы фундаментального анализа.
12. Источники информации для проведения фундаментального анализа.
13. Факторы, исследуемые фундаментальными аналитиками.



### **3.11 Типовые практические задания к экзамену** (для оценки навыков и (или) опыта деятельности)

Распределение практических заданий к экзамену находится в закрытом для обучающихся доступе. Разработанный комплект типовых практических заданий к экзамену не выставляется в электронную информационно-образовательную среду ЗаБИЖТ ИрГУПС, а хранится на кафедре-разработчике в составе ФОС по дисциплине.

Ниже приведен образец типовых практических заданий к экзамену.

#### Образец типовых практических заданий к экзамену

1. Информационное обеспечение технического и фундаментального анализа и практическое применение его результатов
2. Информация, как база исследования и прогнозирования рынка ценных бумаг и срочного рынка.
3. Межрыночный анализ как источник вспомогательной информации при анализе рынка ценных бумаг.
4. Цели и постулаты межрыночного анализа.
5. Четыре сектора финансового рынка, используемые при межрыночном анализе.
6. Краткая характеристика каждого сектора и характер связи между секторами.
7. Фьючерсный рынок как источник информации для межрыночного анализа.
8. Психологические методы технического анализа
9. Специальные методы технического анализа ценных бумаг.

#### 4. Методические материалы, определяющие процедуру оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности

В таблице приведены описания процедур проведения контрольно-оценочных мероприятий и процедур оценивания результатов обучения с помощью оценочных средств в соответствии с рабочей программой дисциплины.

Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства
Доклад	Защита докладов, предусмотренных рабочей программой дисциплины, проводится во время практических занятий. Преподаватель на практическом занятии, предшествующем занятию проведения контроля, доводит до обучающихся: тему докладов и требования, предъявляемые к их выполнению и защите
Разноуровневая задача	Выполнение разноуровневых задач, предусмотренных рабочей программой дисциплины, проводятся во время практических занятий. Во время выполнения заданий разрешается пользоваться учебниками, справочниками, конспектами лекций, тетрадями для практических занятий
Тестирование (компьютерные технологии)	Тестирование проводится по результатам освоения разделов дисциплины или по окончании ее изучения во время практических занятий. Во время проведения тестирования пользоваться учебниками, справочниками, конспектами лекций, тетрадями для практических занятий не разрешено. Преподаватель на практическом занятии, предшествующем занятию проведения теста, доводит до обучающихся: темы, количество заданий в тесте, время выполнения. Результаты тестирования видны обучающемуся на компьютере сразу после прохождения теста
Выполнение курсовой работы	Ход выполнения разделов курсовой работы в рамках текущего контроля оценивается преподавателем исходя из объемов выполненных работ в соответствие со шкалами оценивания. Преподаватель информирует обучающихся о результатах оценивания выполнения курсового проекта сразу после контрольно-оценочного мероприятия
Защита курсовой работы	Защита курсовой работы проходит в установленный расписанием день. В ходе защиты курсовой работы обучающийся делает доклад протяженностью 5 – 7 минут. Преподаватель ставит окончательную оценку за курсовую работу после завершения защиты, учитывая уровень ее защиты

Для организации и проведения промежуточной аттестации составляются 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 теоретических вопросов и типовые практические задания разного уровня сложности для проведения промежуточной аттестации обучающиеся получают в начале семестра через электронную информационно-образовательную среду ЗаБИЖТ ИрГУПС (личный кабинет обучающегося).

#### Описание процедур проведения промежуточной аттестации в форме зачета и оценивания результатов обучения

При проведении промежуточной аттестации в форме зачета преподаватель может воспользоваться результатами текущего контроля успеваемости в течение семестра. С целью использования результатов текущего контроля успеваемости, преподаватель подсчитывает среднюю оценку уровня сформированности компетенций обучающегося (сумма оценок, полученных обучающимся, делится на число оценок).

#### Шкала и критерии оценивания уровня сформированности компетенций в результате изучения дисциплины при проведении промежуточной аттестации в форме зачета по результатам текущего контроля (без дополнительного аттестационного испытания)

Средняя оценка уровня сформированности компетенций по результатам текущего контроля	Шкала оценивания
Оценка не менее 3,0 и нет ни одной неудовлетворительной оценки по текущему контролю	«зачтено»
Оценка менее 3,0 или получена хотя бы одна неудовлетворительная оценка по текущему контролю	«не зачтено»

Если оценка уровня сформированности компетенций обучающегося не соответствует критериям получения зачета без дополнительного аттестационного испытания, то промежуточная аттестация в форме зачета проводится в форме собеседования по перечню теоретических вопросов и типовых практических задач (не более двух теоретических и двух практических). Промежуточная аттестация в форме зачета с проведением аттестационного испытания в форме собеседования проходит на последнем занятии по дисциплине.

При проведении промежуточной аттестации в форме компьютерного тестирования вариант тестового задания формируется из ФТЗ по дисциплине случайным образом, но с условием: 50 % заданий должны быть заданиями открытого типа и 50 % заданий – закрытого типа.

### **Описание процедур проведения промежуточной аттестации в форме экзамена и оценивания результатов обучения**

Промежуточная аттестация в форме экзамена проводится путем устного собеседования по билетам или в форме компьютерного тестирования.

При проведении промежуточной аттестации в форме собеседования билеты составляются таким образом, чтобы каждый из них включал в себя теоретические вопросы и практические задания.

Билет содержит: теоретический вопрос для оценки знаний. Теоретический вопрос выбирается из перечня вопросов к экзамену; два практических задания: одно из них для оценки умений (выбирается из перечня типовых простых практических заданий к экзамену); другое практическое задание для оценки навыков и (или) опыта деятельности (выбираются из перечня типовых практических заданий к экзамену).


Распределение теоретических вопросов и практического задания по экзаменационным билетам находится в закрытом для обучающихся доступе. Разработанный комплект билетов (25-30 билетов) не выставляется в электронную информационно-образовательную среду ЗаБИЖТ ИрГУПС, а хранится на кафедре-разработчике ФОС на бумажном носителе в составе ФОС по дисциплине.

На экзамене обучающийся берет билет, для подготовки ответа на экзаменационный билет обучающемуся отводится время в пределах 45 минут. В процессе ответа обучающегося на вопросы и задания билета, преподаватель может задавать дополнительные вопросы.

Каждый вопрос/задание билета оценивается по четырехбалльной системе, а далее вычисляется среднее арифметическое оценок, полученных за каждый вопрос/задание. Среднее арифметическое оценок округляется до целого по правилам округления.

При проведении промежуточной аттестации в форме компьютерного тестирования вариант тестового задания формируется из ФТЗ по дисциплине случайным образом, но с условием: 50 % заданий должны быть заданиями открытого типа и 50 % заданий – закрытого типа.

## Образец экзаменационного билета для обучающихся

 ЗабИЖТ ИрГУПС 20__ /20__ учебный год	<b>Экзаменационный билет № 1</b> <b>по дисциплине «Фундаментальный и технический</b> <b>анализ на финансовых рынках»</b>	УТВЕРЖДАЮ: Заведующий кафедрой «Экономика и управление» ЗабИЖТ  О.Л. Быстрова
1. Основоположники фундаментального анализа		
2. Методы «крестики-нолики» и «японские свечи» как альтернатива методам графического анализа ценных бумаг.		
Задача 3. Выручка компании «Московские зонтики» за 2010 год составила 50 млн. рублей. Маржа (норма чистой прибыли) 5%. Оборачиваемость постоянно используемого капитала равна 3 (это устойчивое значение по компании, наблюдаемое за ряд лет). Финансовый рычаг (как отношение заемного капитала к собственному) равен единице. Оцените ROE по компании за 2010 год		
<i>Составил:.</i>		