

Компонент ОПОП	38.04.01 Экономика, направленность (профиль) «Финансовый аналитик»
	наименование ОПОП
	Б1.В.06
	шифр дисциплины

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Дисциплины (модуля)	Анализ финансовых рынков
---------------------	--------------------------

Разработчик: Царева С.В.
ФИО
доцент
должность
к.э.н., доцент
ученая степень, звание

Утверждено на заседании кафедры Экономики и управления
наименование кафедры
протокол № 6 от 19.02.2026
Заведующий кафедрой
ЭиУ
Щебарова Н.Н.
ФИО
подпись

1. Критерии и средства оценивания компетенций и индикаторов их достижения, формируемых дисциплиной (модулем)

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора(ов) достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине (модулю)			Оценочные средства текущего контроля	Оценочные средства промежуточной аттестации
		<i>Знать</i>	<i>Уметь</i>	<i>Владеть</i>		
ПК-2. Способен анализировать и использовать различные источники информации для проведения финансовых расчетов	ИД-1 _{ПК-2} : - понимает принципы формирования стоимости денег во времени; принципы дисконтирования денежного потока; принципы начисления сложных процентов; принципы расчетов приведенной и будущей стоимости; методики финансового анализа; понятие безрискового актива ИД-2 _{ПК-2} : - получает, интерпретирует результаты исследований; использует расчетные таблицы и калькуляторы ИД-3 _{ПК-2} : - применяет инструменты финансового анализа; анализа использования заемных средств	- понятие и типы финансовых рынков; - основные фундаментальные факторы, влияющие на финансовые рынки; - основные предпосылки применения методов технического анализа финансовых рынков; -основные подходы и методы технического и фундаментального анализа финансовых рынков; - методы анализа ценных бумаг, включающие поэтапный анализ экономики, отраслей и предприятий	- определять фундаментальные индикаторы и оценивать их влияние на финансовый рынок; - уметь проводить анализ ценных бумаг, основываясь на финансовых документах предприятий, статистических данных отраслей и макроэкономических показателях; - самостоятельно выбирать определенный метод технического анализа, с его помощью проводить конкретные расчеты, анализировать их и делать выводы из них	- навыками самостоятельной работы с литературой и накопления необходимой базовой информации, которая может быть использована в ходе последующей исследовательской работы; - навыками составления аналитического отчета по деятельности предприятия	выполнение практических работ посещаемость занятий	Оценочные средства текущего контроля
ПК-4. Способен составлять инвестиционный портфель и управлять инвестиционным риском	ИД-1 _{ПК-4} : - понимает методы дисконтирования денежных потоков, методы многовариантности расчетов, методы математического моделирования и количественной оптимизации; принципы расчета доходности активов; принципы портфельного управления инвестированием; принципы соотношения риска и доходности; способы управления финансовыми рисками				комплект заданий для выполнения практических работ	Оценочные средства текущего контроля

2. Оценка уровня сформированности компетенций (индикаторов их достижения)

Показатели оценивания компетенций (индикаторов их достижения)	Шкала и критерии оценки уровня сформированности компетенций (индикаторов их достижения)			
	Ниже порогового («неудовлетворительно»)	Пороговый («удовлетворительно»)	Продвинутый («хорошо»)	Высокий («отлично»)
Полнота знаний	Уровень знаний ниже минимальных требований. Имели место грубые ошибки.	Минимально допустимый уровень знаний. Допущены не грубые ошибки.	Уровень знаний в объёме, соответствующем программе подготовки. Допущены некоторые погрешности.	Уровень знаний в объёме, соответствующем программе подготовки.
Наличие умений	При выполнении стандартных заданий не продемонстрированы основные умения. Имели место грубые ошибки.	Продemonстрированы основные умения. Выполнены типовые задания с не грубыми ошибками. Выполнены все задания, но не в полном объеме (отсутствуют пояснения, неполные выводы)	Продemonстрированы все основные умения. Выполнены все основные задания с некоторыми погрешностями. Выполнены все задания в полном объёме, но некоторые с недочетами.	Продemonстрированы все основные умения. Выполнены все основные и дополнительные задания без ошибок и погрешностей. Задания выполнены в полном объеме без недочетов.
Наличие навыков (владение опытом)	При выполнении стандартных заданий не продемонстрированы базовые навыки. Имели место грубые ошибки.	Имеется минимальный набор навыков для выполнения стандартных заданий с некоторыми недочетами.	Продemonстрированы базовые навыки при выполнении стандартных заданий с некоторыми недочетами.	Продemonстрированы все основные умения. Выполнены все основные и дополнительные задания без ошибок и погрешностей. Продemonстрирован творческий подход к решению нестандартных задач.
Характеристика сформированности компетенции	Компетенции фактически не сформированы. Имеющихся знаний, умений, навыков недостаточно для решения практических (профессиональных) задач. ИЛИ Зачетное количество баллов не набрано согласно установленному диапазону	Сформированность компетенций соответствует минимальным требованиям. Имеющихся знаний, умений, навыков в целом достаточно для решения практических (профессиональных) задач. ИЛИ Набрано зачетное количество баллов согласно установленному диапазону	Сформированность компетенций в целом соответствует требованиям. Имеющихся знаний, умений, навыков достаточно для решения стандартных профессиональных задач. ИЛИ Набрано зачетное количество баллов согласно установленному диапазону	Сформированность компетенций полностью соответствует требованиям. Имеющихся знаний, умений, навыков в полной мере достаточно для решения сложных, в том числе нестандартных, профессиональных задач. ИЛИ Набрано зачетное количество баллов согласно установленному диапазону

3. Критерии и шкала оценивания заданий текущего контроля

3.1. Критерии и шкала оценивания практических работ

Перечень практических работ, описание порядка выполнения и защиты работы, требования к результатам работы, структуре и содержанию отчета и т.п. представлены в методических материалах по освоению дисциплины (модуля) и в электронном курсе в ЭИОС МГТУ.

Баллы	Критерии оценивания
Отлично/70 баллов	Выполнено 100 % практических работ. Отчет по практической работе подготовлен качественно в соответствии с требованиями. Полнота ответов на вопросы преподавателя при защите работы.
Хорошо/55 баллов	Выполнено 75 % практических работ, нет достаточного обоснования или при верном решении допущена незначительная ошибка, не влияющая на правильную последовательность рассуждений. Все требования, предъявляемые к работе, выполнены.
Удовлетворительно/40 баллов	Выполнено 50 % практических работ. Демонстрирует средний уровень выполнения задания на практическую работу. Большинство требований, предъявляемых к заданию, выполнены.
4неудовлетворительно/0 баллов	Выполнено менее 50 % практических работ со значительным количеством ошибок на низком уровне. Многие требования, предъявляемые к заданию, не выполнены. ИЛИ Практические работы не выполнены.

3.2. Критерии и шкала оценивания посещаемости занятий

Посещение занятий обучающимися определяется в процентном соотношении

Баллы	Критерии оценки
30	Посещаемость 100 %
25	Посещаемость 75 %
20	Посещаемость 50 %
0	Нет посещений

4. Критерии и шкала оценивания результатов обучения по дисциплине (модулю) при проведении промежуточной аттестации

Критерии и шкала оценивания результатов освоения дисциплины (модуля)
с зачетом

Если обучающийся набрал зачетное количество баллов согласно установленному диапазону по дисциплине (модулю), то он считается аттестованным.

Оценка	Баллы	Критерии оценивания
Зачтено	60 – 100	Набрано зачетное количество баллов согласно установленному диапазону
Не зачтено	менее 60	Зачетное количество согласно установленному диапазону баллов не набрано

5. Задания диагностической работы для оценки результатов обучения по дисциплине (модулю) в рамках внутренней и внешней независимой оценки качества образования

ФОС содержит задания для оценивания знаний, умений и навыков, демонстрирующих уровень сформированности компетенций и индикаторов их достижения в процессе освоения дисциплины (модуля).

Комплект заданий разработан таким образом, чтобы осуществить процедуру оценки каждой компетенции, формируемых дисциплиной (модулем), у обучающегося в письменной форме.

Содержание комплекта заданий включает: *тестовые задания*.

Комплект заданий диагностической работы

ПК-2. Способен анализировать и использовать различные источники информации для проведения финансовых расчетов	
1.	Благоприятной тенденцией является: А. Превышение темпов роста активов над темпами роста выручки за анализируемый период Б. Превышение темпов роста активов над темпами роста пассивов за анализируемый период В. Превышение темпов роста выручки над темпами роста активов за анализируемый период
2.	В ходе финансового анализа используются измерители: А. Преимущественно натуральные Б. Преимущественно стоимостные В. Стоимостные, натуральные, трудовые, условно-натуральные
3.	Вертикальный анализ бухгалтерского баланса проводится на основе: А. Изменения абсолютной величины показателей Б. Структуры активов и пассивов баланса В. Темпов роста (снижения) показателей
4.	Горизонтальный анализ бухгалтерского баланса заключается в определении: А. Динамики активов и пассивов Б. Структуры активов и пассивов
5.	Задача анализа финансового состояния предприятия: А. Определение имущества предприятия Б. Определение прибыли (убытка) от продажи В. Определение собственного капитала Г. Определение финансовой устойчивости, кредитоспособности, платежеспособности
6.	Выбрать вид проекта, для которого дано определение «реализация одного проекта может способствовать росту доходов по другому проекту»: А. Независимые проекты Б. Комплементарные проекты В. Замещаемые проекты
7.	Верно ли утверждение, что амортизация начисляется по объектам основных средств, полученных по договору дарения: А. Да Б. Нет
8.	Государственное финансирование может осуществляться на: А. Возвратной и безвозвратной основе Б. Возвратной и долевого основе В. Возвратной, безвозвратной и долевого основе
9.	Для проверки финансовой реализуемости проекта достаточно, чтобы... было неотрицательным на каждом шаге расчета: А. Поток реальных денег Б. Сальдо реальных денег В. Сальдо накопленных реальных денег

10.	Самофинансирование (самоинвестирование) осуществляется за счет: А. Чистой прибыли Б. Чистой прибыли и средств инвесторов В. Чистой прибыли и амортизационных отчислений.
-----	---

ПК-4. Способен составлять инвестиционный портфель и управлять инвестиционным риском	
1.	Что из перечисленного не относится к видам производственных рисков: А. Изменение конъюнктуры рынка Б. Усиление конкуренции В. Форс-мажор Г. Амортизация производственного оборудования.
2.	Процесс снижения риска портфеля за счет увеличения разнообразия видов ценных бумаг носит название.....
3.	При получении банковского кредита под реализацию инвестиционных проектов могут возникнуть риски: А. Недостаточной рентабельности вкладываемого капитала Б. Несвоевременности возврата заемных средств в условиях неопределенности В. Ошибки расчетов в сроке окупаемости инвестиционных проектов Г. Все ответы верны.
4.	При получении кредита под реализацию инвестиционных проектов могут возникнуть неопределенности: А. Неопределенность в ожидаемых сроках поступлений денежных средств Б. Неопределенность периода погашения ссуды В. Неопределенность абсолютного количества денежных средств, уплачиваемых за использование банковского кредита Г. Все ответы верны.
5.	Портфельные инвестиции – это вложения денежных средств: А. В материально-производственную базу предприятий с целью получения дохода от участия в их деятельности Б. В объекты интеллектуальной собственности с переходом права собственности на них В. В ценные бумаги, сформированные в виде портфеля ценных бумаг.
6.	Инвестиционные портфели принято классифицировать по степени риска : А. В зависимости от источника доходов по ценным бумагам портфеля Б. Длительности холдингового периода В. В. По реакции на темпы инфляции Г. По количеству входящих в них ценных бумаг.
7.	Верно ли утверждение, что оптимальный портфель обязательно должен быть эффективным: А. Да Б. Нет, в определенных условиях инвестор может в качестве оптимального выбирать и неэффективный портфель В. Это зависит от отношения конкретного инвестора к риску Г. Нет, при высоких уровнях корреляции это условие может не выполняться.
8.	Если инвестор сформировал «портфель роста», то он рассчитывает на рост: А. ВВП Б. Курсовой стоимости ценных бумаг портфеля В. Количества ценных бумаг в портфеле Г. Темпов инфляции.
9.	Если ставка дисконтирования ниже внутренней нормы доходности, то инвестирование будет: А. Прибыльным Б. Нейтральным В. Убыточным
10.	Для заданного количества ценных бумаг портфеля найти такую их комбинацию, чтобы риск получился минимально возможным: А. Можно, и существует единственная подобная комбинация Б. Можно, и таких комбинаций существует бесконечно много В. Нельзя, так как это противоречит теореме о границе эффективных портфелей Г. Нельзя, поскольку риск распадается на систематический и несистематический