Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Крылова Людмила Вячеславовна
Должность: Проректор по учебно-методической работе
Дата подписания: 13.11.2026 22:15:30
Уникальный программный ключ:
b066544bae1e449cd8bfce392f7224a676a271b2

о БД(б) 26

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Донецкий национальный университет экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского»

Кафедра банковского дела

УТВЕРЖДАЮ

Заведующий кафедрой

_____ И.В. Попова
(подпись)

«16» 02 2026 г.

КАФЕДРА БАНКОВСКОГО ДЕЛА

ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ

по дисциплине

Б1.В.ДВ.11.02 АНАЛИЗ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ
(шифр и наименование дисциплины)

38.03.01 Экономика
(код и наименование направления подготовки)

Банковское дело
(наименование профиля подготовки)

Разработчик:

доцент _____ Пятаченко Анна Максимовна
(должность) (подпись)

Оценочные материалы рассмотрены и утверждены на заседании кафедры от 10.02.2026 г., протокол №11

Донецк 2026 г.

Паспорт
оценочных материалов по дисциплине
Б1.В.ДВ.11.02 АНАЛИЗ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

(наименование дисциплины)

Перечень компетенций, формируемых в результате освоения дисциплины (модуля) или практики

№ п/п	Код и наименование контролируемой Компетенции	Контролируемые разделы (темы) дисциплины	Этапы формирования (семестр изучения)
1	УК-10. Способен принимать обоснованные экономические решения в различных областях жизнедеятельности ПК-9. Способен осуществлять мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты с целью консультирования клиентов по использованию финансовых продуктов и услуг	Тема 1. Виды и особенности составляющих финансового рынка	5
		Тема 2. Макроэкономические основы финансовых рынков	5
		Тема 3. Фундаментальный анализ	5
		Тема 4. Фундаментальный анализ экономических отраслей и показателей развития компаний	5
		Тема 5. Технический анализ и гипотеза эффективности рынков	5
		Тема 6. Графики в техническом анализе	5
		Тема 7. Основные принципы анализа осцилляторов	5

Показатели и критерии оценивания компетенций, описание шкал оценивания

Показатели оценивания компетенций

№ п/п	Код контролируемой компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Контролируемые разделы (темы) дисциплины, практики	Наименование оценочного средства
1	УК-10. Способен принимать обоснованные экономические решения в различных областях жизнедеятельности ПК-9. Способен осуществлять мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты с целью консультирования клиентов по использованию финансовых продуктов и услуг	ИДК-1УК-10 Понимает базовые принципы функционирования экономики, цели и механизмы основных видов социально-экономической политики и ее влияние на индивида. ИДК-1пк-9 Осуществляет сбор, обработку и анализ информации о состоянии финансового рынка, изучает спрос и предложения на рынке финансовых услуг. ИДК-3пк-9 Составляет аналитические заключения, рейтинги, прогнозы с целью предотвращения сделок	Тема 1. Виды и особенности составляющих финансового рынка	собеседование, доклад, тест
			Тема 2. Макроэкономические основы финансовых рынков	собеседование, доклад, тест
			Тема 3. Фундаментальный анализ	собеседование, доклад, тест
			Тема 4. Фундаментальный анализ экономических отраслей и показателей развития компаний	собеседование, доклад
			Тема 5. Технический анализ и гипотеза эффективности рынков	собеседование, доклад
			Тема 6. Графики в техническом анализе	собеседование, доклад
			Тема 7. Основные принципы анализа	собеседование, доклад

№ п/п	Код контролируемой компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Контролируемые разделы (темы) дисциплины, практики	Наименование оценочного средства
		с недобросовестными партнерами	осцилляторов	

Критерии и шкала оценивания по оценочному материалу «Собеседование (устный или письменный опрос)»

Шкала оценивания (интервал баллов)	Критерий оценивания
4,8-5,0	Ответы на поставленные вопросы излагаются логично, последовательно и не требуют дополнительных пояснений. Полно раскрываются причинно-следственные связи между явлениями и событиями. Делаются обоснованные выводы. Демонстрируются глубокие знания основных положений дисциплины. Соблюдаются нормы литературной речи (количество правильных ответов > 90%)
3,4-4,7	Ответы на поставленные вопросы излагаются систематизировано и последовательно. Базовые нормативно-правовые акты используются, но в недостаточном объеме. Материал излагается уверенно. Раскрыты причинно-следственные связи между явлениями и событиями. Демонстрируется умение анализировать материал, однако не все выводы носят аргументированный и доказательный характер. Соблюдаются нормы литературной речи (количество правильных ответов от 70% до 90%)
0,1-3,3	Допускаются нарушения в последовательности изложения. Имеются поверхностные знания основ дисциплины. Неполно раскрываются причинно-следственные связи между явлениями и событиями. Демонстрируются поверхностные знания вопроса, с трудом решаются конкретные задачи. Имеются затруднения с выводами. Допускаются нарушения норм литературной речи (количество правильных ответов от 50% до 70%)
0	Материал излагается непоследовательно, сбивчиво, не представляет определенной системы знаний по дисциплине. Не раскрываются причинно-следственные связи между явлениями и событиями. Не проводится анализ. Выводы отсутствуют. Ответы на дополнительные вопросы отсутствуют. Имеются заметные нарушения норм литературной речи (количество правильных ответов < 50%)

Критерии и шкала оценивания по оценочному материалу «Доклад»

Шкала оценивания (интервал баллов)	Критерии оценивания
5	Доклад представлен в полном объеме (студент полностью осветил вопрос, владеет профильным понятийным (категориальным) аппаратом и т.п.)
4,6-5,9	Доклад представлен в не полном объеме (студент в целом осветил алгоритм проблемы задачи, имеются незначительные неточности в расчетах, владеет в недостаточной степени профильным категориальным аппаратом и т.п.)
2,0-4,5	Доклад представлен не верно (студент не осветил задачи исследования, имеются значительные неточности в данных, не владеет профильным категориальным аппаратом и т.п.)
0-1,9	Доклад не представлен вовсе (студент не подготовил материал)

Критерии и шкала оценивания по оценочному материалу «Тест»

Шкала оценивания (интервал баллов)	Критерий оценивания
4,8-5,0	Тестовые задания выполнены на высоком уровне (правильные ответы даны на 90-100% вопросов)
3,5-4,7	Тестовые задания выполнены на среднем уровне (правильные ответы даны на 75-89% вопросов)
1,1-3,4	Тестовые задания выполнены на низком уровне (правильные ответы даны на 60-74% вопросов)
0-1,0	Тестовые задания выполнены на неудовлетворительном уровне (правильные ответы даны менее чем 60% вопросов)

Примерный перечень оценочных материалов

№ п/п	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в фонде
1.	Собеседование (устный или письменный опрос)	Средство контроля, организованное как специальная беседа преподавателя с обучающимся на темы, связанные с изучаемой дисциплиной, и рассчитанное на выяснение объема знаний обучающегося по дисциплине или определенному разделу, теме, проблеме и т.п.	Вопросы по темам/разделам дисциплин
2.	Доклад	Научно-аналитическая работа, посвящённая определённой теме, сочетает письменный текст и устное выступление: автор не только сдаёт материал преподавателю, но и представляет его перед слушателями.	Вопросы по темам/разделам дисциплин
3.	Тест	Система стандартизированных заданий, позволяющая автоматизировать процедуру измерения уровня знаний и умений обучающегося.	Фонд тестовых заданий

Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков

Оценочные материалы по дисциплине «Анализ финансовых рынков» разработаны в соответствии с ОПОП ВО по направлению подготовки 38.03.01 Экономика (Профиль: Банковское дело) и рабочей программой дисциплины «Анализ финансовых рынков»

Логика построения рабочей программы дисциплины «Анализ финансовых рынков» ориентирована на предоставление обучающимся теоретических и практических знаний касательно понятия и сегменты финансовых рынков (фондовый, срочный, валютный и др.); разобраться в принципах функционирования рынков и роли их участников; ознакомиться с законодательными и регуляторными основами финансовых рынков; освоить основные и производные финансовые инструменты (акции, облигации, фьючерсы, опционы и др.); овладеть методиками фундаментального и технического анализа; научиться применять математические и статистические методы для количественной оценки рыночных процессов;

рассчитывать показатели эффективности и риска финансовых операций (доходность, волатильность, VaR и др.); формировать и оптимизировать инвестиционные портфели; анализировать рыночные данные с использованием специализированного ПО (например, пакетов статистического анализа); разрабатывать стратегии управления рисками и хеджирования; оценивать текущую ситуацию на рынках и прогнозировать её развитие; принимать обоснованные инвестиционные решения на микро- и макроуровне; использовать аналитические материалы для разработки экономических прогнозов и стратегий; изучить модели ценообразования финансовых активов; понять особенности глобализации и секьюритизации рынков; ознакомиться с методами анализа внешней и внутренней среды для экономических расчётов.

Структура дисциплины «Анализ финансовых рынков» представлена двумя смысловыми модулями: смысловой модуль 1 «Основы финансового анализа »; смысловой модуль 2 «Показатели финансового анализа».

При изучении дисциплины в течение семестра обучающийся может набрать максимально 100 баллов. Минимальное количество баллов составляет 60 баллов.

Система оценивания всех видов работ по дисциплине «Анализ финансовых рынков» приведена в таблице 1.

Для выполнения заданий, предусмотренных оценочными материалами, обучающийся должен пройти предварительную теоретическую и практическую подготовку на лекционных и практических занятиях, а также при самостоятельном изучении литературных источников.

Текущий контроль знаний обучающихся осуществляется на основании оценки систематичности и активности по каждой теме программного материала дисциплины.

Текущий контроль знаний осуществляется с помощью собеседования (устного или письменного) и задач, предусмотренных для отдельных тем дисциплины, а также тестов по каждой теме дисциплины.

Таблица 1

Система начисления баллов по текущему контролю знаний

Максимально возможный балл по виду учебной работы				
Смысловые модули	Текущая аттестация			Итого
	Собеседование (устный или письменный опрос)	Тест	Доклад	
Смысловой модуль 1 Основы финансового анализа	15	15	15	45
Смысловой модуль 2 Показатели финансового анализа	20	20	15	55
Итого:	35	35	30	100

Собеседование (устный или письменный опрос) – это произвольная беседа или целенаправленное собеседование, позволяющее оценить уровень знаний по теме, разделу или дисциплине в целом. Представленные вопросы для собеседования (устного или письменного опроса) позволяют оценить уровень знаний

обучающихся, полученных при изучении лекционного материала по отдельным темам дисциплины. Максимальное количество баллов по собеседованию составляет 5 баллов по темам 1-7.

Доклад - это учебная или научно-аналитическая работа, посвящённая определённой теме. Она сочетает письменный текст и устное выступление: автор не только сдаёт материал преподавателю, но и представляет его перед слушателями. Максимальное количество баллов по собеседованию составляет 5 баллов по темам 1-7.

Тест – это система контрольных заданий определенной формы и содержания, позволяющих объективно оценить уровень знаний по теме, разделу или дисциплине в целом. Представленные тестовые задания позволяют оценить уровень знаний обучающихся и имеют только один верный ответ. Максимальное количество баллов по тестам составляет 5 балла по темам 1-6.

Промежуточная аттестация по дисциплине «Анализ финансовых рынков» осуществляется в форме зачета. Зачет проводится в устной форме в виде собеседования по предложенному перечню вопросов, тестирование и решение практического задания.

Таблица 2

Распределение баллов, которые получают обучающиеся

Текущее тестирование и самостоятельная работа							Сумма в баллах
Смысловой модуль № 1	Смысловой модуль № 2		Смысловой модуль № 3				
Т1	Т2	Т3	Т4	Т5	Т6	Т7	100
10	10	10	10	20	20	20	

Таблица 3

Государственная шкала оценивания академической успеваемости

Сумма баллов за все виды учебной деятельности	По государственной шкале
90-100	5 «отлично»
75-89	4 «хорошо»
60-74	3 «удовлетворительно»
менее 60	2 «неудовлетворительно»

Примеры типовых заданий для оценочных материалов

1) по оценочному материалу «Собеседование (устный или письменный опрос)»

1. Виды и особенности составляющих финансового рынка.
2. Введение в теорию финансовых рынков.
3. Фундаментальные понятия рынка ценных бумаг.
4. Характерные черты международного финансового рынка.
5. Виды финансовых рынков.
6. Макроэкономические основы финансовых рынков.
7. Макроэкономические показатели национальных счетов.

8. Макроэкономические показатели уровня цен.
9. Источники макроэкономической нестабильности: инфляция и безработица.
10. Регулирование макроэкономического равновесия на рынке товаров и услуг.

2) по оценочному материалу «Доклад»

1. Фундаментальный анализ финансовых рынков: методы и инструменты.
2. Технический анализ: основные индикаторы и паттерны.
3. Гипотеза эффективного рынка и её практическое значение.
4. Волатильность финансовых рынков: измерение и управление рисками.
5. Роль институциональных инвесторов на финансовых рынках.
6. Анализ глобальных финансовых кризисов: причины и последствия.
7. Влияние геополитической нестабильности на финансовые рынки.
8. Криптовалюты и цифровые активы как сегмент финансового рынка.
9. Макроэкономические индикаторы и их влияние на динамику финансовых рынков
10. Квантитативный анализ и алгоритмическая торговля: принципы и применение

3) по оценочному материалу «Тест»

1. Что является ключевым объектом анализа при фундаментальном анализе финансовых рынков?
а) Графики цен и объёмов торгов.
б) Макроэкономические показатели, финансовые отчёты компаний и отраслевые тренды.
в) Психологические факторы поведения трейдеров.
г) Алгоритмы торговых роботов.

2. Какой из перечисленных индикаторов относится к инструментам технического анализа?
а) ВВП страны.
б) Коэффициент P/E (цена/прибыль).
в) Скользящая средняя (Moving Average).
г) Уровень безработицы.

3. Какая форма гипотезы эффективного рынка (EMH) предполагает, что цены активов отражают всю общедоступную информацию?
а) Слабая форма.
б) Полусильная форма.
в) Сильная форма.
г) Нулевая форма.

4.Что измеряет индекс волатильности VIX?
а) Среднюю доходность акций за год.
б) Ожидаемую волатильность индекса S&P 500 на ближайшие 30 дней.
в) Объём торгов на фондовом рынке.
г) Уровень инфляции в США.

5.Какой тип инвестора обычно управляет крупными портфелями и оказывает значительное влияние на динамику финансовых рынков?
а) Розничный инвестор.
б) Институциональный инвестор (пенсионные фонды, хедж-фонды и т.д.).
в) Спекулянт-частник.
г) Краудфандинговый инвестор.

6. Какое событие стало ключевым триггером мирового финансового кризиса 2008 года?
а) Крах доткомов (пузырь доткомов).
б) Банкротство банка Lehman Brothers.
в) Резкий рост цен на нефть.
г) Введение евро как единой валюты ЕС.

7.Как обычно реагирует курс национальной валюты при повышении ключевой ставки центральным банком?
а) Валюта ослабевает.
б) Валюта укрепляется.
в) Курс остаётся неизменным.
г) Реакция непредсказуема.

8.Какой показатель используется для оценки относительной стоимости акции на основе прибыли компании?
а) ROE (рентабельность собственного капитала).
б) P/E (цена/прибыль).
в) Debt/Equity (долг/капитал).
г) EPS (прибыль на акцию).

9.Что означает паттерн «голова и плечи» в техническом анализе?
Варианты ответов:
а) Сигнал продолжения восходящего тренда.
б) Сигнал разворота восходящего тренда (медвежий сигнал).
в) Сигнал начала консолидации цены.
г) Случайное колебание, не имеющее прогнозной ценности.

10.Какой инструмент чаще всего используется для хеджирования валютных рисков?
Варианты ответов:
а) Акции голубых фишек.
б) Государственные облигации.
в) Форвардные контракты или валютные фьючерсы.
г) Депозиты в иностранной валюте.