

Форма оценочного материала для промежуточной аттестации

Оценочные материалы для промежуточной аттестации по дисциплине

Технический анализ на рынке ценных бумаг, 8 семестр

Код, направление подготовки	38.03.01
Направленность (профиль)	Финансы и кредит
Форма обучения	Очная
Кафедра-разработчик	Финансов, денежного обращения и кредита
Выпускающая кафедра	Финансов, денежного обращения и кредита

Типовые задания для контрольной работы:

1. Модель “восходящий треугольник”:

- a) как правило, подтверждает восходящую тенденцию;
- b) как правило, предупреждает о переломе восходящей тенденции;
- c) как правило, подтверждает нисходящую тенденцию.

2. Что означает понятие – “рынок учитывает все”:

- a) в рыночном курсе ценной бумаги нашли свое отражение все факторы, которые по каким-либо причинам могли или могут повлиять на ее стоимость ценной бумаги;
- b) информация о сделках равнодоступна всем участникам рынка;
- c) все участники рынка обязаны раскрывать информацию о своих сделках.

3. На протяжении торговой сессии в РТС все котировки являются:

- a) индикативными;
- b) твердыми.

4. Фондовая биржа может совмещать свою деятельность с деятельностью:

- a) в качестве дилера;
- b) по определению взаимных обязательств;
- c) по ведению реестра владельцев ценных бумаг.

5. Имеют ли право служащие фондовой биржи быть учредителями организации профессиональных участников рынка ценных бумаг право:

- a) да;

b) нет.

6. На российских биржах существование различных категорий членства с неравными правами:

- a) запрещено;
- b) разрешено;
- c) разрешено, если этого оговорено правилами биржи.

7. Котировки на бирже могут выставить:

- a) информационные члены;
- b) торговые члены;
- c) маркет-мейеры.

8. На протяжении торговой сессии в РТС торговые члены должны непрерывно поддерживать:

- a) три двусторонние котировки;
- b) одну одностороннюю котировку;
- c) три односторонние котировки.

9. На протяжении торговой сессии в РТС маркет-мейеры должны непрерывно поддерживать:

- a) пять двусторонних котировок;
- b) три двусторонние котировки;
- c) две односторонние котировки.

10. Функциями фондовой биржи являются:

- a) проведение арбитражных операций с ценными бумагами;
- b) определение цен на финансовые инструменты;
- c) обеспечение условий для обращения ценных бумаг;
- d) поддержание профессионального уровня финансовых посредников;
- e) купля-продажа ценных бумаг от имени фондовой биржи, в которой контрагентами выступают биржевые брокеры.

11. Как динамика значений объема связана с направлением изменения цены:

- a) при восходящей тенденции значения объема увеличиваются по мере роста значений цены;
- b) при нисходящей тенденции значения объема уменьшаются по мере уменьшения значений цены;
- c) динамика значений объема не зависит от направления тенденции?

12. Рыночные поручения на покупку-продажу ценных бумаг выполняются по ценам:

- a) предельным, указанным в поручении, или лучшим;
- b) лучшим, сложившимся на рынке к моменту поступления товара;
- c) лучшим, когда биржевая котировка достигнет стоп-цены, указанной в поручении.

13. Лимитированное поручение на покупку ценной бумаги на фондовой бирже исполняется по цене:

- a) лучшей, но не выше лимитированной;
- b) лучшей, но не ниже лимитированной;
- c) указанной в поручении.

14. Лимитированное поручение на продажу ценной бумаги на фондовой бирже исполняется по цене:

- a) лучшей, но не выше лимитированной;
- b) лучшей, но не ниже лимитированной;
- c) указанной в поручении.

15. Стоп-приказ на продажу ценной бумаги по цене X – это:

- a) приказ покупать, как только цена опустится до уровня X ;
- b) приказ продавать, как только цена поднимется до уровня X ;
- c) приказ продавать, как только цена опустится до уровня X ;
- d) приказ покупать, как только цена поднимется до уровня X ;

16. Стоп-лимитный приказ на покупку ценной бумаги по цене X – это:

- a) А) Приказ начать продавать, как только цена поднимется до уровня X , но не выше цены Y , где $Y > X$;
- b) Б) Приказ начать покупать, как только цена опустится до уровня X , но не ниже цены Y , где $Y < X$;
- c) В) Приказ начать покупать, как только цена поднимется до уровня X , но не выше цены Y , где $Y > X$.

17. Стоп-приказ на покупку ценной бумаги по цене X – это:

- a) приказ покупать, как только цена поднимется до уровня X ;
- b) приказ покупать, как только цена опустится до уровня X ;
- c) приказ продавать, как только цена опустится до уровня X ;

18. Стоп-лимитный приказ на продажу ценной бумаги по цене X – это:

- a) приказ начать продавать, как только цена поднимется до уровня X , но не выше цены Y , где $Y > X$;
- b) приказ начать продавать, как только цена опустится до уровня X , но не ниже цены Y , где $Y < X$;
- c) приказ начать покупать, как только цена поднимется до уровня X , но не выше цены Y , где $Y > X$.

19. Уровень сопротивления определяет:

- a) что цены не снизятся ниже его значения;
- b) что цены не поднимутся выше его значения.

20. Действия фирм или лиц по созданию нехватки товара на рынке путем скупки биржевых контрактов и реального товара с определенным сроком поставки имеют название

- a) контанго;
- b) корнер
- c) демпинг

21. Рыночная ситуация «контанго» характеризуется тем, что:

- a) соотношение цен, при котором цены сделок на срок ниже цен на кассовом рынке;
- b) на бирже преобладают срочные операции;
- c) на бирже преобладают кассовые операции;
- d) соотношение цен, при котором цены сделок на срок превышают цены на кассовом рынке;

22. Укажите правильное определение для рыночной ситуации «бэквордейшн»

- a) на бирже преобладают срочные операции;
- b) соотношение цен, при котором цены сделок на срок ниже цен на кассовом рынке;
- c) соотношение цен, при котором цены сделок на срок превышают цены на кассовом рынке;
- d) на бирже преобладают срочные операции

23. Член биржи, биржевой спекулянт, торгующий для себя:

- a) скалпер;
- b) спредер;
- c) маклер;
- d) трейдер;

24. Сделка с товаром, совершаемая на бирже и предусматривающая немедленную оплату и поставку товара, - это

- a) репорт;
- b) сделка с опционом;
- c) кассовая сделка;
- d) срочная сделка;

25. Расчетные палаты на биржах создаются для:

- a) гарантии выполнения обязательств сторон по фьючерсному контракту;
- b) расчетов по сделкам купли-продажи;
- c) координации деятельности брокерских контор;
- d) оформления контрактов между покупателем и продавцом.

26. Продажа ценных бумаг по курсу дня с условием их обратной покупки через определенный срок в будущем это —:

- a) депорт
- b) репорт
- c) демпинг

27. Базисным активом, лежащим в основе финансового фьючерсного контракта, могут быть:

- a) облигации;
- b) своп;
- c) драгоценные металлы;

- d) акции;
- e) фондовый индекс.

28. Первоначальная маржа взимается со сторон фьючерсного контракта для того, чтобы:

- a) обеспечить необходимый размер комиссионных брокера;
- b) кредитовать участников торговли при совершении сделок «без покрытия»;
- c) гарантировать исполнение сделки;
- d) компенсировать издержки биржи на совершение операции.

29. Фьючерсные контракты стандартизированы по следующим параметрам:

- a) количество базисного актива;
- b) срок поставки;
- c) цена базисного актива;
- d) наименование биржи, на которой продается контракт.

30. При покупке опциона на продажу:

- a) держатель опциона играет на повышение, надписатель – на понижение;
- b) держатель опциона играет на понижение, надписатель – на повышение;
- c) держатель и надписатель играют на повышение;
- d) держатель и надписатель играют на понижение.

31. Фьючерсный контракт ликвидируется

- a) в одностороннем порядке покупателем;
- b) в одностороннем порядке продавцом;
- c) путем заключения офсетной сделки (контракта);
- d) расчетной палатой.

32. при совершении сделок конфиденциальной является информация:

- a) о лицах, участвующих в сделке;
- b) опережающая сумму сделки;
- c) полученная из неофициальных источников;
- d) использование которой способно нанести ущерб интересам эмитента или инвестора.

33. К какой группе моделей графического способа технического анализа принадлежит модель «двойная вершина»:

- a) модели перелома тенденции;
- b) модели подтверждения тенденции.

34. К органам, регулирующим фондовый рынок в России не относятся:

- a) министерство Финансов;
- b) центральный Банк;
- c) министерство по налогам и сборам;
- d) федеральная комиссия по ценным бумагам;

35. Саморегулирование на рынке ценных бумаг это – :

- a) передача государством части своих функций по регулированию рынка профессиональным участникам рынка ценных бумаг;
- b) создание системы экспертных советов ФСФР;
- c) система управления портфельными рисками.

36. Государственное регулирование деятельности на рынке ценных бумаг в РФ осуществляется путем:

- a) лицензирования деятельности профессиональных участников фондового рынка;
- b) участия в саморегулируемых организациях;
- c) непосредственного управления деятельностью профессиональных участников фондового рынка.

37. Укажите неверное утверждение в отношении прав саморегулируемых организаций (СРО):

- a) СРО имеет право получать информацию по результатам проводимых ФСФР России проверок деятельности своих членов;
- b) СРО имеет полномочия по применению дисциплинарных мер к руководителям и специалистам организаций - членов СРО, включая лишение указанных лиц квалификационных аттестатов ФСФР России;
- c) СРО имеет право разрабатывать правила и стандарты осуществления профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, обязательные для соблюдения членами СРО;
- d) СРО имеет право контролировать соблюдение членами СРО принятых правил и стандартов осуществления профессиональной деятельности.

38. В техническом анализе используются:

- a) финансовый анализ эмитента;
- b) осцилляторы;
- c) макроэкономический анализ;
- d) скользящие средние;
- e) трендовые модели.

39. Подтверждением фигуры «голова и плечи» является:

- a) уменьшение объема торговли при повышении цены;
- b) рост объема торговли при снижении цены;
- c) уменьшение объема торговли при снижении цены;
- d) рост объема торговли при повышении цены.

40. Если линия скользящей средней находится ниже ценового графика, то тренд является:

- a) восходящим;
- b) боковым;
- c) нисходящим

Типовые вопросы к экзамену:

1. Фондовая биржа. История бирж. Понятие, функции и организационные основы деятельности фондовой биржи.
2. Виды членства и требования, предъявляемые к членам фондовой биржи. Виды торговых аукционов, используемых на фондовых биржах
3. Биржевые приказы и их использование в торговых стратегиях
4. Основы организации внебиржевого оборота по ценным бумагам
5. Внебиржевые рынки: понятие, классификация и организационные основы
6. Зарубежный и отечественный опыт организации внебиржевых компьютерных рынков
7. Виды сделок и операций с ценными бумагами
8. Сделки и операции с ценными бумагами: классификация, перечень видов и экономическое содержание
9. Фьючерсные и опционные сделки
10. Запрещенные сделки на рынке ценных бумаг
11. Интернет – трейдинг. Сущность Интернет-трейдинга
12. Технология работы с Интернет-брокером
13. Системы Интернет–трейдинга
14. Регулирование рынка ценных бумаг и правовая инфраструктура. Этика фондового рынка
15. Основы регулятивной инфраструктуры фондового рынка
16. Государственное регулирование рынка ценных бумаг
17. Саморегулирующиеся организации
18. Этика фондового рынка
19. Информационная инфраструктура фондового рынка
20. Основы информационной инфраструктуры рынка ценных бумаг
21. Субъекты системы раскрытия информации
22. Инсайдерская информация на рынке ценных бумаг
23. Поставщики информационных ресурсов на фондовом рынке
24. Технический анализ на рынке ценных бумаг
25. Принципы технического анализа
26. Графические способы технического анализа
27. Количественные методы технического анализа