

Документ подписан электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Косенок Сергей Михайлович
Должность: ректор
Дата подписания: 19.06.2024 06:53:38
Уникальный программный ключ:
e3a68f3eaa1e62674b54f4998099d3d6bfdcf836

Форма оценочного материала для диагностического тестирования

Тестовое задание для диагностического тестирования по дисциплине:

Моделирование рынка ценных бумаг, 7 семестр

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

Диагностическое тестирование, 7 семестр

Проверяемая компетенция	Задание	Варианты ответов	Тип сложности вопроса	Кол-во баллов за правильный ответ
ПК-5	К какой группе моделей графического способа технического анализа принадлежит модель «двойная вершина»:	а. модели перелома тенденции; б. модели подтверждения тенденции.	Низкий	2
ПК-11	Стоп-лимитный приказ на покупку ценной бумаги по цене X – это:	а. приказ начать продавать, как только цена поднимется до уровня X , но не выше цены Y , где $Y > X$; б. приказ начать покупать, как только цена опустится до уровня X , но не ниже цены Y , где $Y < X$; в. приказ начать покупать, как только цена поднимется до уровня X , но не выше цены Y , где $Y > X$.	Низкий	2
ПК-5	Базисным активом, лежащим в основе финансового	а. облигации; б. своп; в. драгоценные	Низкий	2

	фьючерсного контракта, могут быть:	металлы; г. акции; д. фондовый индекс.		
ПК-11	В техническом анализе используются:	а. финансовый анализ эмитента; б. осцилляторы; в. макроэкономический анализ; г. скользящие средние; д. трендовые модели.	Низкий	2
ПК-5	Фьючерсный контракт ликвидируется:	а. в одностороннем порядке покупателем; б. в одностороннем порядке продавцом; в. путем заключения офсетной сделки (контракта); г. расчетной палатой.	Низкий	2
ПК-11	Определить коэффициент Шарпа, если известно, что доходность оцениваемого портфеля/актива – 6,88%; доходность безрискового вложения – 1,15%; стандартное отклонение доходности оцениваемого портфеля от доходности безрискового вложения – 13.	а. 0,44 б. 0,88 в. 1,23 г. 2,13	Средний	5
ПК-5	Средняя прибыль с учетом реинвестирования составила 14 000 д. е., усреднённое снижение стоимости активов за год составила 26 000 д.е. Определить коэффициент прибыли.	а. 0,90 б. 0,53 в. 0,22 г. 0,1	Средний	5
ПК-11	Последняя цена закрытия "Газпром", акция обыкновенная (GAZP) составляет 243,9 рублей. Цена закрытия 9 дневная	а. 1,14 б. 1,5 в. 1,8 г. 0,5	Средний	5

	составляет 212,5 рублей. Определить темп изменений 9-ти дневной ROC)			
ПК-5	Рассчитать годовое отношение прибыли/убытки, если известно, что среднее арифметическое годовых прибылей актива составляет 30 000 д.е., среднее значение максимальных годовых падений прибыли составляет 38 000 д.е.	а. 0,90 б. 0,80 в. 0,78 г. 0,2	Средний	5
ПК-11	Определить среднегодовую прибыль актива с учетом реинвестирования, если известно, что стартовая стоимость актива равна 3000 д.е., доходность в процентах с учетом реинвестирования процентов 10%, количество лет, пользования активом составляет 2 года.	а. 3500 б. 3900 в. 3630 г. 4000	Средний	5
ПК-5	Самая последняя цена закрытия "Магнит", акция обыкновенная (MGNT) 5 629 рублей. Цена закрытия 10 дней назад равна 5 601,5 рублей. Определить осциллятор скорости рынка.	а. 27,5 б. 30 в. 40 г. 50	Средний	5
ПК-11	Последняя цена закрытия "Нефтяная компания "Роснефть", акция обыкновенная (ROSN) равна	а. 1,4 б. 1,02 в. 1,6 г. 1,8	Средний	5

	372,05 рублей. Цена закрытия 15-ти дней назад равна 362,5 рублей. Определить осциллятор темпа изменений (ROC).			
ПК-5	Среднее значение положительных изменений цен 14-ти дневного периода закрытия "Сбербанк России", акция обыкновенная (SBER) равен 1,26. Определить индекс относительной силы (RSI).	а. 25 б. 30 в. 55,76 г. 80	Средний	5
ПК-11	Определить экспоненциальную среднюю скользящую (EMA), если известно, что сглаживающий фактор равен 0,33, текущая цена составляет 290 рублей, предыдущее значение EMA составляет 300.	а. 300 б. 400 в. 277 г. 500	Средний	5
ПК-5	Определить показатель моментум (в процентах), если известно, что текущая цена закрытия составляет 300 рублей, цена закрытия 9-ти периодов назад составляет 250 рублей.	а. 120 б. 200 в. 300 г. 80	Средний	5
ПК-11	Максимум за N периодов равна 205 рублей, минимум за N периодов равен 180 рублей, цена закрытия текущего периода равна 190 рублей. Определить	а. 200 б. 300 в. 400 г. 40	Высокий	8

	стохастический осциллятор (в процентах).			
ПК-5	Определить функцию накопления, если известно, что цена закрытия равна 400 рублей, минимальная цена составляет 300 рублей, максимальная цена периода составляет 420 рублей, объём торгов составляет 20 000.	а. 25 000 б. 30 000 в. 13 333 г. 40 000	Высокий	8
ПК-11	Подтверждением фигуры «голова и плечи» является:	а. уменьшение объема торговли при повышении цены; б. рост объема торговли при снижении цены; в. уменьшение объема торговли при снижении цены; г. рост объема торговли при повышении цены.	Высокий	8
ПК-5	Стоп-приказ на покупку ценной бумаги по цене X – это:	а. приказ покупать, как только цена поднимется до уровня X; б. приказ покупать, как только цена опустится до уровня X; в. приказ продавать, как только цена опустится до уровня X;	Высокий	8
ПК-11	При _____ первой _____ идет короткая белая свеча, а второй — длинная черная, и если посмотреть, то тело левой свечи внутри тела правой свечи.	а. «Медвежьим поглощением». б. «Бычьим поглощением» в. «Медвежьим падением» г. «Бычьим падением»	Высокий	8

*В таблицу необходимо внести вопросы в соответствии со структурой диагностического теста (25% - вопросы низкого уровня сложности (не менее 5 штук); 50% - вопросы среднего уровня сложности (не менее 10 штук); 25% - вопросы высокого уровня сложности (не менее 5 штук).

