Министерство сельского хозяйства Российской Федерации
федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования
"Вятский государственный агротехнологический университет"

УТВЕРЖДАЮ
Декан экономического факультета
_____ Т.Б. Шиврина
"27" октября 2022 г.

Статистический анализ финансовых рынков

рабочая программа дисциплины (модуля)

Закреплена за кафедрой **информационных технологий и статистики**

Учебный план 01.03.05 Статистика
направленность (профиль) программы бакалавриата "Экономическая статистика и анализ данных"

Квалификация **бакалавр**

Форма обучения **очная**

Общая трудоемкость **3 ЗЕТ**

Часов по учебному плану 108
в том числе:
аудиторные занятия 50
самостоятельная работа 58

Виды контроля в семестрах:
зачеты 7

Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	**7 (4.1)**			
Недель	17			
Вид занятий	УП	РП	УП	РП
Лекции	16	16	16	16
Лабораторные	34	34	34	34
В том числе инт.	10	10	10	10
Итого ауд.	50	50	50	50
Контактная работа	50	50	50	50
Сам. работа	58	58	58	58
Итого	108	108	10	108

Киров 2022

ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН
ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ
Сертификат: 4285BD6BEB8900E0BFFD5A2C6C4531B6
Владелец: Симбирских Елена Сергеевна
Действителен: с 25.05.2023 до 17.08.2024

Программу составил(и):
к.э.н., доцент кафедры информационных технологий и статистики, Гришина Елена Николаевна
_____

Рецензент(ы):
к.п.н., доцент кафедры информационных технологий и статистики, Дьячков Валерий Павлович
_____

Рабочая программа дисциплины

Статистический анализ финансовых рынков
разработана в соответствии с ФГОС:

Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - бакалавриат по направлению подготовки 01.03.05 Статистика (приказ Минобрнауки России от 14.08.2020 г. № 1032)

составлена на основании Учебного плана:

01.03.05 Статистика
направленность (профиль) программы бакалавриата "Экономическая статистика и анализ данных"
одобренного и утвержденного Ученым советом университета от 27.10.2022 протокол № 10.

Рабочая программа дисциплины рассмотрена и одобрена учебно-методической комиссией

Протокол № 2р/2022-23 от "27" октября 2022 г.

Рабочая программа дисциплины рассмотрена и одобрена на заседании кафедры

информационных технологий и статистики

Протокол № _4а___ от "27" октября 2022 г.

Зав. кафедрой _____К.э.н., доцент Козлова Лариса Алексеевна

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2023-2024 учебном году на заседании кафедры

Протокол от "__" _____ 2023 г. № __

Зав. кафедрой _____

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2024-2025 учебном году на заседании кафедры

информационных технологий и статистики

Протокол от "__" _____ 2024 г. № __

Зав. кафедрой _____

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2025-2026 учебном году на заседании кафедры

информационных технологий и статистики

Протокол от "__" _____ 2025 г. № __

Зав. кафедрой _____

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2026-2027 учебном году на заседании кафедры

информационных технологий и статистики

Протокол от "__" _____ 2026 г. № __

Зав. кафедрой _____

1. ЦЕЛЬ (ЦЕЛИ) ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ	
1.1	является формирование у будущих специалистов теоретических знаний методологии формирования основных индикаторов финансовых рынков. Овладение практическими навыками по экономико-статистическому анализу финансовых рынков и
1.2	выработке конкретных предложений, рекомендаций на основе проведенного анализа

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП	
Цикл (раздел) ОПОП:	Б1.В
2.1	**Требования к предварительной подготовке обучающегося:**
2.1.1	Обучающийся должен обладать индикаторами достижения компетенций, полученными при изучении следующих дисциплин: Математическая статистика, Финансы, деньги, кредит, банки, Статистика рынка товаров и услуг, Прикладная статистика и интеллектуальный анализ данных
2.2	**Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:**
2.2.1	Государственная итоговая аттестация

3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)	
ПК-2	Способен применять инструментальные средства для анализа и визуализации информации, относящейся к предметной области
ПК-2.1	Знать инструментальные средства для анализа и визуализации информации, относящейся к предметной области
ПК-2.2	Уметь осуществлять выбор инструментальных средств и способ визуализации под конкретную профессиональную задачу
ПК-2.3	Владеть навыками использования инструментальных средств для анализа и визуализации информации, относящейся к предметной области

В результате освоения дисциплины обучающийся должен

3.1	**Знать:**
3.1.1	методы и приемы обработки и анализа информации в статистике
3.1.2	основы организации и функционирования системы государственной статистики, источники статистической информации; виды и формы статистического наблюдения, виды группировок, приемы их построения, совокупность относительных и обобщающих показателей, методы анализа динамических (временных) рядов и построения статистических моделей взаимосвязи и прогнозирования социально-экономических явлений и процессов; назначение, экономическое содержание и методику расчета показателей социально-экономической статистики; методы исчисления основных статистических характеристик, прогнозирование на основе статистических данных
3.2	**Уметь:**
3.2.1	применять методы и приемы статистики для обработки и анализа информации
3.2.2	оценивать достоверность источников статистической информации; анализировать данные отечественной и зарубежной статистики; проводить специальные статистические наблюдения
3.3	**Иметь навыки и (или) опыт деятельности (Владеть):**
3.3.1	методами и приемами статистики для обработки и анализа информации
3.3.2	методами статистического исследования социально-экономических процессов, исчисления основных статистических характеристик, прогнозирования на основе статистических данных

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Код занятия	Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр / Курс	Часов	Компетенции (индикаторы)	Литература	Инте ракт.	Примечание
	Раздел 1. Общая теория						
1.1	Предмет, метод и задачи статистического анализа финансовых рынков. /Лек/	7	4	ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-2.3	Л1.2 Л1.1Л2.1 Л2.2Л3.1 Э1	0	
1.2	Предмет, метод и задачи статистического анализа финансовых рынков. /Лаб/	7	2	ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-2.3	Л1.2 Л1.1Л2.1 Л2.2Л3.1 Э1	0	
1.3	Статистический анализ фондового рынка /Лек/	7	4	ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-2.3	Л1.2 Л1.1Л2.1 Л2.2Л3.1 Э1	0	

1.4	Статистический анализ фондового рынка /Лаб/	7	8	ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-2.3	Л1.2 Л1.1Л2.1 Л2.2Л3.1 Э1	4	
1.5	Статистический анализ страхового рынка /Лек/	7	2	ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-2.3	Л1.2 Л1.1Л2.1 Л2.2Л3.1 Э1	0	
1.6	Статистический анализ страхового рынка /Лаб/	7	8	ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-2.3	Л1.2 Л1.1Л2.1 Л2.2Л3.1 Э1	4	
1.7	Статистический анализ рынка инвестиций /Лек/	7	2	ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-2.3	Л1.2 Л1.1Л2.1 Л2.2Л3.1 Э1	0	
1.8	Статистический анализ рынка инвестиций /Лаб/	7	8	ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-2.3	Л1.2 Л1.1Л2.1 Л2.2Л3.1 Э1	2	
1.9	Статистический анализ денежного рынка /Лек/	7	4	ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-2.3	Л1.2 Л1.1Л2.1 Л2.2Л3.1 Э1	0	
1.10	Статистический анализ денежного рынка /Лаб/	7	8	ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-2.3	Л1.2 Л1.1Л2.1 Л2.2Л3.1 Э1	0	
1.11	Подготовка к текущему контролю, самостоятельно еизучение тем дисциплины, подготовка практическим и лекционным занятиям /Ср/	7	30	ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-2.3	Л1.2 Л1.1Л2.1 Л2.2Л3.2 Л3.1 Э1 Э2 Э3	0	
1.12	Подготовка к зачету /Ср/	7	28	ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-2.3	Л1.2 Л1.1Л2.1 Л2.2Л3.2 Л3.1 Э1 Э2 Э3	0	

5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Рабочая программа дисциплины обеспечена фондом оценочных средств для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации. Содержание фонда оценочных средств представлено в Приложении 1 и 2.

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

6.1. Рекомендуемая литература

6.1.1. Основная литература

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство,
Л1.1	В. Б. Яковлев	Статистика. Расчеты в microsoft excel [Электронный ресурс]: учебное пособие для вузов Режим доступа: https://urait.ru/bcode/453051	Юрайт, 2020
Л1.2	Под ред. М.Г. Назарова	Статистика [электронный ресурс]: учеб.-практическое пособие Режим доступа: https://book.ru/book/932682	М.: Кнорус, 2018

6.1.2. Дополнительная литература

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство,
Л2.1	под редакцией И. И. Елисеевой	Статистика [Электронный ресурс]: учебник для вузов Режим доступа: https://urait.ru/bcode/449726	Юрайт, 2020
Л2.2	Дудин, М. Н.	Статистика [Электронный ресурс]: учебник и практикум для вузов Режим доступа: https://urait.ru/bcode/490318	Юрайт, 2022

6.1.3. Методические разработки

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство,

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство,
Л3.1	Гришина Е.Н	Учебно-методическое пособие для практических занятий [Электронный ресурс]: : учебно-методическое пособие для практических занятий Режим доступа: http://46.183.163.35/MarcWeb2/Default.asp	ФГБОУ ВО Вятский ГАТУ, 2023
Л3.2	Гришина Е.Н	Учебно-методическое пособие для самостоятельной работы [Электронный ресурс]: учебно-методическое пособие для самостоятельной работы Режим доступа: http://46.183.163.35/MarcWeb2/Default.asp	ФГБОУ ВО Вятский ГАТУ, 2023
6.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"			
Э1	Научная электронная библиотека [Электронный ресурс]. - Режим доступа: http://elibrary.ru/defaultx.asp		
Э2	Министерство экономического развития Российской Федерации [Электронный ресурс]. - Режим доступа: https://www.economy.gov.ru/ . - Загл. с экрана.		
Э3	Министерство сельского хозяйства Российской Федерации [Электронный ресурс]. - Режим доступа: https://mcx.gov.ru/ . - Загл. с экрана.		
6.3. Перечень информационных технологий			
6.3.1 Перечень программного обеспечения			
6.3.1.1	Операционная система семейства Windows (Windows Vista Business AO NL, MS Win Prof 7 AO NL, Win Prof 7 AOL NL, Win Home Bas 7 AOL NL LGG, Win Starter 7 AO NL LGG, Win SL 8 AOL NL LGG, Win Prof 8 AOL NL, Win Home 10 All Languages Online Product Key License)		
6.3.1.2	Приложения Office (MS Office Prof Plus 2007 AO NL, MS Office Prof Plus 2010 AO NL, MS Office 2013 OL NL, MS OfficeStd 2016 RUS OLP NL Acdmc)		
6.3.1.3	Free Commander 2009/02b		
6.3.1.4	Google Chrome 39/0/21/71/65		
6.3.1.5	Opera 26/0/1656/24		
6.3.1.6	Adobe Reader XI 11/0/09		
6.3.2 Перечень информационных справочных систем и современных профессиональных баз данных			
6.3.2.1	Информационная справочная система: КонсультантПлюс		
6.3.2.2	Информационная справочная система: Гарант Аэро		
6.3.2.3	Профессиональная база данных: Научная электронная библиотека elibrary.ru Режим доступа: http://elibrary.ru/defaultx.asp		
6.3.2.4	Профессиональная база данных: Электронный каталог ФГБОУ ВО Вятский ГАТУ Режим доступа http://46.183.163.35/MarcWeb2		
6.3.2.5	Профессиональная база данных: Центральная база статистических данных (ЦБСД) Режим доступа: https://rosstat.gov.ru/databases		
6.3.2.6	Профессиональная база данных: Региональная база статистических данных «Кировской области» Режим доступа: http://statkirov.ru/dg/dbinet.cgi		
6.3.2.7	Профессиональная база данных: Инспекция Федеральной налоговой службы по городу Кирову, Режим доступа: https://www.nalog.ru/rn43/ifns/imns43_17/		
6.3.2.8	Профессиональная база данных: Управления Федерального казначейства по Кировской области, Режим доступа: http://kirov.roskazna.ru/		
6.3.2.9	Профессиональная база данных: Официальный сайт Министерства сельского хозяйства и продовольствия Кировской области, http://www.dsx-kirov.ru/		

7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

7.1	Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю) представлено в Приложении 3 РПД

8. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Освоение дисциплины "Статистика" проводится в форме аудиторных занятий и внеаудиторной самостоятельной работы обучающихся.

При проведении аудиторных занятий предусмотрено применение следующих инновационных форм учебных занятий, развивающих у обучающихся навыки командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерские качества: творческие задания, дискуссия, использование общественных ресурсов, обсуждение и разрешение проблем, встречи с представителями российских и зарубежных компаний. Количество часов занятий в интерактивных формах определено учебным планом.

Практическая подготовка при реализации дисциплины организуется путем проведения практических занятий, предусматривающих участие обучающихся в выполнении отдельных элементов работ, связанных с будущей профессиональной деятельностью.

Внеаудиторная самостоятельная работа осуществляется в следующих формах:

• самостоятельное изучение теоретического материала (тем дисциплины);

• подготовка к лабораторным, практическим, семинарским занятиям;

• выполнение домашних тестовых и иных индивидуальных заданий;
• подготовка к мероприятиям текущего контроля;
• подготовка к промежуточной аттестации.
При организации самостоятельной работы необходимо, прежде всего, обратить внимание на ключевые понятия, несущие основную смысловую нагрузку в том или ином разделе учебной дисциплины.

1. Самостоятельное изучение тем дисциплины.
Для работы необходимо ознакомиться с учебным планом дисциплины и установить, какое количество часов отведено учебным планом в целом на изучение дисциплины, на аудиторную работу с преподавателем на лекционных и практических (семинарских), лабораторных занятиях, а также на самостоятельную работу. С целью оптимальной самоорганизации необходимо сопоставить эту информацию с графиком занятий и выявить наиболее затратные по времени и объему темы, чтобы заранее определить для себя периоды объемных заданий. Целесообразно начать работу с изучения теоретического материала, основных терминов и понятий курса и с письменных ответов на индивидуальные и тестовые задания.

2. Подготовка к лекционным и практическим (семинарским), лабораторным занятиям
.Традиционной формой преподнесения материала является лекция. Курс лекций по предмету дает необходимую информацию по изучению закономерностей и тенденций развития объекта и предмета исследования изучаемой дисциплины. Лекционный материал рекомендуется конспектировать. Конспекты позволяют обучающемуся не только получить больше информации на лекции, но и правильно его структурировать, а в дальнейшем - лучше освоить.
Цель практических (семинарских) занятий заключается в закреплении теоретического материала по наиболее важным темам, в развитии у обучающихся навыков критического мышления в данной области знания, умений работы с учебной и научной литературой, нормативными материалами. В ходе подготовки к практическому (семинарскому) занятию обучающимся следует внимательно ознакомиться с планом, вопросами, вынесенными на обсуждение, досконально изучить соответствующий теоретический материал, предлагаемую учебную методическую и научную литературу. Рекомендуется обращение обучающихся к монографиям, статьям из специальных журналов, хрестоматийным выдержкам, а также к материалам средств массовой информации по теме, что позволяет в значительной мере углубить проблему и разнообразить процесс ее обсуждения.
Подготовка к лабораторным занятиям носит различный характер как по содержанию, так и по сложности исполнения. Многие лабораторные занятия требуют большой исследовательской работы, изучения дополнительной научной литературы. Прежде чем приступить к выполнению такой работы, обучающемуся необходимо ознакомиться обстоятельно с содержанием задания, уяснить его, оценить с точки зрения восприятия и запоминания все составляющие его компоненты. Результаты эксперимента, графики и т.д. следует стремиться получить непосредственно при выполнении работы в лаборатории. Лабораторная работа считается выполненной только в том случае, когда отчет по ней принят. Чем скорее составлен отчет после проведения работы, тем меньше будет затрачено труда и времени на ее оформление.

3. Подготовка к мероприятиям текущего контроля
В конце изучения каждой темы может проводиться тематическая контрольная работа, которая является средством промежуточного контроля оценки знаний. Подготовка к ней заключается в повторении пройденного материала и повторном решении заданий, которые рассматривались на занятиях, а также в выполнении заданий для самостоятельной работы.

4. Подготовка к промежуточной аттестации.
Подготовка к зачету является заключительным этапом изучения дисциплины и является средством промежуточного контроля. Подготовка к зачету предполагает изучение конспектовлекций, рекомендуемой литературы и других источников, повторение материалов практических занятий. В процессе подготовки к зачету выявляются вопросы, по которым нет уверенности в ответе либо ответ обучающемуся не ясен. Данные вопросы можно уточнить у преподавателя на консультации, которая проводится перед зачетом

Приложение 1

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ
для проведения промежуточной аттестации по дисциплине
Статистический анализ финансовых рынков

Направление подготовки 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) программы бакалавриата «Экономическая статистика и анализ данных»
Квалификация бакалавр

1. Описание назначения и состава фонда оценочных средств

Настоящий фонд оценочных средств (ФОС) входит в состав рабочей программы дисциплины «Статистический анализ финансовых рынков» и предназначен для оценки планируемых результатов обучения – сформированности индикаторов достижения компетенций и опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций (п.2) в процессе изучения данной дисциплины.

ФОС включает в себя оценочные материалы для проведения промежуточной аттестации в форме зачета.

ФОС разработан на основании:

- Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - бакалавриат по направлению подготовки 01.03.05 Статистика (приказ Минобрнауки России от 14.08.2020 г. № 1032);
- основной профессиональной образовательной программы высшего образования по направлению подготовки 01.03.05 Статистика направленности (профилю) программы бакалавриата «Экономическая статистика и анализ данных»;
- Положения «О формировании фонда оценочных средств для промежуточной и итоговой аттестации обучающихся по образовательным программам высшего образования».

2. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

- Способен применять инструментальные средства для анализа и визуализации информации, относящейся к предметной области (ПК-2).

Код формируемой компетенции	Этапы формирования компетенции в процессе освоения образовательной программы		
	Начальный этап	**Основной этап**	**Заключительный этап**
ПК-2	• Прикладная статистика и интеллектуальный анализ данных • Производственная практика: научно-аналитическая работа	• Статистический анализ финансовых рынков • Бизнес-аналитика • Социальная статистика • Статистический анализ нечисловой информации • Производственная практика: практика по профилю профессиональной деятельности	• Подготовка к государственной итоговой аттестации

3. Планируемые результаты освоения образовательной программы по дисциплине, выраженные через компетенции и индикаторы их достижений, описание шкал оценивания

Код и наименование формируемых компетенций	Код и наименование индикатора достижения формируемой компетенции		Наименование контролируемых разделов и тем	Наименование оценочного средства промежуточной аттестации
ПК-2 Способен применять инструментальные средства для анализа и визуализации информации, относящейся к предметной области	ПК-2.	Знать инструментальные средства для анализа и визуализации информации, относящейся к предметной области	Раздел 4 рабочей программы дисциплины	Тестовые вопросы к зачету по дисциплине
	ПК-2.2	Уметь осуществлять выбор инструментальных средств и способ визуализации под конкретную профессиональную задачу		
	ПК-2.3	Владеть навыками использования инструментальных средств для анализа и визуализации информации, относящейся к предметной области		

Для оценки сформированности соответствующих компетенций по дисциплине «Статистический анализ финансовых рынков» при проведении промежуточной аттестации в форме зачета применяется следующая шкала оценивания:

№	Критерии оценивания	Шкала оценивания	
		не зачтено	зачтено
		Описание показателя	
1	Полнота знаний теоретического контролируемого материала	Низкий уровень усвоения материала. Продемонстрировано незнание значительной части учебного материала - менее 60% правильных ответов	Продемонстрированы знания основного учебного материала - не менее 60% правильных ответов
2	Логичность, обоснованность, четкость ответа на вопросы	Существенные ошибки, нет ответов на дополнительные уточняющие вопросы	Грамотное и по существу изложение теоретического материала, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос
3	Работа в течение семестра, наличие задолженности по текущему контролю успеваемости.	Имеются значительные пропуски занятий, задолженность по текущему контролю знаний	Активная работа, задолженность отсутствует

4. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки сформированности компетенций в процессе освоения образовательной программы

Тестовые задания
по дисциплине «Статистический анализ финансовых рынков»
для промежуточной аттестации в форме зачета

1 Укажите правильное утверждение о соотношении риска и дохода при инвестировании на рынке ценных бумаг (ПК-2):
A. Чем ниже риск, тем выше должен быть ожидаемый доход;
B. Чем выше риск, тем выше должен быть ожидаемый доход;
C. Чем выше доход, тем ниже должен быть предполагаемый риск;
D. Риск и доход не связаны между собой.

2 Что такое ликвидность ценной бумаги (ПК-2):
A. Возможность быстрого обмена ценной бумаги на денежные средства без существенных потерь в стоимости;
B. Возможность совершения сделок купли-продажи по данной ценной бумаги;
C. Установление равновесной цены на данную ценную бумагу;
D. Получение регулярного дохода от вложений средств в данную ценную бумагу.

3 Компания осуществила дробление акций из соотношения 1:4. Каким будет количество и совокупная номинальная стоимость пакета акционера, владевшего до операции дробления пакетом из 100 акций совокупной номинальной стоимостью 500 руб. (без учета российской практики) (ПК-2):
A. 25 акций и 125 руб.;
B. 25 акций и 500 руб.;
C. 100 акций и 2 000 руб.;
D. 400 акций и 500 руб.

4 Общество учреждено с уставным капиталом 100 тыс. руб. Уставом общества определено, что общее количество объявленных акций номинальной стоимостью 1 тыс. руб. составляет 2 000. Общество произвело размещение 1 тыс. дополнительных акций номинальной стоимостью 1 тыс. руб. Чему равен уставный капитал общества (ПК-2):
A. 100 тыс. руб.;
B. 1,1 млн руб.;
C. 2 млн. руб.;
D. 3,1 млн руб.

5 Страхование рисков получения убытков от изменения цен на финансовые активы, процентных ставок или валютных курсов называется (ПК-2):
A. Хеджирование;
B. Арбитраж;
C. Секьюритизация;
D. Диверсификация.

6 Как называется инвестирование средств на рынке ценных бумаг, при котором средства, вложенные большим количеством инвесторов (преимущественно мелких), объединяются в единый фонд (пул) под управлением профессионального управляющего для их последующего инвестирования с целью получения инвестиционного дохода: (ПК-2)

A. Прямое инвестирование;
B. Портфельное инвестирование;
C. Косвенное инвестирование;
D. Коллективное инвестирование.

7 Капитализация компании – это: (ПК-2)

A. Сумма произведений курсов акций компании на количество акций, выпущенных компанией;
B. Совокупный объем эмиссии ценных бумаг, обращающихся на рынке;
C. Совокупный акционерный капитал компаний-эмитентов по номинальной стоимости;
D. Совокупная рыночная стоимость активов компаний-эмитентов.

8 Российская организация выплачивает дивиденды физическому лицу – резиденту Российской Федерации. По какой ставке будет удержан налог с дивидендов: (ПК-2)

A. 9%;
B. 13%;
C. 20%;
D. 35%.

9 Какой минимальный процент владения голосующими акциями общества предоставляет акционеру право блокировать решения общего собрания акционеров: (ПК-2)

A. 10%;
B. 25%+1 акция;
C. 50%+1 акция;
D. 75%.

10 Какому виду профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг соответствует деятельность по совершению сделок от своего имени и за свой счет: (ПК-2)

A. Брокерской деятельности;
B. Дилерской деятельности;
C. Деятельности по организации торговли на рынке ценных бумаг;
D. Клиринговой деятельности.

Вопросы для подготовки к зачету по дисциплине
«Статистический анализ финансовых рынков»

1. Предмет, методы и задачи статистического анализа финансовых рынков.
2. Финансовый рынок как объект статистического изучения.
3. Система показателей статистики финансовых рынков и методы их анализа
4. Понятие фондового рынка.
5. Виды ценных бумаг.
6. Участники фондового рынка.
7. Профессиональные участники рынка ЦБ
8. Экспертный анализ рынка ценных бумаг.
9. Фундаментальный анализ РЦБ.
10. Технический подход анализа фондового рынка.
11. Система показателей статистика фондового рынка на макро-уровне.
12. Система показателей статистики фондового рынка на микро-уровне.
13. Скользящие средние в анализе фондового рынка.
14. Оценка волатильности.
15. Биржевые индексы.
16. Показатели структуры и структурных сдвигов в анализе фондового рынка.
17. Статистическая оценка реального спроса на деньги.
18. Статистическое изучение структуры денежной массы, находящейся в обращении.
19. Статистический анализ миграции денег.
20. Методология статистического анализа инвестиционных процессов
21. Информационная база статистического изучения инвестиций.

22. Статистические методы анализа инвестиций
23. Методологические основы статистического изучения страхового рынка.
24. Предмет , показатели и задачи статистики страхования.
25. Система показателей страхового рынка

5. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания сформированности индикаторов достижения компетенций и опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций.

Процедура оценивания сформированности индикаторов достижения компетенций при проведении промежуточной аттестации по дисциплине «Статистический анализ финансовых рынков» проводится в форме зачета.

Порядок организации и проведения промежуточной аттестации обучающегося, форма проведения, процедура сдачи зачета, сроки и иные вопросы определены Положением о порядке организации и проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся.

Процедура оценивания сформированности индикаторов достижения компетенций при проведении зачета проводится путем письменного или компьютерного тестирования обучающихся:

- обучающемуся выдается вариант письменного или компьютерного теста;
- обучающийся отвечает на вопросы теста, в котором представлены все изучаемые темы дисциплины;
- по результатам тестирования выставляется оценка, согласно установленной шкалы оценивания.

Для подготовки к зачету рекомендуется использовать лекционный и практический материал по дисциплине, литературные источники, рекомендованные в рабочей программе дисциплины.

Приложение 2

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ
для проведения текущего контроля успеваемости по дисциплине
Статистический анализ финансовых рынков

Направление подготовки 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) программы бакалавриата «Экономическая статистика и анализ данных»
Квалификация бакалавр

1. Описание назначения и состава фонда оценочных средств

Настоящий фонд оценочных средств (ФОС) входит в состав рабочей программы дисциплины «Статистический анализ финансовых рынков» и предназначен для оценки планируемых результатов обучения - сформированности индикаторов достижения компетенций и опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения дисциплины.

2. Перечень компетенций, формируемых при изучении дисциплины

Общепрофессиональные компетенции:

- Способен применять инструментальные средства для анализа и визуализации информации, относящейся к предметной области (ПК-2);

3. Банк оценочных средств

Для оценки сформированности индикаторов достижения компетенций и опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения дисциплины «Статистический анализ финансовых рынков» используются следующие оценочные средства:

Код и наименование формируемых компетенций	Код и наименование индикатора достижения формируемой компетенции		Критерии оценивания	Наименование контролируемых разделов и тем	Наименование оценочного средства текущей аттестации
ПК-2 Способен применять инструментальные средства для анализа и визуализации информации, относящейся к предметной области	ПК-2.	Знать инструментальные средства для анализа и визуализации информации, относящейся к предметной области	- Полнота знаний контролируемого материала - Логичность, обоснованность, четкость ответа на вопросы	Раздел 4 рабочей программы дисциплины.	Разноуровневые задачи
	ПК-2.2	Уметь осуществлять выбор инструментальных средств и способ визуализации под конкретную профессиональную задачу			
	ПК-2.3	Владеть навыками использования инструментальных средств для анализа и визуализации информации, относящейся к предметной области			

Разноуровневые задачи

для проведения текущего контроля знаний по дисциплине «Статистический анализ финансовых рынков»

Текущий контроль в форме разноуровневых задач предназначен для определения уровня оценки сформированности индикаторов достижения компетенций и опыта деятельности в процессе изучения дисциплины обучающимися очной формы обучения.Результаты текущего контроля в форме контрольной работы оцениваются посредством интегральной (целостной) шкалы:

Критерии оценивания	Шкала оценивания			
	неудовлетворительно	удовлетворительно	хорошо	отлично
	показатели			
Правильность решения контрольных задач	неправильное применение методики, неверные расчеты	существенные замечания по расчетам	правильное применение методик с незначительными замечаниями по расчетам	правильное применение методик, отсутствие замечаний по расчетам

Типовые разноуровневые задачи

Задача 1.По данным о результатах торгов финансовыми активами (finam.ru) постройтелинейный график объемов торгов.

Задача 2.По данным о результатах торгов финансовыми активами (finam.ru) постройтерадиальную диаграмму цен закрытия.

Задача 3.По данным о результатах торгов финансовыми активами (finam.ru) постройтеспиральную диаграмму цен закрытия.

Задача 4.По данным о результатах торгов финансовыми активами (finam.ru) постройтегистограмму.

Задача 5.По данным о результатах торгов финансовыми активами (finam.ru) постройте график японских свечей.

Задача 6. Имеются следующие данные по объему торгов основными видамиакций в РТС.

Эмитент	Млн.руб.	
	Август 2021г	Сентябрь 2021г
ОАО Сбербанк России	1 557 869 966	1 463 813 797
ОАО Газпром	601 464 212	631 087 315
ОАО ЛУКОЙЛ	321 427 828	303 471 030
ОАО НК Роснефть	197 428 124	215 475 694
ОАО ГМК Норильский никель	95 821 677	67 079 688
ОАО Сургутнефтегаз	41 495 058	50 925 535
ОАО Банк ВТБ	38 408 742	36 983 702
ЗАО УК Тройка Диалог	31 129 036	31 034 522
ОАО Уралкалий	9 200 095	4 094 359
Прочие	93 308 665	51 568 135

Проведите анализ структуры и динамики торгов. Сделайте выводы.

Задача 7. Постройте линейный график динамики цен закрытия ОАО Газпром. Сделайте выводы.

Дата	Цена закрытия
20160906	92,47
20160909	94,81
20160910	96,55
20160911	95,5
20160912	95,53
20160913	95,82
20160916	98,97
20160917	99,6
20160918	99,79
20160919	102,33
20160920	102,36

Задача 8.Имеются следующие данные по объему торгов основными видами акцийв РТС.

Эмитент	Млн.руб.	
	Август 2012г	Сентябрь 2012г
ОАО Сбербанк России	1 557 869 966	1 463 813 797
ОАО Газпром	601 464 212	631 087 315
ОАО ЛУКОЙЛ	321 427 828	303 471 030
ОАО НК Роснефть	197 428 124	215 475 694
ОАО ГМК Норильский никель	95 821 677	67 079 688
ОАО Сургутнефтегаз	41 495 058	50 925 535
ОАО Банк ВТБ	38 408 742	36 983 702
ЗАО УК Тройка Диалог	31 129 036	31 034 522
ОАО Уралкалий	9 200 095	4 094 359
Прочие	93 308 665	51 568 135

Проведите анализ структурных сдвигов. Сделайте выводы.

Методические материалы, определяющие процедуру оценивания

Процедура оценивания сформированности индикаторов достижения компетенций и опыта деятельности в процессе изучения дисциплины при проведении текущего контроля знаний проводится путем выполнения заданий теста на практических занятиях. Тестирование проводится после изучения соответствующей темы дисциплины. При подготовке к тестированию обучающимся рекомендуется использовать материал по дисциплине. Обучающемуся выдается вариант письменного или компьютерного теста (система Moodle). Оценка проводится посредством интегральной (целостной) двухуровневой шкалы.

Приложение 3

ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Статистический анализ финансовых рынков

Наименование специальных помещений	Оснащенность специальных помещений
Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа	Д212 Доска маркерная, рабочее место преподавателя, комплект столов и стульев для обучающихся, комплект мультимедийного оборудования с экраном Список ПО: Windows, MicrosoftOffice, KasperskyAntivirusи свободно распространяемое программное обеспечение
Учебная аудитория для занятий семинарского типа	Д212 Доска маркерная, рабочее место преподавателя, комплект столов и стульев для обучающихся, комплект мультимедийного оборудования с экраном Список ПО: Windows, MicrosoftOffice, KasperskyAntivirusи свободно распространяемое программное обеспечение Д124 Доска, рабочее место преподавателя, комплект столов и стульев для обучающихся, комплект мультимедийно-го оборудования с экраном, 12 персональных компьютеров, принтер Список ПО: Windows, MicrosoftOffice, KasperskyAntivirus,KasperskyEndpointSecurity, Гарант Аэро, Консультант Плюс, Программный комплекс «Компьютерная деловая игра «БИЗНЕС-КУРС: Корпорация Плюс. Версия4», KonSiSWOT – Analysis, KonSiAnketter, 1С Предприятие 7.7, 8.3 с конфигурациями и свободно распространяемое программное обеспечение
Учебная аудитория для групповых и индивидуальных консультаций.	Д124 Доска, рабочее место преподавателя, комплект столов и стульев для обучающихся, комплект мультимедийно-го оборудования с экраном, 12 персональных компьютеров, принтер Список ПО: Windows, MicrosoftOffice, KasperskyAntivirus,KasperskyEndpointSecurity, Гарант Аэро, Консультант Плюс, Программный комплекс «Компьютерная деловая игра «БИЗНЕС-КУРС: Корпорация Плюс. Версия4», KonSiSWOT – Analysis, KonSiAnketter, 1С Предприятие 7.7, 8.3 с конфигурациями и свободно распространяемое программное обеспечение
Учебная аудитория для текущего контроля и промежуточной аттестации.	Д124 Доска, рабочее место преподавателя, комплект столов и стульев для обучающихся, комплект мультимедийно-го оборудования с экраном, 12 персональных компьютеров, принтер Список ПО: Windows, MicrosoftOffice, KasperskyAntivirus,KasperskyEndpointSecurity, Гарант Аэро, Консультант Плюс, Программный комплекс «Компьютерная деловая игра «БИЗНЕС-КУРС: Корпорация Плюс. Версия4», KonSiSWOT – Analysis, KonSiAnketter, 1С Предприятие 7.7, 8.3 с конфигурациями и свободно распространяемое программное обеспечение
Помещение для самостоятельной работы	Б202 с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду организации). Компьютер администратора, 5 персональных компьютеров, 3 принтера, видеоувеличитель. Список ПО: Windows, MicrosoftOffice, KasperskyAntivirusи свободно распространяемое программное обеспечение

Приложение 4

Перечень периодических изданий, рекомендуемый по дисциплине

«Статистический анализ финансовых рынков»

Наименование	Наличие доступа
Вопросы статистики ежегодник [Текст]: науч.-информ. журн. / учредитель Федер. служба гос. статистики	Читальный зал библиотеки ФГБОУ ВО Вятский ГАТУ
Вопросы экономики [Текст]:ежемес. журн. / учредители : НП "Ред. журн. Вопросы экономики", Ин-т экономики РАН	Читальный зал библиотеки ФГБОУ ВО Вятский ГАТУ