



Инвестиционный анализ.ти_ФРК

- 1 Установите соответствие между видами рынков и его сущностью в зависимости от классификации финансовых рынков
- 2 Какое из следующих утверждений с точки зрения выбора инвестиций является справедливым? (выберите два ответа)
- 3 Укажите финансовые инструменты, которые считаются инвестициями с низким уровнем риска (выберите три ответа)
- 4 Для акций компаний первого эшелона, называемых blue chips, или «голубых фишек», характерными являются следующие параметры (выберите три ответа)
- 5 Способ снижения совокупного риска портфеля финансовых активов (ценных бумаг), заключающийся в распределении инвестиций между различными активами с минимальной корреляцией доходностей, входящими в него, называется...
- 6 Волатильность – это...
- 7 Способность ценной бумаги быстро и без существенных потерь продаваться на финансовом рынке при незначительных колебаниях курсовой стоимости называется...
- 8 В соответствии с Гражданским кодексом Российской Федерации ценными бумагами являются (выберите два ответа)
- 9 Гражданский кодекс Российской Федерации относит к ценным бумагам перечисленные ниже документы, за исключением...
- 10 Именной является документарная ценная бумага, по которой лицом, уполномоченным требовать исполнения по ней, признается... (выберите два ответа)
- 11 Как называется способ передачи прав по ценной бумаге путем совершения на этой бумаге передаточной надписи?
- 12 Установите соответствие между характеристикой финансового инструмента и его названием
- 13 К прямому инвестированию относится...
- 14 Денежный рынок предназначен для обслуживания потребностей предприятия (выберите два ответа)





- 15) В какой форме могут выпускаться предъявительские ценные бумаги?
- 16) Какие ценные бумаги выпускает Минфин России?
- 17) Установите соответствие между термином и его определением
- 18) К общерыночным функциям рынка ценных бумаг не относится...
- 19) Лицо, обладающее уникальной информацией и имеющее влияние на принятие решений
- 20) Комплекс структурных подразделений, способствующих заключению и исполнению сделок, а также выполняющих функцию информационной поддержки участников РЦБ
- 21) Что такое риск профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг?
- 22) К какому типу рисков относится нежелание контрагента исполнить свои обязательства в соответствии с условиями договора?
- 23) К какому типу рисков относится возникновение убытков вследствие неблагоприятного изменения курсов иностранных валют?
- 24) К какому типу рисков относится возникновение убытков вследствие неспособности обеспечить исполнение собственных обязательств в полном объеме?
- 25) Какие параметры необходимо определять при оценивании риска профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг? (выберите два ответа)
- 26) Что можно оценить с помощью показателя дюрации?
- 27) Менеджер управлял портфелем в течение 100 дней. В начале периода в портфель инвестировали 20 млн. руб. Через 100 дней его стоимость выросла до 23 млн. руб. Определить доходность управления портфелем в расчете на год на основе эффективного процента. Финансовый год равен 365 дням.
- 28) Инвестиционный рынок состоит из...
- 29) Капитальные вложения включают...





- 30) Стандартное отклонение доходности рыночного индекса равно 25%, доходности акции компании А – 20%, коэффициент корреляции между доходностями рыночного индекса и акции А составляет 0,68. Определить коэффициент бета акции А относительно рыночного индекса.
- 31) Ставка без риска равна 10%, ожидаемая доходность рыночного портфеля – 20%, бета акции компании А относительно рыночного портфеля – 1,2. Определить ожидаемую доходность акции.
- 32) Инвестор сформировал портфель из 6000 акций и 400 облигаций. Стоимость одной акции 10 руб., облигации – 100 руб. Стоимостная пропорция акций и облигаций в портфеле составляет 60/40. Инвестор планирует восстанавливать данное соотношение всякий раз при его нарушении вследствие изменения курсовой стоимости бумаг. На следующий день цена облигации упала до 99 руб. Инвестор восстанавливает первоначальную ценовую пропорцию между акциями и облигациями в портфеле. Определить новое количество акций и облигаций, которое должно входить в портфель.
- 33) Менеджер управлял портфелем в течение четырех лет. В начале первого года в портфель инвестировали 20 млн. руб. В конце года его стоимость выросла до 21 млн. руб. В начале второго года в портфель внесли дополнительно 2 млн. руб. В конце года его стоимость составила 26 млн. руб. В начале третьего года из портфеля изъяли 3 млн. руб. В конце года его стоимость составила 25 млн. руб. В начале четвертого года в портфель добавили 2 млн. руб. В конце года его стоимость составила 30 млн. руб. Определить риск портфеля, измеренный выборочным стандартным отклонением.
- 34) Фактическая доходность портфеля X равна 21%, стандартное отклонение доходности 14%, доходность и стандартное отклонение портфеля Y соответственно равны 25% и 18%, ставка без риска 8% годовых. Определить с помощью коэффициента Шарпа, какой портфель управлялся эффективнее.
- 35) Дисконтирование – это...
- 36) Установите соответствие между категориями инвестора и отношениям к риску
- 37) Установите соответствие между изменениями функции полезности инвестора к риску и поведением инвестора в отношении своего портфеля
- 38) Какое из следующих утверждений относительно показателя дюрации является неверным?





- 39) Какое из представленных определений точно характеризует сущность рыночного портфеля?
- 40) Ставка дисконтирования определяется на основе...
- 41) На рисунке сплошной линией изображен график изменения цен, при этом пунктиром обозначена линия, которая называется...
- 42) Как называется фигура, образованная графиком изменения цен?
- 43) Как называется фигура, изображенная на рисунке?
- 44) На рисунке изображены графики цен и скользящей средней. В какой из отмеченных точек имеется сигнал к продаже?
- 45) Если цена акции А «пробила» линию поддержки, то теперь данная линия считается...
- 46) Фигуры, выходя из которых цена продолжает двигаться в ту же сторону, в какую она двигалась при входе в фигуру называются...
- 47) Открывать позиции при достижении ценой линий поддержки/сопротивления необходимо...
- 48) Очень большой угол наклона тренда (чем круче тренд), чаще всего означает...
- 49) Технические индикаторы – это...
- 50) Длительное нахождение цены над и под МА генерирует...
- 51) Что является более сильным фактором, который необходимо учитывать, при принятии решения, показания осцилляторов или направление тренда?
- 52) Дивергенция – это...
- 53) Торговля на основе технического анализа называется...
- 54) Что отражает столбиковый ценовой график? (выберите 3 ответа)
- 55) В течение последних шести дней торгов цена акций компании XYZ последовательно принимала значения 9, 8, 7, 5, 8, 10. Каким будет значение 4-дневной взвешенной скользящей средней для шестого дня торгов?





- 56) При каком из приведенных ниже сигналов индекса относительной силы можно ожидать падения цен в ходе развития повышательного тренда?
- 57) Что показывает изменение объема сделок при движении цены? (выберите два ответа)
- 58) Перелом тенденции – это...
- 59) На уровне поддержки...
- 60) Метод экспоненциального скользящего среднего...
- 61) На каких исходных положениях базируется фундаментальный анализ? (выберите три ответа)
- 62) Какой признак является наиболее характерным для недооцененных акций?
- 63) Что из ниже перечисленного может являться признаком переоцененности акций компании при сравнении ее показателей с их среднеотраслевыми значениями?
- 64) Какой показатель может служить основанием для покупки акции данной компании при сравнении ее текущих показателей с соответствующими значениями в прошлом?
- 65) Какие ключевые показатели из перечисленных ниже используются в фундаментальном анализе? (выберите два ответа)
- 66) Показатель EBITDA рассчитывается следующим образом...
- 67) Уставный капитал компании составляют 500 тыс. обыкновенных и 100 тыс. привилегированных акций. Прибыль компании до уплаты налогов равна 10 млн. руб., а величина налога на прибыль – 2 млн. руб. Величина дивиденда по привилегированным акциям составляет 6 руб. на одну акцию. Рассчитайте значение показателя EPS.
- 68) Уставный капитал компании составляет 300 тыс. руб. Продано всего 1500 акций, в том числе 1250 акций обыкновенных и 250 акций привилегированных с одним и тем же номиналом. Общая сумма чистой прибыли, подлежащая распределению в виде дивидендов, 31 тыс. руб. Уставом общества предусмотрено, что по привилегированным акциям фиксированная ставка дивиденда утверждена в размере 20% от номинала привилегированной акции. Рассчитать сумму дивиденда на обыкновенную акцию.





- 69) По итогам года по акции выплачен дивиденд в размере 32,5 руб. на акцию. Предполагается, что прибыль и дивиденды будут расти в дальнейшем на 12% в год. Используя модель роста дивидендов, оцените стоимость акции в рублях, если ожидаемая доходность по акции составляет 16,3%.
- 70) По акции компании А был выплачен дивиденд 10 руб. на акцию. Инвестор полагает, что в течение последующих лет темп прироста дивиденда составит 6% в год. Доходность равная риску покупки акции равна 25%. Определить цену акции.
- 71) Курс акции компании А составляет 45 руб., доходность равная риску инвестирования в акцию 15%. На акцию был выплачен дивиденд 2 руб. Определить темп прироста будущих дивидендов, если он предполагается постоянным.
- 72) Курс акции компании А составляет 56 руб., доходность равная риску инвестирования в акцию 17%. На акцию был выплачен дивиденд 5 руб. Определить темп прироста будущих дивидендов, если он предполагается постоянным.
- 73) Облигация с фиксированным купоном, равным 20% от номинала и выплачиваемым ежегодно, куплена по курсу 90. Срок облигации 10 лет. Какова доходность к погашению с учетом дисконтирования?
- 74) Из двух облигаций с одинаковой доходностью к погашению и одинаковым сроком чувствительность к колебаниям доходности меньше у той, у которой...
- 75) Дисконтированная стоимость – это...
- 76) Установите соответствие между финансовыми показателями и их содержанием
- 77) Установите соответствие между финансовыми показателями и их содержанием
- 78) Рыночная стоимость всех выпущенных в обращение ценных бумаг определённого вида называется...
- 79) Что такое инвестиционная стратегия?
- 80) Верно ли утверждение «Объектами инвестирования могут быть только акции или облигации»?
- 81) Для чего нужна инвестиционная стратегия? (выберите два варианта ответа)
- 82) Что может случиться, если у инвестора нет стратегии? (выберите два варианта ответа)





- 83) Верно ли утверждение «В случае корректного распределения активов любая коррекция на рынке принесёт меньше потерь?»
- 84) Верно ли утверждение «Инвестиционная стратегия позволяет сократить временные затраты при выборе инструментов?»
- 85) Согласно исследованию Гарри Бринсона что больше всего повлияло на портфель американских пенсионных фондов?
- 86) Назовите этапы формирования инвестиционной стратегии... (выберите четыре варианта ответа)
- 87) Какие вопросы стоит задать себе при начале инвестирования?
- 88) Верно ли утверждение «Может быть только одна цель инвестирования?»
- 89) Какие инструменты подходят лучше остальных при инвестировании на срок до 1 года? (выберите два варианта ответа)
- 90) Какие инструменты подходят лучше остальных при инвестировании на срок от 1 до 5 лет? (выберите два варианта ответа)
- 91) Какие инструменты подходят лучше остальных при инвестировании на срок от 5 лет?
- 92) Какая валюта подходит лучше остальных при инвестировании на срок до 1 года?
- 93) Какая(ие) валюта(ы) подходи(я)т лучше остальных при инвестировании на срок от 1 до 5 лет?
- 94) Необходимо ли делать диверсификацию по валютам на срок от 5 лет?
- 95) Укажите верное утверждение...
- 96) Гарантированы ли доходности на фондовых рынках?
- 97) Средний прирост индекса S&P за 10 лет...
- 98) Средний прирост индекса Мосбиржи за 10 лет...
- 99) Назовите принципы инвестиционной стратегии...
- 100) Какие два основных подхода существуют в инвестициях?





- 101) Что из нижеперечисленного относится к трейдингу? (выберите три варианта ответа)
- 102) Что из нижеперечисленного относится к компьютерному анализу? (выберите три варианта ответа)
- 103) Активный подход включает в себя...
- 104) Выберите верные утверждения (выберите два варианта ответа)
- 105) Технический анализ включает в себя... (выберите два варианта ответа)
- 106) DCF, Модель Гордона, мультипликаторы относятся к...
- 107) Паттерны, уровни поддержки/сопротивления, Фибоначчи относятся к...
- 108) Компьютерный анализ включает в себя?
- 109) SMA/EWMA, MACD, RSI относятся к...
- 110) Математические модели, технологии машинного обучения, искусственные нейросети относятся к...
- 111) Кто заложил основы стоимостного инвестирования?
- 112) Один из самых ярких представителей количественного инвестирования является...
- 113) Верно ли утверждение «Основной подход Уоррена Баффета в управлении активами – технический анализ»?
- 114) Что из перечисленного относится к активно-пассивному подходу? (выберите четыре варианта ответа)
- 115) Что относится к оптимизационным моделям?
- 116) Какой из нижеперечисленных факторов является ключевым при самостоятельном инвестировании?
- 117) С какими проблемами сталкиваются инвесторы при начале работы?
- 118) Доверительное управление и паевые инвестиционные фонды относятся к...
- 119) управляющей компании





- 120) Форвардные контракты, структурные ноты относятся к...
- 121) НСЖ, ИСЖ относятся к...
- 122) Верно ли утверждение «Персональный брокер» – это страховой продукт?
- 123) Структурный продукт – это...
- 124) Верно ли утверждение «Единица участия в ПИФ – это пай»?
- 125) Верно ли утверждение «УК осуществляет сделки от своего имени, но в интересах клиента, за что получает вознаграждение в виде части заработанной прибыли либо как процент от стоимости активов, находящихся в управлении»?
- 126) Верно ли, что в рамках структурированного продукта могут сочетаться облигации и опционы?
- 127) Верно ли, что ПИФ – это форма коллективного инвестирования?
- 128) Верно ли, что любое доверительное управление гарантирует доход не менее 10%?
- 129) Выберите верные утверждения (выберите два варианта ответа)
- 130) Что такое fintarget?
- 131) Какие услуги доступны на Fintarget.ru?
- 132) Что такое автоследование?
- 133) Что такое услуга «Автоконсультирование»?
- 134) Верно ли, что ПО Fintarget на стороне компании в режиме онлайн сравнивает состав модельного портфеля автора и брокерский счёт клиента?
- 135) Верно ли, что каждый клиент получает документарное подтверждение проведённой сделки – ИИР?
- 136) Что включает в себя ИИР?
- 137) Верно ли, что, платформа Fintarget несёт ответственность за корректное исполнение рекомендаций?





- 138 Верно ли, что платформа Fintarget несёт ответственность за то, чтобы все идеи приносили доход?
- 139 Верно ли, что при подключении автоследования активы остаются на брокерском счёте инвестора?

