



Федеральное агентство по рыболовству  
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Калининградский государственный технический университет»  
(ФГБОУ ВО «КГТУ»)

УТВЕРЖДАЮ  
Директор института

Фонд оценочных средств  
(приложение к рабочей программе модуля)  
**«СОВРЕМЕННЫЕ ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ»**

основной профессиональной образовательной программы магистратуры  
по направлению подготовки  
**38.04.08 ФИНАНСЫ И КРЕДИТ**

Профиль программы  
**«УПРАВЛЕНИЕ КОРПОРАТИВНЫМИ ФИНАНСАМИ»**

ИНСТИТУТ  
РАЗРАБОТЧИК

отраслевой экономики и управления  
кафедра экономики и финансов

## 1 РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ, ПЕРЕЧЕНЬ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ И КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ

### 1.1 Результаты освоения дисциплины

Таблица 1 – Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с установленными компетенциями

Код и наименование компетенции	Дисциплина	Результаты обучения (владения, умения и знания), соотнесенные с компетенциями
<p>ПК-1.2: Разрабатывает финансовый план для клиента и целевой инвестиционный портфель.</p> <p>ПК-3.5: Определяет методы и средства решения задач исследования, сбор, обработку, анализ и систематизацию информации о современных финансовых рынках.</p> <p>ПК-8.2: Выбирает методы и средства решения задач исследования, собирает, обрабатывает, анализирует и систематизирует информацию о современных финансовых рынках.</p>	<p>Финансовые рынки</p>	<p><b>Результаты обучения (владения, умения и знания), соотнесенные с компетенциями</b></p> <p><b>Знать:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>– современные и классические теоретические концепции развития и функционирования финансовых рынков;</li> <li>– состав и структуру финансового рынка, методы оценки его безопасности;</li> <li>– принципы и методы организации и управления финансовыми рынками;</li> <li>– основные инструменты финансового рынка и присущие им риски;</li> </ul> <p><b>Уметь:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>– анализировать деятельность участников финансового рынка, применяя методы сравнения при выборе инструментов анализа безопасности финансовых рынков;</li> <li>– определять виды рисков финансового института; проводить их оценку;</li> <li>– осуществлять финансово-экономический анализ участников рынка (компаний финансового и нефинансового сектора);</li> <li>- консультировать по вопросам управления рисками в целях укрепления корпоративной экономической безопасности</li> </ul> <p><b>Владеть:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>– методами управления рисками на финансовых рынках в целях укрепления экономической безопасности;</li> <li>– навыками анализа направлений деятельности финансово-кредитных институтов в условиях изменений на рынках капитала;</li> <li>– навыками анализа различных финансовых инструментов и присущих им рисков;</li> <li>– приемами макроэкономического анализа финансовых рынков, анализа безопасности финансовых рынков.</li> </ul>

1.2 К оценочным средствам текущего контроля успеваемости относятся:

- типовые задания по контрольной работе;
- тестовые задания открытого и закрытого типов.

К оценочным средствам для промежуточной аттестации относятся:

–тестовые задания по дисциплине, представленные в виде тестовых заданий закрытого и открытого типов..

#### 1.4 Критерии оценки результатов освоения дисциплины

Универсальная система оценивания результатов обучения включает в себя системы оценок: 1) «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно»; 2) «зачтено», «не зачтено»; 3) 100 – балльную/процентную систему и правило перевода оценок в пятибалльную систему (табл. 2).

Таблица 2 – Система оценок и критерии выставления оценки

Система оценок Критерий	2	3	4	5
	0-40%	41-60%	61-80 %	81-100 %
	«неудовлетворительно»	«удовлетворительно»	«хорошо»	«отлично»
	«не зачтено»	«зачтено»		
<b>1 Системность и полнота знаний в отношении изучаемых объектов</b>	Обладает частичными и разрозненными знаниями, которые не может научно- корректно связывать между собой (только некоторые из которых может связывать между собой)	Обладает минимальным набором знаний, необходимым для системного взгляда на изучаемый объект	Обладает набором знаний, достаточным для системного взгляда на изучаемый объект	Обладает полной знаний и системным взглядом на изучаемый объект
<b>2 Работа с информацией</b>	Не в состоянии находить необходимую информацию, либо в состоянии находить отдельные фрагменты информации в рамках поставленной задачи	Может найти необходимую информацию в рамках поставленной задачи	Может найти, интерпретировать и систематизировать необходимую информацию в рамках поставленной задачи	Может найти, систематизировать необходимую информацию, а также выявить новые, дополнительные источники информации в рамках поставленной задачи
<b>3 Научное осмысление изучаемого явления, процесса, объекта</b>	Не может делать научно корректных выводов из имеющихся у него сведений, в состоянии проанализировать только некоторые из имеющихся у него сведений	В состоянии осуществлять научно корректный анализ предоставленной информации	В состоянии осуществлять систематический и научно корректный анализ предоставленной информации, вовлекает в исследование новые релевантные задаче данные	В состоянии осуществлять систематический и научно-корректный анализ предоставленной информации, вовлекает в исследование новые релевантные поставленной задаче данные, предлагает новые ракурсы поставленной задаче

Система оценок  Критерий	2	3	4	5
	0-40%	41-60%	61-80 %	81-100 %
	«неудовлетворительно»	«удовлетворительно»	«хорошо»	«отлично»
	«не зачтено»	«зачтено»		
<b>4 Освоение стандартных алгоритмов решения профессиональных задач</b>	В состоянии решать только фрагменты поставленной задачи в соответствии с заданным алгоритмом, не освоил предложенный алгоритм, допускает ошибки	В состоянии решать поставленные задачи в соответствии с заданным алгоритмом	В состоянии решать поставленные задачи в соответствии с заданным алгоритмом, понимает основы предложенного алгоритма	Не только владеет алгоритмом и понимает его основы, но и предлагает новые решения в рамках поставленной задачи

1.5 Оценивание тестовых заданий закрытого типа осуществляется по системе зачтено/ не зачтено («зачтено» – 41-100% правильных ответов; «не зачтено» – менее 40 % правильных ответов) или пятибалльной системе (оценка «неудовлетворительно» - менее 40 % правильных ответов; оценка «удовлетворительно» - от 41 до 60 % правильных ответов; оценка «хорошо» - от 61 до 80% правильных ответов; оценка «отлично» - от 81 до 100 % правильных ответов).

Тестовые задания открытого типа оцениваются по системе «зачтено/ не зачтено». Оценивается верность ответа по существу вопроса, при этом не учитывается порядок слов в словосочетании, верность окончаний, падежи.

## 2 ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ТЕКУЩЕЙ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

**Индикатор ПК-1.2:** Разрабатывает финансовый план для клиента и целевой инвестиционный портфель.

**Индикатор ПК-3.5:** Определяет методы и средства решения задач исследования, сбор, обработку, анализ и систематизацию информации о современных финансовых рынках.

**Индикатор ПК-8.2:** Выбирает методы и средства решения задач исследования, собирает, обрабатывает, анализирует и систематизирует информацию о современных финансовых рынках.

### Тестовые задания открытого типа

#### ПК-1.2

1. В соответствии с Конституцией РФ основной функцией Центрального банка является обеспечение

**Ответ: устойчивости рубля**

2. Правовые основы договора банковского вклада (депозита) определяет

**Ответ: Гражданский кодекс\* / ГК\***

3. Правовые основы кредитования определяет

**Ответ: Гражданский кодекс\* / ГК\***

4. В России без ограничений разрешены расчеты в иностранной валюте между

**Ответ: нерезидентами**

5. Эмиссия ценных бумаг на организованном рынке осуществляется в  форме

**Ответ: бездокументарной**

6. Юридическое лицо, которое является одной из сторон заключаемых договоров на организованных торгах, называется

**Ответ: центральный контрагент**

7. Центральный контрагент должен иметь лицензию

**Ответ: небанковской кредитной организации / НКО**

8. Оформление обязательств перед кредиторами в виде ценных бумаг называется

**Ответ: РЕПО**

9. Сделка с расчетами в текущий день называется

**Ответ: балансовая**

### ПК-3.5

10. Рыночный риск реализуется в случае, когда стоимость актива

**Ответ: уменьшилась, снизилась**

11. Изменение ключевой ставки Центрального банка генерирует  риск

**Ответ: процентный**

12. Увеличение рисков, связанных с ДОЛГОВОЙ ценной бумагой, приводит к  доходности

**Ответ: росту**

13. Ссуда, характеризуемая средним финансовым положением заемщика и средним качеством обслуживания долга, имеет категорию

**Ответ: сомнительная**

14. Ссуда, характеризуемая средним финансовым положением заемщика и хорошим качеством обслуживания долга, имеет категорию

**Ответ: нестандартная**

15. Ссуда с расчетным резервом на возможные потери 60% имеет категорию

**Ответ: проблемная**

16. Денежная сумма, исходя из которой устанавливаются размер страхового взноса и страховой выплаты, называется

**Ответ: страховая сумма**

### **ПК-8.2**

17. Нормативный показатель, определяющий степень покрытия рисков собственными средствами банка, называется

**Ответ: норматив достаточности капитала**

18. Соотношение высоколиквидных активов и обязательств до востребования банка называется нормативом

**Ответ: мгновенной ликвидности**

19. Норматив  коммерческих банков определяет структуру источников финансирования кредитов со сроком свыше 1 года

**Ответ: долгосрочной ликвидности**

20. Открытая валютная позиция это разность между  в отдельной валюте

**Ответ: активами и пассивами**

21. Цена обратного РЕПО ниже, чем прямого возможна, если срок РЕПО включает

**Ответ: купонный период**

22.  риск – риск возникновения убытков вследствие неисполнения, несвоевременного либо неполного исполнения должником финансовых обязательств в соответствии с условиями договора

**Ответ: кредитный**

### **Тестовые задания закрытого типа**

#### **ПК-1.2**

23. Независимость Банка России установлена

1. **Конституцией Российской Федерации**
2. Гражданским кодексом
3. **Законом о Центральном банке РФ**
4. Законом о банках и банковской деятельности

24. Расчеты в иностранной валюте между резидентами внутри России

1. разрешены без ограничений
2. запрещены
3. **запрещены с отдельными исключениями**
4. не являются валютными операциями

### ПК-3.5

25. Справедливая стоимость ценной бумаги

1. **стоимость, оцениваемая по результатам торгов на бирже**
2. стоимость внебиржевой сделки между двумя независимыми и осведомленными сторонами
3. стоимость, подтвержденная сертифицированным оценщиком
4. номинальная стоимость

26. Для расчета полной доходности акции необходимо знать

1. размер дивиденда и цену акции на конкретную дату
2. **размер дивиденда, цену покупки и цену продажи акции**
3. цену покупки и цену продажи акции
4. размер дивиденда, номинальную стоимость и цену продажи акции

27. Цена обратного РЕПО ниже, чем прямого

1. возможна при снижении курса акций на рынке
2. **возможна при наступлении купонного периода**
3. возможна при изменении ключевой ставки
4. невозможна

**ПК-8.2**

28. Установите соответствие между финансовыми инструментами и связанными с ними понятиями

1	паевой инвестиционный фонд	А	дивиденды
2	акции	Б	операционная маржа
3	облигации	В	управляющая компания
4	фьючерс	Г	купонный доход
		Д	своп

**Ответ: 1–В, 2–А, 3–Г, 4–Б**

29. Укажите последовательность, в которой участники рынка ценных бумаг выполняют операции при покупке финансового инструмента

1	Брокер
2	Центральный контрагент
3	Клиринговый центр
4	Депозитарий

**Ответ: 1234**

30. Установите соответствие между финансовыми инструментами и присущими им рисками

1	акции	А	кредитный риск
2	облигации	Б	риск ликвидности
3	депозиты	В	фондовый риск
4	интервальный ПИФ	Г	процентный риск
		Д	операционный риск

**Ответ: 1–В, 2–А, 3–Г, 4–Б**

### **3 ТИПОВЫЕ ЗАДАНИЯ НА КОНТРОЛЬНУЮ РАБОТУ, КУРСОВУЮ РАБОТУ/КУРСОВОЙ ПРОЕКТ, РАСЧЕТНО-ГРАФИЧЕСКУЮ РАБОТУ**

3.1 Контрольная работа направлена на закрепление полученных теоретических знаний и приобретение умений и навыков в области получения актуальных данных об индикаторах финансовых рынков и их анализа с использованием вычислительной техники.

Варианты заданий для контрольной работы принимаются в соответствии с вариантами, приведенными в учебно-методическом пособии по изучению дисциплины.

Цель контрольной работы: раскрыть теоретический вопрос, провести анализ показателей валютного рынка и рынка ценных бумаг.

3.2 Типовые задания для проведения анализа.

1. Получить с сайта Банка России данные об изменении курсов иностранных валют к российскому рублю.

2. Провести анализ изменения курсов доллара США и евро к российскому рублю.

3. Привести описание иностранной валюты в соответствии с вариантом задания. На основе расчета кросс-курсов иностранной валюты к доллару США и евро провести анализ изменения курса указанной валюты с представлением результата в графическом виде.

4. Привести характеристику эмитента ценной бумаги в соответствии с вариантом задания.

5. Получить с сайта InvestFunds.ru данные об изменении курсов ценной бумаги за установленный период.

6. Провести анализ динамики курса ценной бумаги, оценить риски, связанные с ценной бумагой, провести расчет доходности операций с ценной бумагой.

7. Подготовить данные для технического анализа изменений курса ценной бумаги с использованием диаграммы «японские свечи».

8. Провести сопоставление динамики курса ценной бумаги с индексом Московской биржи, сделать вывод о ее позиции по отношению к рынку ценных бумаг.

#### **4 СВЕДЕНИЯ О ФОНДЕ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ И ЕГО СОГЛАСОВАНИИ**

Фонд оценочных средств для аттестации по дисциплине «Современные финансовые рынки» представляет собой компонент основной профессиональной образовательной программы магистратуры по направлению подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит», профиль программы «Управление корпоративными финансами».

Преподаватель-разработчик – к.э.н. Евстафьев Константин Александрович.

Фонд оценочных средств рассмотрен и одобрен заведующим кафедрой экономики и финансов (протокол № 9 от 14.05.2024г.).

Заведующий кафедрой \_\_\_\_\_ А. Г. Мнацаканян

Фонд оценочных средств рассмотрен и одобрен методической комиссией ИНОТЭКУ (протокол № 5 от 20.05.2024 г).

Фонд оценочных средств актуализирован, рассмотрен и одобрен методической комиссией ИНОТЭКУ (протокол № 8 от 28.08.2024 г).

Председатель методической комиссии



И.А. Крамаренко