



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)
«ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ»

основной профессиональной образовательной программы бакалавриата
по направлению подготовки
38.03.01 ЭКОНОМИКА

Профиль программы
«БИЗНЕС-АНАЛИТИКА И КОРПОРАТИВНЫЕ ФИНАНСЫ»

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-2 Способен осуществлять сбор, мониторинг и обработку данных для проведения расчетов экономических показателей организации, консультировать по вопросам использования финансовых продуктов и услуг, ведению учета и составлению финансовой отчетности, формированию инвестиционного портфеля; выявлять и оценивать риски при принятии решений на основе разработанных для них целевых показателей</p>	<p>Финансовые рынки</p>	<p>Знать: – современные и классические теоретические концепции развития и функционирования финансовых рынков; – состав и структуру финансового рынка; – принципы и методы организации и управления финансовыми рынками; – основные инструменты финансового рынка; Уметь: – анализировать деятельность участников финансового рынка; – проводить оценку финансовых инструментов; – определить структуру рисков финансового института; – осуществлять финансово-экономический анализ участников рынка (компаний финансового и нефинансового сектора); Владеть: – навыками анализа направлений деятельности финансово-кредитных институтов в условиях изменений на рынках капитала; – навыками анализа различных финансовых инструментов; – основами макроэкономического анализа финансовых рынков.</p>

1.2 Промежуточная аттестация по дисциплине проводится в форме зачета, который выставляется по результатам прохождения всех видов текущего контроля успеваемости. При необходимости тестовые задания закрытого и открытого типов могут быть использованы для проведения текущей аттестации.

1.3 К оценочным средствам текущего контроля успеваемости относятся:

– 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»		
1 Системность и полнота знаний в отношении изучаемых объектов	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 полнотой знаний и системным взглядом на изучаемый объект
2 Работа с информацией	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
3 Научное осмысление изучаемого явления, процесса, объекта	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 данные	В состоянии осуществлять систематический и научно-корректный анализ предоставленной информации, вовлекает в исследование новые релевантные поставленной задачи данные, предлагает новые ракурсы поставленной задачи
4 Освоение стандартных алгоритмов решения профессиональных задач	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

Компетенция ПК-2: Способен осуществлять сбор, мониторинг и обработку данных для проведения расчетов экономических показателей организации, консультировать по вопросам использования финансовых продуктов и услуг, ведению учета и составлению финансовой отчетности, формированию инвестиционного портфеля; выявлять и оценивать риски при принятии решений на основе разработанных для них целевых показателей.

Тестовые задания открытого типа

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. Вставьте математический оператор: при короткой открытой валютной позиции А П

Ответ: <

6. Открытая валютная позиция это разность между в отдельной валюте

Ответ: активами и пассивами

7. Рыночный риск реализуется в случае, когда стоимость актива

Ответ: уменьшилась, снизилась

8. Изменение ключевой ставки Центрального банка генерирует риск

Ответ: процентный

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

Ответ: кредитный

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

Ответ: росту

11. Эмиссия ценных бумаг на организованном рынке осуществляется в форме

Ответ: бездокументарной

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

Ответ: сомнительная

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

Ответ: нестандартная

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

Ответ: проблемная

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

Ответ: центральный контрагент

16. Паевой инвестиционный фонд это

Ответ: имущественный комплекс

17. Центральный контрагент должен иметь лицензию

Ответ: небанковской кредитной организации / НКО

18. В соответствии с федеральным законом ипотека это

Ответ: залог недвижимости

19. Оформление обязательств перед кредиторами в виде ценных бумаг называется

Ответ: РЕПО

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

Ответ: купонный период

21. Сделка с расчетами в текущий день называется

Ответ: балансовая

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

Ответ: страховая сумма

Тестовые задания закрытого типа:

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

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

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. 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

30. 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

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

Данный вид контроля по дисциплине не предусмотрен учебным планом.

4 СВЕДЕНИЯ О ФОНДЕ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ И ЕГО СОГЛАСОВАНИИ

Фонд оценочных средств для аттестации по дисциплине «Финансовые рынки» представляет собой компонент основной профессиональной образовательной программы бакалавриата по направлению подготовки 38.03.01 – Экономика (профиль Бизнес-аналитика и корпоративные финансы).

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

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

Заведующий кафедрой

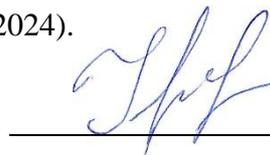


А. Г. Мнаçаканян

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

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

Председатель методической комиссии



И. А. Крамаренко