

СТЕРЛИТАМАКСКИЙ ФИЛИАЛ
ФЕДЕРАЛЬНОГО ГОСУДАРСТВЕННОГО БЮДЖЕТНОГО ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО
УЧРЕЖДЕНИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«БАШКИРСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

Факультет
Кафедра

Экономический
Экономики и управления

Оценочные материалы по дисциплине (модулю)

дисциплина

Финансовые рынки

Блок Б1, вариативная часть, Б1.В.ДВ.10.01

цикл дисциплины и его часть (базовая, вариативная, дисциплина по выбору)

Направление

38.03.01

код

Экономика

наименование направления

Программа

Финансы и кредит

Форма обучения

Заочная

Для поступивших на обучение в
2020 г.

Разработчик (составитель)

кандидат социологических наук, доцент кафедры экономики и управления
Бикметов Р. Ш.

ученая степень, должность, ФИО

1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования и описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания.....	3
2. Контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы	5
3. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций	9

1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования и описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

Формируемая компетенция (с указанием кода)	Результаты обучения по дисциплине (модулю)	Показатели и критерии оценивания результатов обучения по дисциплине (модулю)				Вид оценочного средства
		неуд.	удовл.	хорошо	отлично	
1	2	3				4
Способностью выполнять необходимые для составления экономических разделов планов расчеты, обосновывать их и представлять результаты работы в соответствии с принятыми в организации стандартами (ПК-3)	1 этап: Знания	Отсутствие минимально-допустимого опыта	Минимально-допустимый уровень опыта	Средний уровень опыта. Способен к саморазвитию	Максимально-возможный уровень опыта. Имеются элементы творчества	Контрольная работа
	2 этап: Умения	Отсутствие минимально-допустимого уровня умений	Минимально-допустимый уровень умений	Средний уровень умений. Способен к саморазвитию.	Максимально-возможный уровень умений. Имеются элементы творчества	Тесты
	3 этап: Владения (навыки / опыт деятельности)	Отсутствие минимально-допустимого уровня знаний	Минимально-допустимый уровень знаний	Средний уровень знаний. Способен к саморазвитию.	Максимально-возможный уровень знаний. Имеются элементы творчества	Устный опрос
Способностью на основе типовых методик и действующей	1 этап: Знания	Отсутствие минимально-	Минимально-допустимый	Средний уровень опыта.	Максимально-возможный	Контрольная работа

нормативно-правовой базы рассчитать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов (ПК-2)		допустимого опыта	уровень опыта	Способен к саморазвитию	уровень опыта. Имеются элементы творчества.	
	2 этап: Умения	Отсутствие минимально- допустимого уровня умений	Минимально- допустимый уровень умений	Средний уровень умений. Способен к саморазвитию	Максимально- возможный уровень умений. Имеются элементы творчества	Тесты
	3 этап: Владения (навыки / опыт деятельности)	Отсутствие минимально- допустимого уровня знаний	Минимально- допустимый уровень знаний	Средний уровень знаний Способен к саморазвитию.	Максимально- возможный уровень знаний Имеются элементы творчества.	Устный опрос

2. Контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы

Перечень вопросов к устному опросу:

Перечень вопросов для оценки уровня сформированности компетенции ПК-2 на этапе «Знания»

- 1) Понятие о финансовых рынках. Сегменты финансовых рынков
- 2) Классификация финансовых инструментов.
- 3) Участники финансовых рынков.
- 4) Государственное регулирование финансовых рынков.
- 5) Характеристика акции как ценной бумаги
- 6) Классификация акции
- 7) Характеристика обыкновенной акции
- 8) Валютная пара.
- 9) Совокупная доходность акции
- 10) Характеристика привилегированных акций
- 11) Общая характеристика и классификация облигаций
- 12) Подготовка соглашения об условиях облигационного займа и процесс подписки
- 13) Доходность облигации
- 14) Определение курсовой цены облигации
- 15) Кредитный рейтинг облигации
- 16) Условия погашения облигации
- 17) Основы вексельного обращения
- 18) Характеристика и виды векселей
- 19) Доходность векселя
- 20) Государственные ценные бумаги. Виды, цели эмиссии, классификация
- 21) Характеристика и функции муниципальных ценных бумаг
- 22) Характеристика и основные виды производных ценных бумаг
- 23) Международный рынок ценных бумаг, его основные секторы
- 24) Евровалюта, евробумаги. Основные понятия рынка евробумаг
- 25) Рынок еврооблигаций
- 26) Россия на рынке еврооблигаций
- 27) Сущность биржевой деятельности. Функции бирж
- 28) Характеристика биржевого товара
- 29) Виды бирж и их характеристика
- 30) Современные тенденции в биржевой деятельности
- 31) Основы деятельности фондовой биржи
- 32) Система управления биржей. ФКЦБ
- 33) Институциональная структура биржи
- 34) Органы управления биржей. Биржевые комитеты и комиссии
- 35) Членство на бирже. Участники биржевого торга
- 36) Сущность процедуры листинга
- 37) Условия и процедура делистинга и приостановления котировок
- 38) Технология заключения сделки на фондовой бирже
- 39) Виды биржевых приказов
- 40) Типы биржевых сделок на фондовой бирже
- 41) Основы брокерской деятельности
- 42) Формы проведения биржевого аукциона и технология биржевых торгов
- 43) Котировка ценных бумаг

- 44) Регистрация, сверка параметров, расчеты, клиринг и исполнение сделки
- 45) Биржевые бюллетени
- 46) Основные мировые фондовые индексы и принципы их расчета
- 47) Деятельность банков на РЦБ: Опыт стран мира и российская практика
- 48) Выпуск банками ценных бумаг
- 49) Внебалансовые операции банков с ценными бумагами
- 50) Операции банков с векселями
- 51) Фьючерсная торговля: история, причины возникновения, и основные функции фьючерсных бирж
- 52) Характеристика фьючерсного контракта
- 53) Понятие позиции и глубины контракта
- 54) Понятие о базисе и базисном риске
- 55) Котировка финансовых фьючерсов
- 56) Участники фьючерсных операций
- 57) Концепция и практика хеджирования

Перечень вопросов для оценки уровня сформированности компетенции **ПК-3** на этапе «Знания»

- 58) Операции спреда на фьючерсных рынках
- 59) Операции с опционами на фьючерсных биржах
- 60) Сущность и функции клиринга.
- 61) Типы систем клиринга.
- 62) Клиринговые палаты и корпорации.
- 63) Инвестиционная среда
- 64) Проблемы этики на финансовых рынках.
- 65) Измерение инвестиционного дохода и риска.
- 66) Сущность портфельного инвестирования.
- 67) Традиционный подход к управлению портфелем.
- 68) Современная теория эффективного портфеля.
- 69) Акция как инвестиционный инструмент
- 70) Концепция фундаментального анализа
- 71) Концепция внутренней стоимости акций
- 72) Модели оценки стоимости акций
- 73) Методы оценки ценных бумаг с фиксированным доходом.
- 74) Анализ устойчивости облигации и изменчивость курса. Иммунизация облигации.
- 75) Инвестиционные облигационные стратегии.
- 76) Инвестиции в акционерные «права».
- 77) Инвестиционные операции с финансовыми фьючерсами.
- 78) Стратегии инвестиций в опционы.
- 79) Использование ПК для управления инвестициями.

Тестовые задания

Тесты для оценки уровня сформированности компетенции **ПК-2 на этапе «Умения»**

Какая компания является “эмитентом”?

- A. Фирма, осуществляющая внешнеторговые операции
- B. Клиринговый центр
- C. Инвестиционная компания
- D. Компания, выпускающая акции

Как называется размещение нового выпуска ценных бумаг путем открытой продажи?

- A. Публичное размещение (IPO)
- B. Частное размещение
- C. Частое размещение
- D. Частичное размещение

Как называется сторона, гарантирующая эмитенту выручку от продажи выпуска ценных бумаг?

- A. Авалист
- B. Андеррайтер
- C. Авераж
- D. Акцептант

При росте цены на облигацию, ее доходность?

- A. Падает
- B. Растет
- C. Показатели не взаимосвязаны
- D. Не меняется

Какая ценная бумага дает право ее владельцу на участие в деятельности компании и на получение дохода в виде части прибыли компании за определенный период?

- A. Облигация
- B. Акция
- C. Вексель
- D. Сберегательный сертификат

Тесты для оценки уровня сформированности компетенции ПК-3 на этапе «Умения»

Какие права имеет владелец обыкновенных акций?

- A. Право управления предприятием, право на получение дивидендов, право на часть предприятия при его ликвидации
- B. Право управления предприятием и право на получение дивидендов
- C. Право управления предприятием и преимущественное право на часть предприятия при его ликвидации
- D. Преимущественное право на получение дивидендов и преимущественное право на часть предприятия при его ликвидации

Кто может принять непосредственное участие в торгах на бирже?

- A. Только физические лица
- B. Только юридические лица профессиональные участники рынка ЦБ
- C. Только члены биржи
- D. Кто угодно

Контрольная работа

Контрольная работа для оценки уровня сформированности компетенции ПК-2 на этапе «Владения»

Вариант 1

1. Роль коммерческих банков на рынке ценных бумаг.
2. Российский рынок ценных бумаг в сравнении с рынками ценных бумаг других стран

3. Роль фондовых бирж в современной экономике.

Вариант 2

1. Особенности корпоративного управления в разных странах.

2. Особенности дивидендной политики в разных странах.

3. Современные тенденции на рынке ценных бумаг.

**Контрольная работа для оценки уровня сформированности компетенции ПК-3
на этапе «Владения»**

Вариант 3

1. Роль инфраструктурных облигаций в современной экономике.

2. Выпуск и обращение ипотечных ценных бумаг.

3. Паевые инвестиционные фонды: понятие, виды и механизмы функционирования

Перечень вопросов к зачету

- 1) Понятие о финансовых рынках. Сегменты финансовых рынков
- 2) Классификация финансовых инструментов.
- 3) Участники финансовых рынков.
- 4) Государственное регулирование финансовых рынков.
- 5) Характеристика акции как ценной бумаги
- 6) Классификация акции
- 7) Характеристика обыкновенной акции
- 8) Валютная пара.
- 9) Совокупная доходность акции
- 10) Характеристика привилегированных акций
- 11) Общая характеристика и классификация облигаций
- 12) Подготовка соглашения об условиях облигационного займа и процесс подписки
- 13) Доходность облигации
- 14) Определение курсовой цены облигации
- 15) Кредитный рейтинг облигации
- 16) Условия погашения облигации
- 17) Основы вексельного обращения
- 18) Характеристика и виды векселей
- 19) Доходность векселя
- 20) Государственные ценные бумаги. Виды, цели эмиссии, классификация
- 21) Характеристика и функции муниципальных ценных бумаг
- 22) Характеристика и основные виды производных ценных бумаг
- 23) Международный рынок ценных бумаг, его основные секторы
- 24) Евровалюта, евробумаги. Основные понятия рынка евробумаг
- 25) Рынок еврооблигаций
- 26) Россия на рынке еврооблигаций
- 27) Сущность биржевой деятельности. Функции бирж
- 28) Характеристика биржевого товара
- 29) Виды бирж и их характеристика
- 30) Современные тенденции в биржевой деятельности
- 31) Основы деятельности фондовой биржи
- 32) Система управления биржей. ФКЦБ
- 33) Институциональная структура биржи
- 34) Органы управления биржей. Биржевые комитеты и комиссии

- 35) Членство на бирже. Участники биржевого торга
- 36) Сущность процедуры листинга
- 37) Условия и процедура делистинга и приостановления котировок
- 38) Технология заключения сделки на фондовой бирже
- 39) Виды биржевых приказов
- 40) Типы биржевых сделок на фондовой бирже
- 41) Основы брокерской деятельности
- 42) Формы проведения биржевого аукциона и технология биржевых торгов
- 43) Котировка ценных бумаг
- 44) Регистрация, сверка параметров, расчеты, клиринг и исполнение сделки
- 45) Биржевые бюллетени
- 46) Основные мировые фондовые индексы и принципы их расчета
- 47) Деятельность банков на РЦБ: Опыт стран мира и российская практика
- 48) Выпуск банками ценных бумаг
- 49) Внебалансовые операции банков с ценными бумагами
- 50) Операции банков с векселями
- 51) Фьючерсная торговля: история, причины возникновения, и основные функции фьючерсных бирж
- 52) Характеристика фьючерсного контракта
- 53) Понятие позиции и глубины контракта
- 54) Понятие о базисе и базисном риске
- 55) Котировка финансовых фьючерсов
- 56) Участники фьючерсных операций
- 57) Концепция и практика хеджирования
- 58) Операции спреда на фьючерсных рынках
- 59) Операции с опционами на фьючерсных биржах
- 60) Сущность и функции клиринга.
- 61) Типы систем клиринга.
- 62) Клиринговые палаты и корпорации.
- 63) Инвестиционная среда
- 64) Проблемы этики на финансовых рынках.
- 65) Измерение инвестиционного дохода и риска.
- 66) Сущность портфельного инвестирования.
- 67) Традиционный подход к управлению портфелем.
- 68) Современная теория эффективного портфеля.
- 69) Акция как инвестиционный инструмент
- 70) Концепция фундаментального анализа
- 71) Концепция внутренней стоимости акций
- 72) Модели оценки стоимости акций
- 73) Методы оценки ценных бумаг с фиксированным доходом.
- 74) Анализ устойчивости облигации и изменчивость курса. Иммунизация облигации.
- 75) Инвестиционные облигационные стратегии.
- 76) Инвестиции в акционерные «права».

3. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций

Рейтинг план дисциплины

Виды учебной деятельности	Балл за конкретное	Число	Баллы
---------------------------	--------------------	-------	-------

студентов	задание	заданий	Минимальный	Максимальный
Раздел 1.				
Текущий контроль			0	25
1) Устный опрос	1	10	0	10
2) Тестирование	1	10	0	10
3) СРС (реферат)	5	1	0	5
Рубежный контроль			0	25
4) Контрольная работа	5	5	0	25
Раздел 2.				
Текущий контроль			0	25
1) Устный опрос	1	10	0	10
2) Тестирование	1	10	0	10
3) СРС (реферат)	5	1	0	5
Рубежный контроль			0	25
4) Контрольная работа	5	5	0	25
		Итого:	0	100
Поощрительные баллы			0	10
Участие в конференции			0	5
Публикация статей			0	5
Посещаемость (баллы вычитаются из общей суммы набранных баллов)				
1.Посещение лекционных занятий			0	-6
2.Посещение практических занятий			0	-10

Результаты обучения по дисциплине (модулю) у обучающихся оцениваются по итогам текущего контроля количественной оценкой, выраженной в рейтинговых баллах. Оценке подлежит каждое контрольное мероприятие.

При оценивании сформированности компетенций применяется четырехуровневая шкала «неудовлетворительно», «удовлетворительно», «хорошо», «отлично».

Максимальный балл по каждому виду оценочного средства определяется в рейтинг-плане и выражает полное (100%) освоение компетенции.

Уровень сформированности компетенции «хорошо» устанавливается в случае, когда объем выполненных заданий соответствующего оценочного средства составляет 80-100%; «удовлетворительно» – выполнено 40-80%; «неудовлетворительно» – выполнено 0-40%

Рейтинговый балл за выполнение части или полного объема заданий соответствующего оценочного средства выставляется по формуле:

$$\text{Рейтинговый балл} = k \times \text{Максимальный балл},$$

где $k = 0,2$ при уровне освоения «неудовлетворительно», $k = 0,4$ при уровне освоения «удовлетворительно», $k = 0,8$ при уровне освоения «хорошо» и $k = 1$ при уровне освоения «отлично».

Оценка на этапе промежуточной аттестации выставляется согласно Положению о модульно-рейтинговой системе обучения и оценки успеваемости студентов БашГУ:

На зачете выставляется оценка:

- зачтено - при накоплении от 60 до 110 рейтинговых баллов (включая 10 поощрительных баллов),
- не зачтено - при накоплении от 0 до 59 рейтинговых баллов.

При получении на экзамене оценок «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», на зачёте оценки «зачтено» считается, что результаты обучения по дисциплине (модулю) достигнуты и компетенции на этапе изучения дисциплины (модуля) сформированы.