



Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Иркутский государственный университет»
(ФГБОУ ВО «ИГУ»)
Международный институт экономики и лингвистики
Кафедра экономики и торговой политики

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ
по дисциплине
ФТД.01 «РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ»

Направление подготовки – 38.04.01 «Экономика»
Направленность – «Экономика и организация производства продукции и услуг»

Иркутск, 2024

Одобен УМК Международного института
экономики и лингвистики
Иркутского государственного
университета

Разработан в соответствии с ФГОС ВО
по направлению подготовки 38.04.01 «Экономика» (уровень магистратуры), утвержденный приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от «11» августа 2020 г. № 939

с учетом требований профессионального стандарта 08.043 «Экономист предприятия», утвержденного приказом Министерства труда и социальной защиты Российской Федерации от 30 марта 2021 г. N 161н (зарегистрирован Министерством юстиции Российской Федерации 29 апреля 2021г., регистрационный N 63289)

Председатель УМК  Е. В. Крайнова

Разработчик  Д. В. Мирошников

ПАСПОРТ ФОНДА ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

по учебной дисциплине ФТД.01 «Рынок ценных бумаг»

направление подготовки 38.04.01 «Экономика»

направленность подготовки – «Экономика и организация производства продукции и услуг»

1. Компетенции (индикаторы компетенций), формируемые в процессе изучения дисциплины (1 курс, 1 семестр):

Индекс компетенции	Содержание компетенции	Индекс и содержание индикатора компетенций	Результаты обучения
<i>ПК-3</i>	Способен осуществлять руководство бизнес-анализом	<i>ИДК_{ПК3.1}</i> Разрабатывает требования к ресурсному обеспечению бизнес-анализа	Знает: методы сбора и обработки исходных данных для бизнес-анализа, положения экономической науки о финансовых рынках, о видах и типах ценных бумаг, проблемы современной экономической жизни, особенности экономического взаимодействия субъектов, проблемы регулирования и планирования рынка ценных бумаг и уметь использовать эти знания бизнес-анализе. Умеет: использовать знания в современной практике экономической деятельности, детально разбираться в современных проблемах экономического развития РФ; свободно ориентироваться в специальной литературе по экономическим проблемам; самостоятельно решать задачи, используемые в бизнес-анализе; оформлять результаты бизнес-анализа в соответствии с выбранными подходами. Владеет: теорией и практикой сбора и обработки исходных данных для бизнес-анализа, методологией обоснования подходов, используемых в бизнес-анализе; методологической базой для проведения исследования экономических процессов; навыками публичной и научной речи.

2. Текущий контроль

2.1. Программа оценивания контролируемой компетенции ПК 3

Тема или раздел дисциплины	Код индикатора компетенции	Планируемый результат	Показатель	Критерий оценивания	Наименование ОС	
					ТК	ПА
Раздел 1. Понятие, типы и виды ценных бумаг	<i>ИДК_{ПК3.1}</i>	<p>Знает: Сущность фондового рынка. Структуру фондового рынка. Субъекты и объекты рынка ценных бумаг. Понятие и основные свойства различных видов ценных бумаг.</p> <p>Умеет: определять направления финансовых потоков в экономике, проводить классификацию ценных бумаг. Проводить оценку стоимости и доходности различных видов ценных бумаг.</p> <p>Владеет: методикой проведения анализа фондовых рынков, навыками решения задач по темам данного раздела.</p>	Знание Рынка ценных бумаг как составной части финансового рынка. Структуры рынка ценных бумаг. Сущности ценных бумаг как альтернативных источников финансирования экономики и их классификации. Основных субъектов рынка ценных бумаг. Принципов регулирования рынка ценных бумаг.	Развернутый ответ студента должен представлять собой связное, логически последовательное сообщение на заданную тему. При оценке ответа студента нужно руководствоваться следующими критериями: 1) полнота и правильность ответа; 2) степень осознанности, понимания изученного материала..	Собеседование, тесты	
Раздел 2. Деятельность на рынке ценных бумаг	<i>ИДК_{ПК3.1}</i>	<p>Знает: основные понятия фундаментального и технического анализа рынка ценных бумаг. Факторы, определяющие доходность операций с ценными бумагами. Методы исчис-</p>	Знание Основных видов деятельности на рынке ценных бумаг. Проблем рынка государственных ценных бумаг в России и за рубежом. Взаимосвязи динамики цен и доходности	Развернутый ответ студента должен представлять собой связное, логически последовательное сообщение на заданную тему. При оценке ответа студента нужно руководствоваться	Собеседование, тесты	

		<p>ления доходности. Умеет: Определять доходность ценных бумаг на основе простых и сложных процентов. Вычислять доходность портфеля ценных бумаг. Анализировать социально-экономическое состояние и процессы с применением методов системного анализа и финансово-экономического моделирования рынка ценных бумаг.</p> <p>Владеет: Методами формирования портфеля ценных бумаг, навыками решения финансово-экономических задач для оценки состояния и прогноза развития социальных и экономических явлений и процессов рынка ценных бумаг.</p>	ценных бумаг с доходностью финансовых инструментов в других секторах финансового рынка.	следующими критериями: 1) полнота и правильность ответа; 2) степень осознанности, понимания изученного материала.		
Раздел 3. Субъекты фондового рынка	<i>ИДК_{ПК3.1}</i>	<p>Знает: Основных профессиональных участников фондового рынка. Порядок организации и функционирования брокеров и дилеров на фондовом рынке. Деятель-</p>	Знание основных принципов функционирования фондовой биржи как организатора торговли на рынке ценных бумаг. Эмиссии ценных бумаг, ее задач и проце-	Развернутый ответ студента должен представлять собой связное, логически последовательное сообщение на заданную тему. При оценке ответа студента нужно руко-	Собеседование, тесты	

		<p>ность по доверительному управлению ценными бумагами. Клиринговую деятельность, депозитарная деятельность. Основные принципы деятельности паевых инвестиционных фондов и инвестиционных компаний. Роль и значение коммерческих банков на рынке ценных бумаг. Историю создания и виды фондовых бирж. Регулирование рынка ценных бумаг. Понятие и основные цели государственного регулирования рынка ценных бумаг. Основные функции Федеральной службы по финансовым рынкам.</p> <p>Умеет: Работать с научной литературой и другими источниками научно - экономической информации: правильно понимать смысл текстов, описывающих финансовые методы и модели в профессиональной сфере на рынке ценных бумаг, осуществлять</p>	<p>дуры осуществления. Принципов и порядка формирования портфеля ценных бумаг. Принципов и порядка ценообразования на рынке ценных бумаг. Методов определения инвестиционного риска на рынке ценных бумаг. Роли чековых Инвестиционных фондов в приватизации государственной собственности. Современного состояния российского фондового рынка.</p>	<p>водствоваться следующими критериями: 1) полнота и правильность ответа; 2) степень осознанности, понимания изученного материала.</p>		
--	--	---	---	--	--	--

		<p>активные, пассивные операции с ценными бумагами.</p> <p>Владеет:</p> <p>Навыками работы с финансово - аналитической информацией в рамках осуществления своей профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, может осуществлять активные, пассивные операции с ценными бумагами. Методами организации деятельности на фондовой бирже. Методами организации биржевой торговли. Простой аукцион.</p>				
--	--	---	--	--	--	--

* Оценочным средством для промежуточной аттестации являются вопросы к зачету.

2.2. Характеристика оценочных материалов для обеспечения текущего контроля по дисциплине

Код индикатора компетенции	Планируемый результат	ОС	Содержание задания/вопроса и т.д.
<i>ИДК_{ПК3.1}</i>	Знает: методы сбора и обработки исходных данных для бизнес-анализа, положения экономической науки о финансовых рынках, о видах и типах ценных бумаг, проблемы современной экономической жизни, особенности экономического взаимодействия субъектов, проблемы регулирования и планирования рынка ценных бумаг и уметь использовать эти знания бизнес-анализе.	Собеседование, тестирование	Вопросы для практических занятий и тестовые задания представлены в РПД ФТД.01 «Рынок ценных бумаг»
<i>ИДК_{ПК3.1}</i>	Умеет: использовать знания в современной практике экономической деятельности, детально разби-	Собеседование, тестирование	Вопросы для практических занятий и тестовые задания представлены в РПД

	ратся в современных проблемах экономического развития РФ; свободно ориентироваться в специальной литературе по экономическим проблемам; самостоятельно решать задачи, используемые в бизнес-анализе; оформлять результаты бизнес-анализа в соответствии с выбранными подходами.		ФТД.01 «Рынок ценных бумаг»
<i>ИДК_{ПКЗ.1}</i>	Владеет: теорией и практикой сбора и обработки исходных данных для бизнес-анализа, методологией обоснования подходов, используемых в бизнес-анализе; методологической базой для проведения исследования экономических процессов; навыками публичной и научной речи.	Собеседование, тестирование	Вопросы для практических занятий и тестовые задания представлены в РПД ФТД.01 «Рынок ценных бумаг»

Оценочные средства для текущего контроля (пример)

Тема №1. Мировое хозяйство и международные экономические отношения

Вопросы и задания

Перечислите нормативные акты, регулирующие деятельность на рынке ценных бумаг.

Классифицируйте рынок ценных бумаг и представьте ответ в виде таблицы.

Перечислите задачи рынка ценных бумаг.

Охарактеризуйте функции рынка ценных бумаг, ответ представьте в виде схемы.

Поясните, как рассчитывается теоретическая цена облигации.

Поясните, как рассчитывается текущая доходность процентных облигаций.

Поясните, как рассчитывается курсовая стоимость облигации.

Поясните, как рассчитывается рыночная стоимость акции при постоянстве дивидендных выплат.

Поясните, как рассчитывается рыночная стоимость дисконтной облигации.

Дайте определение понятиям: акцепт на переводном векселе, аваль, аллонж, индоссамент.

Дайте определение понятиям: бенефициар, цессия, цедент, цессионарий.

Поясните порядок организации и функционирования АО, охарактеризуйте виды акционерных обществ.

Сформулируйте алгоритм уплаты дивидендов в акционерном обществе.

Поясните, как рассчитывается рыночная стоимость акции при постоянстве дивидендных выплат.

Пример тестового задания

1. Место, где происходит эмиссия и размещение ценных бумаг, - это:

- А) первичный рынок;
- Б) вторичный рынок;
- В) третичный рынок.

2. Рынок с немедленным исполнением сделок в течении 1-2 рабочих дней называется:

- А) срочный рынок;
- Б) кассовый рынок;

В) организованный рынок.

3. Сфера обращения ценных бумаг, не допущенных к котировке на фондовых биржах, называется:

- А) биржевой рынок;
- Б) внебиржевой рынок;
- В) неорганизованный рынок.

4. Что относится к субъектам рынка ценных бумаг?

- А) акция;
- Б) брокер;
- В) облигация.

5. Инфраструктура рынка ценных бумаг не включает в себя:

- А) депозитарии;
- Б) реестродержатели;
- В) ФСФР;
- Г) оценочные агентства;
- Д) брокерские конторы.

6. Кто может осуществлять эмиссию акций?

- А) общества с ограниченной ответственностью;
- Б) закрытые акционерные общества;
- В) паевые инвестиционные фонды.

7. Эмиссионная стоимость акции может быть:

- А) ниже номинальной стоимости;
- Б) равна номинальной стоимости;
- В) выше или равна номинальной стоимости.

8. В какой форме владельцы акций получают доход?

- А) заработной платы;
- Б) прибыли;
- В) дивидендов.

9. При росте доходов и прибыли акционерного общества в первую очередь поднимается рыночная стоимость:

- А) обыкновенных акций;
- Б) привилегированных акций;
- В) облигаций.

10. Имеет ли право акционер требовать информации о количестве акций у других акционеров данного АО?

- А) имеет;
- Б) не имеет;
- В) имеет, если владеет более чем 1% голосующих акций.

Критерии оценки ответов в ходе устного опроса

- уровень освоения учебного материала;
- обоснованность и четкость изложения материала;
- уровень умения ориентироваться в потоке информации, выделять главное.

«отлично» студент получает, если:

- обстоятельно с достаточной полнотой излагает соответствующую тему;
- дает правильные формулировки, точные определения, понятия терминов;
- правильно отвечает на дополнительные вопросы преподавателя, имеющие целью выяснить степень понимания студентом данного материала.

«хорошо» студент получает, если:

- неполно, но правильно изложено задание;
- при изложении были допущены 1-2 несущественные ошибки, которые он исправляет после замечания преподавателя;
- дает правильные формулировки, точные определения, понятия терминов;
- может обосновать свой ответ, привести необходимые примеры;
- правильно отвечает на дополнительные вопросы преподавателя, имеющие целью выяснить степень понимания студентом данного материала.

«удовлетворительно» студент получает, если:

- неполно, но правильно изложено задание;
- при изложении допущена 1 существенная ошибка;
- знает и понимает основные положения данной темы, но допускает неточности в формулировке понятий;
- излагает выполнение задания недостаточно логично и последовательно;
- затрудняется при ответах на вопросы преподавателя.

«неудовлетворительно» студент получает, если:

- неполно изложено задание;
- при изложении были допущены существенные ошибки.

Критерии оценки результатов выполнения тестовых заданий

Основным критерием оценки результатов выполнения тестовых заданий является коэффициент усвоения учебного материала, который определяется как отношение правильных ответов к общему количеству заданий.

Неудовлетворительно	Удовлетворительно	Хорошо	Отлично
От 40 до 0 баллов. Необходима значительная дальнейшая работа для успешного прохождения теста.	От 60 до 40 баллов. Выполнение теста удовлетворяет минимальным критериям.	От 80 до 60 баллов. В целом правильная работа с определённым количеством ошибок.	От 100 до 80 баллов. Отличное выполнение теста с незначительным количеством ошибок.

3. Промежуточная аттестация

По дисциплине «Рынок ценных бумаг» формой промежуточной аттестации является зачет.

3.1. Оценка запланированных результатов по дисциплине

Код компетенции	Код оцениваемого индикатора	Результаты обучения	Показатели
ПК-3	<i>ИДК_{ПК3.1}</i>	Знает: методы сбора и обработки исходных данных для бизнес-анализа, по-	Дает правильное определение основных понятий и дефиниций. Свободно ориентируется в специальной литературе по экономиче-

		<p>ложения экономической науки о финансовых рынках, о видах и типах ценных бумаг, проблемы современной экономической жизни, особенности экономического взаимодействия субъектов, проблемы регулирования и планирования рынка ценных бумаг и уметь использовать эти знания бизнес-анализе.</p> <p>Умеет: использовать знания в современной практике экономической деятельности, детально разбираться в современных проблемах экономического развития РФ; свободно ориентироваться в специальной литературе по экономическим проблемам; самостоятельно решать задачи, используемые в бизнес-анализе; оформлять результаты бизнес-анализа в соответствии с выбранными подходами.</p> <p>Владеет: теорией и практикой сбора и обработки исходных данных для бизнес-анализа, методологией обоснования подходов, используемых в бизнес-анализе; методологической базой для проведения исследования экономических процессов; навыками публичной и научной речи.</p>	<p>ским проблемам.</p> <p>Способен самостоятельно решать задачи, по данной научной дисциплине.</p> <p>Аргументирует теоретические положения дисциплины и сопоставляет их с практикой функционирования рынка ценных бумаг.</p> <p>Формулирует и объясняет основные тенденции развития рынка ценных бумаг.</p>
--	--	--	--

3.2. Показатели и критерии оценивания сформированности компетенции (индикатора) на этапе освоения дисциплины «Методология экономической науки»

Коды компетенций	Показатели и критерии оценки достижения освоения компетенции				Оценочное средство
	Неудовлетворительно	Удовлетворительно	Хорошо	Отлично	
ПК-3	Знать				Вопросы к зачету
	Студент допускает значительные ошибки и обнаруживает лишь начальную степень ориентации в материале.	Уровень студента недостаточно высок. Допускаются ошибки и затруднения при изложении материала.	Студент относительно полно ориентируется в материале и отвечает без затруднений при контроле знаний. Допускает незначительное количество ошибок. Способен к выполнению сложных заданий.	Студент свободно ориентируется в материале и отвечает без затруднений. Способен к выполнению сложных заданий, постановке целей и выборе путей их реализации.	
	Уметь				Тест
От 40 до 0 баллов. Необходима значительная дальнейшая работа для успешного прохождения теста.	От 60 до 40 баллов. Выполнение теста удовлетворяет минимальным критериям.	От 80 до 60 баллов. В целом правильная работа с определённым количеством ошибок.	От 100 до 80 баллов. Отличное выполнение теста с незначительным количеством ошибок.		
Владеть				Тест с открытыми вопросами	
Правильные ответы даны на менее 1/2 вопросов, выполнены менее 1/2 заданий. Ответы краткие, неразвернутые, «случайные».	Правильные ответы даны на 2/3 вопросов, выполнены 2/3 заданий. Большинство (2/3) ответов краткие, неразвернутые.	Правильные ответы даны на все вопросы, выполнены все задания. Полнота и логичность изложения ответов достаточная в 2/3 ответах.	Правильные ответы даны на все вопросы, выполнены все задания. Полнота и логичность изложения ответов достаточно высокая во всех ответах.		

3.3 Оценочные материалы (средства), обеспечивающие диагностику сформированности компетенций (или индикаторов компетенций), заявленных в рабочей программе дисциплины «Рынок ценных бумаг»

Примерный список вопросов к зачету

1. История создания и развития рынка ценных бумаг.
2. Определение рынка ценных бумаг. Его роль и функции в экономике.
3. Нормативная база на РЦБ.
4. Налогообложение на РЦБ.

5. Определение и основные характеристики ценных бумаг.
6. Основные виды и типы ценных бумаг.
7. Сходство и различие ценных бумаг и денег.
8. Понятие и основные свойства акции.
9. Обыкновенные и привилегированные акции.
10. Оценка и доходность акции. Курс акции.
11. Понятие и основные черты облигаций.
12. Оценка и доходность облигации. Курс облигаций.
13. Виды корпоративных облигаций.
14. Понятие векселя. Виды и типы векселей.
15. Простой вексель.
16. Переводной вексель.
17. Обращение векселей.
18. Учет векселей.
19. Фьючерс.
20. Опцион.
21. Депозитные расписки.
22. Чеки.
23. Складские свидетельства.
24. Варрант.
25. Коносамент.
26. Страховой полис.
27. Биржевой и внебиржевой рынки.
28. Фондовые биржи и их функции.
29. Организация биржи.
30. Организация торгов на фондовой бирже.
31. Эмитенты и инвесторы на РЦБ.
32. Саморегулируемые организации на РЦБ.
33. Профессиональные участники на РЦБ.
34. Аттестация участников на РЦБ.
35. Брокерская и дилерская деятельность на РЦБ.
36. Депозитарная деятельность и деятельность по ведению реестров РЦБ.
37. Инвестиционные фонды и их деятельность на РЦБ.
38. Основные этапы развития рынка государственных ценных бумаг России.
39. Основные риски на РЦБ.
40. Цены и ценообразование на РЦБ.
41. Понятие фундаментального анализа фондового рынка.
42. Понятие технического анализа фондового рынка.
43. Компьютерный анализ фондового рынка.
44. Формирование и управление портфелем ценных бумаг.
45. Оптимизация и диверсификация портфеля ценных бумаг.
46. Методы исчисления доходности рынка ценных бумаг.
47. Государственное регулирование рынка ценных бумаг.
48. Федеральная служба по финансовым рынкам и ее основные функции.
49. Методы исчисления доходности фондового рынка.
50. Коммерческие банки на фондовом рынке. Роль и функции.