

МИНИСТЕРСТВО СЕЛЬСКОГО ХОЗЯЙСТВА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ  
федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
**«Санкт-Петербургский государственный аграрный университет»**  
**Калининградский филиал**

Кафедра анализа, бухгалтерского учета и статистический отчетности



Утверждаю  
Зам. директора по учебной работе  
С.А. Носкова  
29 мая 2020 г.

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ**  
ПО ДИСЦИПЛИНЕ  
**«ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ»**  
(приложение к рабочей программе)

Направление подготовки бакалавра  
38.03.01 Экономика

Тип образовательной программы  
Прикладной бакалавриат

Направленность (профиль) образовательной программы  
Экономика и управление в АПК

Автор

доцент



(подпись)

Носкова С.А.

## СОДЕРЖАНИЕ

1	Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы	4
2	Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания	5
3	Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы	8
4	Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций	12

## 1 Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

Процесс изучения дисциплины «Финансовые рынки» направлен на формирование следующих компетенций, отраженных в карте компетенций:

Код компетенции	Наименование компетенции	Структурные элементы компетенции (знать, уметь, владеть)	Этапы формирования компетенции в процессе освоения образовательной программы	Виды занятий для формирования компетенции	Оценочные средства для проверки формирования компетенции
ОПК-2	способность осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач	<p>знать: нормативно-правовую базовую экономических показателей в сфере финансовых рынков;</p> <p>уметь: анализировать абсолютные и относительные показатели, характеризующие ситуацию на финансовых рынках;</p> <p>владеть: способностью применять методы и методики для анализа и оценки абсолютных и относительных показатели, характеризующих ситуацию на финансовых рынках.</p>	7, 8 семестр (ОФО, ЗФО)	Учебные занятия в соответствии с учебным планом проводятся в форме контактной работы, включающей занятия лекционного типа (лекции), занятия семинарского типа (практические занятия), групповые консультации, и в форме самостоятельной работы обучающихся	Тестирование, реферат, кейс-задание, контрольная работа
ПК-2	Способность на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов	<p>знать: типовые методики при расчете экономических и социально-экономических показателей; нормативно-правовую базовую экономических показателей;</p> <p>уметь: анализировать социально-экономические показатели, используя нормативно-правовую базу; делать выводы и обосновывать полученные конечные результаты;</p> <p>владеть: способностью применять методы и методики для анализа и оценки экономических и социально-экономических показателей; навыками использования аналитических приемов и методов в управлении организацией</p>	7, 8 семестр (ОФО, ЗФО)	Учебные занятия в соответствии с учебным планом проводятся в форме контактной работы, включающей занятия лекционного типа (лекции), занятия семинарского типа (практические занятия), групповые консультации, и в форме самостоятельной работы обучающихся	Тестирование, реферат, кейс-задание, контрольная работа
ПК-11	Способность критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рис-	<p>знать: показатели и критерии социально-экономической эффективности деятельности организации; виды рисков в хозяйственной деятельности организации и систему риск-менеджмента;</p> <p>уметь: анализировать варианты управленческих решений и определять их эффективность; брать за себя ответственность за реализацию управленческого решения и возможные его социально-экономические последствия;</p> <p>владеть: навыками организационно-руководящей</p>	7, 8 семестр (ОФО, ЗФО)	Учебные занятия в соответствии с учебным планом проводятся в форме контактной работы, включающей занятия лекционного типа (лекции), занятия семинарского типа (практические занятия), групповые консультации, и в	Тестирование, реферат, кейс-задание, контрольная работа

	ков и возможных социально-экономических последствий	работы группы работников, всего коллектива; способностью к критическому анализу планируемых управленческих решений и реальной оценке их последствий; умением организовать процесс разработки, обоснования и реализации управленческих решений		форме самостоятельной работы обучающихся	
--	-----------------------------------------------------	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	------------------------------------------	--

## 2 Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

### 2.1 Показатели и критерии оценивания компетенций

Компетенция	Этап формирования компетенции	Показатели и критерии оценивания				Оценочные средства для проверки формирования компетенции	
		отсутствие усвоения (ниже порогового)	неполное усвоение (пороговое)	хорошее усвоение (углубленное)	отличное усвоение (продвинутое)	Текущий контроль	Промежуточная аттестация
<i>ОПК-2 способность осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач</i>							
знать	7, 8 семестр (ОФО, ЗФО)	Отсутствие знания нормативно-правовой базы экономических показателей в сфере финансовых рынков.	Наличие существенных пробелов в знании нормативно-правовой базы экономических показателей в сфере финансовых рынков.	Знание с небольшими пробелами нормативно-правовой базы экономических показателей в сфере финансовых рынков.	Глубокое и безупречное знание нормативно-правовой базы экономических показателей в сфере финансовых рынков.	Тестирование, реферат, кейс-задание, контрольная работа	Зачет
уметь	7, 8 семестр (ОФО, ЗФО)	Отсутствие умения анализировать абсолютные и относительные показатели, характеризующие ситуацию на финансовых рынках.	Неполное умение либо умение со значительными ошибками анализировать абсолютные и относительные показатели, характеризующие ситуацию на финансовых рынках.	Хорошее (допускающее совершение незначительных ошибок и неточностей) умение анализировать абсолютные и относительные показатели, характеризующие ситуацию на финансовых рынках.	Отличное (без ошибок) умение анализировать абсолютные и относительные показатели, характеризующие ситуацию на финансовых рынках.	Тестирование, реферат, кейс-задание, контрольная работа	Зачет
владеть	7, 8 семестр (ОФО, ЗФО)	Отсутствие владения способностью применять методы и методики для анализа и оценки абсолютных и относительных показатели, характеризующих ситуацию на финансовых рынках.	Неуверенное владение способностью применять методы и методики для анализа и оценки абсолютных и относительных показателей, характеризующих ситуацию на финансовых рынках.	Владение способностью применять методы и методики для анализа и оценки абсолютных и относительных показателей, характеризующих ситуацию на финансовых рынках при наличии незначительных ошибок.	Свободное владение способностью применять методы и методики для анализа и оценки абсолютных и относительных показателей, характеризующих ситуацию на финансовых рынках.	Тестирование, реферат, кейс-задание, контрольная работа	Зачет
<i>ПК-2 – способность на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов</i>							

знать	7, 8 семестр (ОФО, ЗФО)	Не знает: типовые методики при расчете экономических и социально-экономических показателей; нормативно-правовую базовую экономических показателей	В основном знает: типовые методики при расчете экономических и социально-экономических показателей; нормативно-правовую базовую экономических показателей	Хорошо знает: типовые методики при расчете экономических и социально-экономических показателей; нормативно-правовую базовую экономических показателей	Отлично знает: типовые методики при расчете экономических и социально-экономических показателей; нормативно-правовую базовую экономических показателей	Тестирование, реферат, кейс-задание, контрольная работа	Зачет
уметь	7, 8 семестр (ОФО, ЗФО)	Не умеет: анализировать социально-экономические показатели, используя нормативно-правовую базу; делать выводы и обосновывать полученные конечные результаты	Частично умеет: анализировать социально-экономические показатели, используя нормативно-правовую базу; делать выводы и обосновывать полученные конечные результаты	Хорошо умеет: анализировать социально-экономические показатели, используя нормативно-правовую базу; делать выводы и обосновывать полученные конечные результаты	Отлично умеет: анализировать социально-экономические показатели, используя нормативно-правовую базу; делать выводы и обосновывать полученные конечные результаты	Тестирование, реферат, кейс-задание, контрольная работа	Зачет
владеть	7, 8 семестр (ОФО, ЗФО)	Не владеет: способностью применять методы и методики для анализа и оценки экономических и социально-экономических показателей; навыками использования аналитических приемов и методов в управлении организацией	Частично владеет: способностью применять методы и методики для анализа и оценки экономических и социально-экономических показателей; навыками использования аналитических приемов и методов в управлении организацией	Хорошо владеет: способностью применять методы и методики для анализа и оценки экономических и социально-экономических показателей; навыками использования аналитических приемов и методов в управлении организацией	Отлично владеет: способностью применять методы и методики для анализа и оценки экономических и социально-экономических показателей; навыками использования аналитических приемов и методов в управлении организацией	Тестирование, реферат, кейс-задание, контрольная работа	Зачет
<i>ПК-11 – способность критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий</i>							
знать	7, 8 семестр (ОФО, ЗФО)	Не знает: показатели и критерии социально-экономической эффективности деятельности организации; виды рисков в хозяйственной деятельности организации и систему риск-менеджмента	В основном знает: показатели и критерии социально-экономической эффективности деятельности организации; виды рисков в хозяйственной деятельности организации и систему риск-менеджмента	Хорошо знает: показатели и критерии социально-экономической эффективности деятельности организации; виды рисков в хозяйственной деятельности организации и систему риск-менеджмента	Отлично знает: показатели и критерии социально-экономической эффективности деятельности организации; виды рисков в хозяйственной деятельности организации и систему риск-менеджмента	Тестирование, реферат, кейс-задание, контрольная работа	Зачет

уметь	7, 8 семестр (ОФО, ЗФО)	Не умеет: анализировать варианты управленческих решений и определять их эффективность; брать за на себя ответственность за реализацию управленческого решения и возможные его социально-экономические последствия	Частично умеет: анализировать варианты управленческих решений и определять их эффективность; брать за на себя ответственность за реализацию управленческого решения и возможные его социально-экономические последствия	Хорошо умеет: анализировать варианты управленческих решений и определять их эффективность; брать за на себя ответственность за реализацию управленческого решения и возможные его социально-экономические последствия	Отлично умеет: анализировать варианты управленческих решений и определять их эффективность; брать за на себя ответственность за реализацию управленческого решения и возможные его социально-экономические последствия	Тестирование, реферат, кейс-задание, контрольная работа	Зачет
владеть	7, 8 семестр (ОФО, ЗФО)	Не владеет: навыками организационно-руководящей работы группы работников, всего коллектива; способностью к критическому анализу планируемых управленческих решений и реальной оценке их последствий; умением организовать процесс разработки, обоснования и реализации управленческих решений	Частично владеет: навыками организационно-руководящей работы группы работников, всего коллектива; способностью к критическому анализу планируемых управленческих решений и реальной оценке их последствий; умением организовать процесс разработки, обоснования и реализации управленческих решений	Хорошо владеет: навыками организационно-руководящей работы группы работников, всего коллектива; способностью к критическому анализу планируемых управленческих решений и реальной оценке их последствий; умением организовать процесс разработки, обоснования и реализации управленческих решений	Отлично владеет: навыками организационно-руководящей работы группы работников, всего коллектива; способностью к критическому анализу планируемых управленческих решений и реальной оценке их последствий; умением организовать процесс разработки, обоснования и реализации управленческих решений	Тестирование, реферат, кейс-задание, контрольная работа	Зачет

## 2.2 Шкала оценивания компетенций

Оценочное средство *тест*:

Шкала оценивания:

Выполнение заданий 1-6 оценивается в 6 оценочный балл (1 балл за каждый правильный ответ), выполнение заданий 7, 8 – в 6 оценочных баллов (3 балла за правильный ответ на вопрос).

- оценка «отлично» (при отличном усвоении (продвинутом)) выставляется обучающемуся, набравшему не менее десяти оценочных баллов;
- оценка «хорошо» (при хорошем усвоении (углубленном)) выставляется обучающемуся, набравшему не менее восьми оценочных баллов;
- оценка «удовлетворительно» (при неполном усвоении (пороговом)) выставляется обучающемуся, набравшему не менее шести оценочных баллов;
- оценка «неудовлетворительно» (при отсутствии усвоения (ниже порогового)) выставляется обучающемуся, набравшему менее шести оценочных баллов;

Оценочное средство *реферат*:

Выполнение задания оценивается исходя из критериев:

- актуальности, корректности и соответствия, представленных данных заявленной теме;
- корректного оформления, грамотного структурирования и представления сделанных выводов в форме, указанной преподавателем (реферат, устный доклад, презентация).

Шкала оценивания:

- оценка «отлично» (при отличном усвоении (продвинутом)) выставляется обучающемуся, чья работа отвечает обоим критериям;
- оценка «хорошо» (при хорошем усвоении (углубленном)) выставляется обучающемуся, чья работа полностью отвечает первому критерию, в основном отвечает второму критерию;
- оценка «удовлетворительно» (при неполном усвоении (пороговом)) выставляется обучающемуся, чья работа в основном отвечает первому критерию, частично отвечает второму;
- оценка «неудовлетворительно» (при отсутствии усвоения (ниже порогового)) выставляется обучающемуся, чья работа не отвечает первому критерию.

Оценочное средство *кейс-задание*:

- оценка «зачтено» (при неполном (пороговом), хорошем (углублённом) или отличном (продвинутом) усвоении) выставляется обучающемуся, если им были полностью выполнены задания, получены верные результаты; полностью или частично выполнены задания, отдельные результаты неверны; частично выполнены задания, полученные результаты верны.
- оценка «не зачтено» (при отсутствии усвоения (ниже порогового)) выставляется обучающемуся, если им не выполнены или частично выполнены поставленные задания, получены неверные результаты.

Оценочное средство *контрольная работа*:

Шкала оценивания:

Выполнение задания 1 оценивается в 8 оценочных баллов (до 2-х баллов за каждый правильный ответ), выполнение задания 2 – в 12 оценочных баллов (до 3-х баллов за каждый правильный ответ), выполнение задания 3 – в 8 оценочных баллов (до 4-х баллов за выполненное задание).

- оценка «отлично» (при отличном усвоении (продвинутом)) выставляется обучающемуся, набравшему не менее 22 оценочных баллов;
- оценка «хорошо» (при хорошем усвоении (углубленном)) выставляется обучающемуся, набравшему не менее 17 оценочных баллов;
- оценка «удовлетворительно» (при неполном усвоении (пороговом)) выставляется обучающемуся, набравшему не менее 11 оценочных баллов;
- оценка «неудовлетворительно» (при отсутствии усвоения (ниже порогового)) выставляется обучающемуся, набравшему менее 11 оценочных баллов.



**3 Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы**

**Тестовые задания**

**Тест 1**

1. Рыночный товар, отличительная особенность которого – его высокая ликвидность называется:
  - а) финансовый актив;
  - б) финансовый инструмент;
  - в) финансовое обязательство;
  - г) финансовый рынок.
2. Финансовые ресурсы, обращение которых предполагает условия срочности, платности и возвратности являются объектом:
  - а) рынка ценных бумаг;
  - б) рынка инвестиций;
  - в) кредитного рынка;
  - г) страхового рынка.
3. К достоинствам биржевой формы финансового рынка относится:
  - а) широкий перечень финансовых инструментов;
  - б) более доходные активы;
  - в) открытый характер торгов;
  - г) строгое регулирование и контроль со стороны государства.
4. Не является верным следующее утверждение:
  - а) на финансовых рынках цена на отдельные финансовые инструменты отражает сбалансированность спроса и предложения на рынке, состояние его равновесия;
  - б) на финансовых рынках чем выше доходность финансового инструмента, тем выше риск её получения;
  - в) на финансовых биржах устанавливается наиболее объективная система цен на торгуемые активы;
  - г) На биржевые цены на финансовых рынках не оказывает воздействие спекулятивный спрос.
5. Какой сегмент финансового рынка вы считаете наиболее важным для мировой экономики в настоящее время?
6. Какую из функций финансового рынка вы считаете основополагающей?

**Тест 2**

1. На кредитном рынке осуществляются:
  - а) ссудные операции;
  - б) краткосрочные ссудные операции;
  - в) ссудно-депозитные операции;
  - г) краткосрочные ссудно-депозитные операции.
2. С функциональной точки зрения кредитная система представляет собой:
  - а) совокупность кредитных отношений, форм и методов кредитования;
  - б) совокупность кредитно-финансовых учреждений;
  - в) совокупность кредитных отношений и институтов, организующих кредитные отношения;
  - г) совокупность банков, иных кредитно-финансовых институтов, аккумулирующих временно свободные денежные средства и предоставляющих их в ссуду.
3. Банки отличаются от небанковских кредитно-финансовых институтов отличаются от банков:
  - а) возможностью привлекать вклады;
  - б) возможностью выдавать ссуды;
  - в) возможностью открывать счета клиентов;
  - г) возможностью выпускать ценные бумаги.
4. Денежные, товарные или товарно-денежные отношения, складывающиеся между заемщиком – физическим лицом и кредитором называются:
  - а) государственный кредит;
  - б) коммерческий кредит;
  - в) потребительский кредит;

г) банковский кредит.

5. Операция по выкупу обязательства у должника перед кредитором с возможностью их дальнейшей перепродажи называется:

- а) овердрафт;
- б) факторинг;
- в) форфейтинг;
- г) лизинг.

6. К числу небанковских кредитных организаций не относятся:

- а) Пенсионные фонды;
- б) Биржи;
- в) Благотворительные организации;
- г) Ломбарды.

7. Дайте описание процесса трансформации денежного капитала в ссудный капитал: кто осуществляет эту трансформацию, в какой момент она происходит?

8. Каким образом кредитный рынок способствует росту товарооборота?

### Тест 3

1. Производный финансовый инструмент отличается от производной ценной бумаги:

- а) тем, что по нему операция не может совершиться ранее, чем через 2 дня с момента заключения договора;
- б) тем, что по нему операция может совершиться ранее, чем через 2 дня с момента заключения договора;
- в) тем, что производный финансовый инструмент может не быть закреплён в качестве ценной бумаги в законе о рынке ценных бумаг;
- г) тем, что его стоимость изменяется в зависимости от какого-либо параметра.

2. Понятие производного финансового инструмента не предусматривает обязанности:

- а) уплачивать денежные суммы в зависимости от изменений какого-либо параметра;
- б) купить или продать актив в случае предъявления требований;
- в) передать долю имущественных прав продавца инструмента в собственность другой стороне;
- г) передать актив в собственность другой стороне не ранее третьего дня после дня заключения договора.

3. Опцион на поставку 30 000 долларов США по цене 60 руб. за доллар является:

- а) фондовым деривативом;
- б) процентным деривативом;
- в) кредитным деривативом;
- г) валютным деривативом.

4. Денежное вложение в права на последующее получение финансовых средств представляет собой:

- а) физические инвестиции;
- б) прямые инвестиции;
- в) портфельные инвестиции;
- г) финансовые инвестиции.

5. Инвестиции, направленные на расширение производства и захват новых рынков сбыта называются:

- а) активные;
- б) интенсивные;
- в) пассивные;
- г) экстенсивные.

6. Стандартным биржевым контрактом может являться:

- а) форвард;
- б) своп;
- в) варрант;
- г) фьючерс.

7. При каких обстоятельствах, на ваш взгляд, предпринимателю может пригодиться опцион на покупку им акций какой-либо компании?

8. Какие структурные изменения в экономике страны, на ваш взгляд, могут привести к увеличению иностранных инвестиций?

#### Темы рефератов

1. Классификация инструментов финансового рынка;
2. Фондовые биржи;
3. Валютные биржи;
4. Деятельность депозитариев на рынке ценных бумаг;
5. Деятельность регистраторов на рынке ценных бумаг;
6. Деятельность расчётно-клиринговых центров на рынке ценных бумаг;
7. Деятельность Московской Биржи (ММВБ и РТС);
8. Деятельность биржи «Санкт-Петербург»;
9. Деятельность Санкт-Петербургской валютной биржи (СПВБ);
10. Деятельность Московской фондовой биржи (МФБ);
11. Крупнейшие мировые фондовые биржи;
12. Деятельность МВФ на мировом финансовом рынке;
13. Деятельность Международного банка реконструкции и развития на мировом финансовом рынке;
14. Деятельность Международной ассоциации развития на мировом финансовом рынке;
15. Деятельность Международной финансовой корпорации на мировом финансовом рынке;
16. Деятельность Многостороннего агентства по гарантиям инвестиций на мировом финансовом рынке;
17. Категории и роль институциональных участников финансового рынка;
18. Роль депозитных финансовых организаций на финансовых рынках;
19. Роль страховых организаций на финансовых рынках;
20. Роль пенсионных фондов на финансовых рынках;
21. Роль паевых инвестиционных фондов на финансовых рынках;
22. Классификация и роль инвестиционных фондов;
23. Брокерская деятельность на финансовых рынках;
24. Роль Международного валютного фонда в регулировании мирового финансового рынка;
25. Роль Международного банка реконструкции и развития в регулировании мирового финансового рынка;
26. Роль Базельского комитета по банковскому надзору в регулировании мирового финансового рынка;
27. Нормативное регулирование кредитного рынка;
28. Нормативное регулирование фондового рынка;
29. Нормативное регулирование валютного рынка;
30. Нормативное регулирование инвестиционного рынка;
31. Нормативное регулирование рынка драгоценных металлов;
32. История формирования международного валютного рынка;
33. История формирования международного кредитного рынка;
34. История формирования международного фондового рынка;
35. История формирования международного рынка деривативов;
36. История формирования финансового рынка в России;
37. Глобализация международного финансового рынка;
38. Деятельность учётных домов на финансовом рынке;
39. Основные международные и российские межбанковские кредитные ставки;
40. Некредитные инструменты повышения банковской ликвидности;
41. Небанковские кредитные организации и их деятельность;
42. Факторинг и форфейтинг как инструменты кредитного рынка;
43. Мировой рынок золота;
44. Мировой рынок серебра;
45. Мировой рынок платины;
46. Основные международные фондовые индексы;
47. Основные российские фондовые индексы;
48. Денежные ценные бумаги и их виды;
49. Инвестиционные ценные бумаги и их виды;
50. Товарные ценные бумаги и их виды;
51. Мировой рынок перестрахования;
52. Характеристика кредитного рынка России;
53. Характеристика валютного рынка России;
54. Характеристика фондового рынка России.

## Примеры кейс-заданий

Задание:

Определить премию/дисконт по трёхмесячному курсу аутрайт, если курс покупки фунта стерлингов составляет 73,6181 руб., курс продажи – 81,1649 руб., ставка по межбанковским депозитам в фунтах – 0,1%, по межбанковским кредитам в фунтах – 0,4%, по рублёвым межбанковским депозитам – 6%, по рублёвым межбанковским кредитам – 10%.

Задание:

На основании данных таблицы вычислить значения фондового индекса для представленных в таблице компаний по методу простой средней арифметической величины. Построить график изменения индекса.

Название предприятия	Цена акции, долл.				
	2010 г.	2011 г.	2012 г.	2013 г.	2014 г.
Альфа	2,8	2,7	3,1	3,2	3,3
Бета	34,0	36,5	35,2	28,1	30,4
Гамма	0,3	0,6	0,5	0,4	0,7
Дельта	56,3	57,2	55,2	57,3	59,0
Сигма	0,7	0,8	1,1	0,9	1,0
Эпсилон	0,09	0,11	0,16	0,22	0,3

Задание:

Две стороны заключают между собой договор процентного свопа с 1 января 2012 г. Срок действия свопа – 2 года. Платательщик фиксированной ставки обязуется платить 8,0% годовых. Платательщик плавающей ставки обязуется платить 3-месячную ставку по средним объявленным ставкам по привлечению московскими банками кредитов (MIBID). Расчёты по процентному свопу будут происходить 1 раз в 3 месяца.

3-Месячная ставка MIBID:

1.01.2012 – 7,50;

1.04.2012 – 9,00;

1.07.2012 – 7,68;

1.10.2012 – 7,90;

1.01.2013 – 9,00;

1.04.2013 – 8,00;

1.07.2013 – 8,13

1.10.2013 – 7,08.

Определить выигравшую сторону, размер выигрыша.

Задание:

Компания приобрела опцион на покупку 100 000 долл. по цене 54 руб. за доллар, за 100 000 руб. Одновременно ею за 140 000 руб. был продан опцион на покупку этого же количества долларов по цене 57 руб. за долл. Какова должна быть цена за доллар на момент исполнения опциона, чтобы компания получила прибыль от данных операций. Как называется данный тип стратегии?

## Контрольная работа

Задание 1. Дайте определение следующим понятиям:

1. Финансовый риск;
2. Арбитражное хеджирование;
3. Скалперы;
4. Лимитирование.

Задание 2. Дайте ответы на вопросы:

1. Какую позитивную роль выполняют спекулянты на финансовом рынке?
2. В чём состоит разница между стратегией одиночной операции и стратегией спреда при хеджировании?
3. Для производителей отечественной продукции наиболее опасен инфляционный или дефляционный риск? А для потребителей?
4. Какие органы государственной власти осуществляют государственное регулирование финансового рынка в РФ?

Задание 3. Решите задачи:

1. Хеджер при спотовой цене 54 руб. за евро продаёт фьючерсный контракт на 20 000 евро по 57 руб. Каковы будут результаты хеджирования, если цена за евро: а) снизится до 52 руб.; б) повысится до 55 руб.

2. Инвестор приобретает опцион на покупку пакета из 400 акций на по цене 50 долл. за акцию. Премия за опцион составила 3000 долл. Рассматривая варианты цены на акцию на момент исполнения опциона: а) 60 долл. за акцию; б) 30 долл. за акцию, определить размер дохода инвестора. В каком из вариантов было выгодно заключить опционный контракт?

3. Значения российского индекса РТС составляли:

1. 3 апреля: 930,90;
2. 6 апреля: 968,78;
3. 7 апреля: 969,04;
4. 8 апреля: 983,82;
5. 9 апреля: 1004,57;
6. 10 апреля: 1002,59;
7. 13 апреля: 1003,50.

Рассчитайте показатель темпа прироста индекса РТС за исследованный период. Сделайте прогноз значения индекса на 14 апреля, если предположить, что его динамика описывается уравнением линейного тренда  $y = 11,463x + 934,61$ .

#### **4 Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций**

Оценивание знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций осуществляется путем проведения процедур текущего контроля и промежуточной аттестации в соответствии с Положением университета о проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся по программам бакалавриата и программам магистратуры.

#### **Текущий контроль проводится на занятиях в течение семестра**

*Оценочные средства текущего контроля:*

- Тест;
- Реферат;
- Кейс-задание;
- Контрольная работа.

#### **Промежуточная аттестация проводится по завершению 7 семестра – зачёт в устной форме**

Оценочное средство *зачёт*:

#### **Примерный перечень вопросов к зачёту по дисциплине**

1. Понятие финансового рынка;
2. Функции финансового рынка;
3. Классификация финансовых рынков;
4. Участники финансового рынка;
5. Финансовые посредники;
6. Инфраструктура финансовых рынков;
7. Профессиональная деятельность на финансовом рынке;
8. Система регулирования финансовых рынков;
9. Нормативное регулирование финансовых рынков;
10. Государственные органы, осуществляющие регулирование финансовых рынков в РФ;
11. Особенности международного финансового рынка;
12. Этапы формирования международного финансового рынка;
13. Современные тенденции развития международного финансового рынка;
14. Понятие денежного рынка;
15. Учётный рынок;
16. Межбанковский рынок;
17. Понятие кредитного рынка;
18. Структура и участники кредитного рынка;
19. Классификация инструментов кредитного рынка.
20. Понятие валютного рынка;
21. Структура и участники валютного рынка;
22. Валютный курс;
23. Основные операции на валютном рынке;

24. Понятие рынка драгоценных металлов;
25. Структура и участники рынка драгоценных металлов;
26. Ценообразование на рынке драгоценных металлов;
27. Операции на рынке драгоценных металлов;

Шкала оценивания:

- оценка «зачтено» (*при неполном (пороговом), хорошем (углублённом) или отличном (продвинутом) усвоении*) выставляется обучающемуся, если он продемонстрировал знание основной части теоретического материала, входящего в вопрос зачёта;
- оценка «не зачтено» (*при отсутствии усвоения (ниже порогового)*) выставляется обучающемуся, если он не продемонстрировал знание основной части теоретического материала, входящего в вопрос зачёта.

**Промежуточная аттестация проводится по завершению 8 семестра – дифференцированный зачёт в письменной форме**

Оценочное средство *дифференцированный зачёт*:

#### **Примерный перечень вопросов к зачёту по дисциплине**

1. Понятие финансового рынка;
2. Функции финансового рынка;
3. Классификация финансовых рынков;
4. Участники финансового рынка;
5. Финансовые посредники;
6. Инфраструктура финансовых рынков;
7. Профессиональная деятельность на финансовом рынке;
8. Система регулирования финансовых рынков;
9. Нормативное регулирование финансовых рынков;
10. Государственные органы, осуществляющие регулирование финансовых рынков в РФ;
11. Особенности международного финансового рынка;
12. Этапы формирования международного финансового рынка;
13. Современные тенденции развития международного финансового рынка;
14. Понятие денежного рынка;
15. Учётный рынок;
16. Межбанковский рынок;
17. Понятие кредитного рынка;
18. Структура и участники кредитного рынка;
19. Классификация инструментов кредитного рынка.
20. Понятие валютного рынка;
21. Структура и участники валютного рынка;
22. Валютный курс;
23. Основные операции на валютном рынке;
24. Понятие рынка драгоценных металлов;
25. Структура и участники рынка драгоценных металлов;
26. Ценообразование на рынке драгоценных металлов;
27. Операции на рынке драгоценных металлов;
28. Понятие фондового рынка;
29. Структура и участники фондового рынка;
30. Классификация инструментов фондового рынка;
31. Индексы фондового рынка;
32. Понятие рынка деривативов;
33. Структура и участники рынка деривативов;
34. Классификация производных финансовых инструментов;
35. Понятие рынка инвестиций;
36. Структура и участники рынка инвестиций;
37. Классификация основных форм инвестиций;
38. Понятие страхового рынка;
39. Структура и участники рынка страховых услуг;
40. Страховые продукты и инвестиционная деятельность страховщика;
41. Понятие и виды рисков на финансовых рынках;
42. Классические методы управления рисками на финансовых рынках;
43. Управление рисками с помощью производных финансовых инструментов;
44. Хеджирование с помощью фьючерсов;

45. Хеджирование с помощью опционов.
46. Функции и виды спекулянтов на финансовых рынках;
47. Опционные стратегии спекуляции;
48. Анализ ценообразования на финансовом рынке.

Шкала оценивания:

- оценка «зачтено отлично» (при отличном усвоении (продвинутом)) выставляется обучающемуся, если он продемонстрировал знание теоретической части вопроса зачёта, понимание сущности и взаимосвязей затронутого материала, безошибочное решение задачи;
- оценка «зачтено хорошо» (при хорошем усвоении (углубленном)) выставляется обучающемуся, если он продемонстрировал знание основ теоретической части вопроса зачёта, частичное понимание сущности и взаимосвязей затронутого материала, безошибочное решение задачи;
- оценка «зачтено удовлетворительно» (при неполном усвоении (пороговом)) выставляется обучающемуся, если он продемонстрировал знание основ теоретической части вопроса зачёта, безошибочное решение задачи.
- оценка «не зачтено» (при отсутствии усвоения (ниже порогового)) выставляется обучающемуся, если он не продемонстрировал знания основ теоретической части вопроса зачёта.