

ФЕДЕРАЛЬНОЕ АГЕНТСТВО ЖЕЛЕЗНОДОРОЖНОГО ТРАНСПОРТА

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Иркутский государственный университет путей сообщения»  
(ФГБОУ ВО ИрГУПС)

УТВЕРЖДЕНА  
приказом и.о. ректора  
от «17» июня 2022 г. № 77

**Б1.В.ДВ.03.01 Финансовые рынки и институты**

**рабочая программа дисциплины**

Специальность/направление подготовки – 38.05.01 Экономическая безопасность

Специализация/профиль – Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Квалификация выпускника – Экономист

Форма и срок обучения – очная форма 5 лет; заочная форма 6 лет

Кафедра-разработчик программы – Финансовый и стратегический менеджмент

Общая трудоемкость в з.е. – 3

Часов по учебному плану (УП) – 108

В том числе в форме практической подготовки (ПП) –  
4/4

(очная/заочная)

Формы промежуточной аттестации

очная форма обучения:

зачет 4 семестр

заочная форма обучения:

зачет 3 курс

**Очная форма обучения**

**Распределение часов дисциплины по семестрам**

Семестр	4	Итого
Вид занятий	Часов по УП	Часов по УП
<b>Аудиторная контактная работа по видам учебных занятий/ в т.ч. в форме ПП*</b>	51/4	51/4
– лекции	17	17
– практические (семинарские)	34/4	34/4
– лабораторные		
<b>Самостоятельная работа</b>	57	57
<b>Итого</b>	108/4	108/4

**Заочная форма обучения**

**Распределение часов дисциплины по семестрам**

Курс	3	Итого
Вид занятий	Часов по УП	Часов по УП
<b>Аудиторная контактная работа по видам учебных занятий/ в т.ч. в форме ПП*</b>	12/4	12/4
– лекции	6	6
– практические (семинарские)	6/4	6/4
– лабораторные		
<b>Самостоятельная работа</b>	92	92
<b>Зачет</b>	4	4
<b>Итого</b>	108/4	108/4

\* В форме ПП – в форме практической подготовки.

ИРКУТСК

Электронный документ выгружен из ЕИС ФГБОУ ВО ИрГУПС и соответствует оригиналу

Подписант ФГБОУ ВО ИрГУПС Трофимов Ю.А.

00a73c5b7b623a969ccad43a81ab346d50 с 08.12.2022 14:32 по 02.03.2024 14:32 GMT+03:00

Подпись соответствует файлу документа



Рабочая программа дисциплины разработана в соответствии с федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования – специалитет по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность, утвержденным Приказом Минобрнауки России от 14.04.2021 г. № 293.

Программу составил(и):  
к.э.н., доцент, О.А. Рябущенко

Рабочая программа рассмотрена и одобрена для использования в учебном процессе на заседании кафедры «Финансовый и стратегический менеджмент», протокол от «17» июня 2022 г. № 10

Зав. кафедрой, к.э.н., доцент

С.А. Халетская

<b>1 ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ</b>	
<b>1.1 Цели дисциплины</b>	
1	понимание структуры и теоретического аппарата финансовых рынков;
2	знание методов оценки финансовых рынков и инструментов;
3	определение видов ценных бумаг, знание критериев расчета их доходности;
4	владение методами расчета финансовых показателей как для компании, так и для инвестиционного проекта;
5	умение формировать инвестиционную политику компании на финансовых рынках
<b>1.2 Задачи дисциплины</b>	
1	сформировать у обучающегося комплексное понимание роли финансового рынка в экономике;
2	определить структуру финансового рынка;
3	дать понимание основных видов ценных бумаг и финансовых инструментов;
4	обучить методам оценки доходности финансовых инструментов;
5	дать общие понятия оценки инвестиционных проектов и программ;
6	сформировать навыки оценки капитала и его структуры
<b>1.3 Цель воспитания и задачи воспитательной работы в рамках дисциплины</b>	
Профессионально-трудовое воспитание обучающихся	
Цель профессионально-трудового воспитания – формирование у обучающихся осознанной профессиональной ориентации, понимания общественного смысла труда и значимости его для себя лично, ответственного, сознательного и творческого отношения к будущей деятельности, профессиональной этики, способности предвидеть изменения, которые могут возникнуть в профессиональной деятельности, и умению работать в изменённых, вновь созданных условиях труда.	
Цель достигается по мере решения в единстве следующих задач:	
– формирование сознательного отношения к выбранной профессии;	
– воспитание чести, гордости, любви к профессии, сознательного отношения к профессиональному долгу, понимаемому как личная ответственность и обязанность;	
– формирование психологии профессионала;	
– формирование профессиональной культуры, этики профессионального общения;	
– формирование социальной компетентности и другие задачи, связанные с имиджем профессии и авторитетом транспортной отрасли	

<b>2 МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП</b>	
Блок/часть ОПОП	Блок 1. Дисциплины / Часть, формируемая участниками образовательных отношений
<b>2.1 Дисциплины и практики, на которых основывается изучение данной дисциплины</b>	
1	Дисциплина изучается на начальном этапе формирования компетенции
<b>2.2 Дисциплины и практики, для которых изучение данной дисциплины необходимо как предшествующее</b>	
1	Б1.О.48 Национальная и региональная экономическая безопасность
2	Б1.О.55 Правовое обеспечение экономической безопасности
3	Б1.В.ДВ.02.01 Международные валютно-кредитные отношения
4	Б1.В.ДВ.04.01 Финансовый мониторинг
5	Б1.В.ДВ.05.01 Бизнес-планирование
6	Б1.В.ДВ.07.01 Экономические преступления
7	Б1.В.ДВ.08.01 Банковское дело
8	Б2.О.04(Н) Производственная - научно-исследовательская работа
9	Б3.01(Д) Подготовка к процедуре защиты выпускной квалификационной работы
10	Б3.02(Д) Защита выпускной квалификационной работы

<b>3 ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ, СООТНЕСЕННЫЕ С ТРЕБОВАНИЯМИ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ</b>		
Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Планируемые результаты обучения
ПК-4 Способен систематизировать и анализировать информацию о финансовых операциях хозяйствующих субъектов с	ПК-4.3 Систематизирует информацию и анализирует финансовые операции с использованием действующей нормативно-правовой базы	Знать: законодательно-нормативные акты, регламентирующие инвестиционную деятельность предприятия; сущность и функции финансов, их роль в современной экономике; виды ценных бумаг и особенности их обращения
		Уметь: ставить задачу, формировать информационную базу, отбирать показатели и критерии, необходимые для оценки эффективности инвестиций

использованием действующей нормативно-правовой базы с целью последующего обеспечения экономической безопасности		Владеть: методиками оценки эффективности инвестиций; навыками обоснования и выбора управленческих решений в обосновании целесообразности инвестиционной деятельности предприятия
	ПК-4.4 Систематизирует факторы рисков в условиях неопределенности	Знать: типовые методики расчета показателей деятельности хозяйствующих субъектов, специфику и закономерности организации финансовой системы страны, функционирования денежной системы, финансового рынка в России; методы расчета специализированных инвестиционных показателей (в том числе для банков и хозяйствующих субъектов), отечественный и зарубежный опыт в области методик экономической оценки эффективности инвестиций
		Уметь: проводить экономическую оценку эффективности инвестиций с позиции заинтересованных сторон; организовывать работу по обоснованию инвестиционной деятельности на предприятии
		Владеть: навыками в использовании приемов и методов расчета общественной, коммерческой и бюджетной эффективности инвестиций; навыками обоснования и выбора управленческих решений в обосновании целесообразности инвестиционной деятельности предприятия

4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ													
Код	Наименование разделов, тем и видов работ	Очная форма				Заочная форма				*Код индикатора достижения компетенции			
		Семестр	Часы			Курс	Часы						
			Лек	Пр	Лаб		СР	Лек	Пр		Лаб	СР	
<b>1.0</b>	<b>Раздел 1. Основы функционирования финансовых рынков, его структура.</b>												
1.1	Сущность и функции финансового рынка. Инфраструктура финансовых рынков	4	2	4		6	3/уст.		1			8	ПК-4.3 ПК-4.4
1.2	Сегменты финансовых рынков	4	2	4		6	3/уст.	1				8	ПК-4.3 ПК-4.4
1.3	Риск и доход на финансовых рынках	4	3	6/2		8	3/уст.	1	1/2			8	ПК-4.3 ПК-4.4
1.4	Регулирование финансового рынка	4	2	4		6	3/уст.	1				8	ПК-4.3 ПК-4.4
<b>2.0</b>	<b>Раздел 2. Рынок производных финансовых инструментов.</b>												
2.1	Понятие, сущность и функции производных финансовых инструментов	4	2	4		7	3/уст.	1				10	ПК-4.3 ПК-4.4
2.2	Формы и инструменты международных расчетов.	4	2	4/2		8	3/уст.	1	2/2			10	ПК-4.3 ПК-4.4
2.3	Биржевой и внебиржевой рынок	4	2	4		8	3/уст.	1	1			10	ПК-4.3 ПК-4.4
2.4	Методы оценки рисков производных финансовых инструментов	4	2	4		8	3/уст.		1			10	ПК-4.3 ПК-4.4
	Форма промежуточной аттестации – зачет	4					3/зимняя				4		ПК-4.3 ПК-4.4
	Контрольная работа						3/зимняя					20	ПК-4.3 ПК-4.4

#### 4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Код	Наименование разделов, тем и видов работ	Очная форма				Заочная форма				*Код индикатора достижения компетенции		
		Семестр	Часы			Курс	Часы					
			Лек	Пр	Лаб		СР	Лек	Пр		Лаб	СР
	Итого часов (без учёта часов на промежуточную аттестацию)		17	34/4		57		6	6/4		92	

#### 5 ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по дисциплине оформлен в виде приложения № 1 к рабочей программе дисциплины и размещен в электронной информационно-образовательной среде Университета, доступной обучающемуся через его личный кабинет

#### 6 УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

##### 6.1 Учебная литература

##### 6.1.1 Основная литература

	Библиографическое описание	Кол-во экз. в библиотеке/ онлайн
6.1.1.1	Болдырева, Н. Б. Финансовые рынки и институты : учебник и практикум для вузов - 2-е изд. пер. и доп. Н. Б. Болдырева [и др.] ; под редакцией Н. Б. Болдыревой, Г. В. Черновой. Москва : Юрайт, 2020. - 403с. - Текст: электронный. - URL: <a href="https://urait.ru/bcode/451248">https://urait.ru/bcode/451248</a> (дата обращения: 09.09.2022)	Онлайн
6.1.1.2	Гусева, И. А. Финансовые рынки и институты : учебник и практикум для вузов / И. А. Гусева. Москва : Юрайт, 2022. - 347с. - Текст: электронный. - URL: <a href="https://urait.ru/bcode/489743">https://urait.ru/bcode/489743</a> (дата обращения: 09.09.2022)	Онлайн
6.1.1.3	Якунина, А. В. Финансовые рынки : учебное пособие для вузов / А. В. Якунина, С. В. Якунин, Ю. В. Семернина. Санкт-Петербург : Лань, 2022. - 124с. - Текст: электронный. - URL: <a href="https://e.lanbook.com/book/266840">https://e.lanbook.com/book/266840</a> (дата обращения: 19.04.2023)	Онлайн

##### 6.1.2 Дополнительная литература

	Библиографическое описание	Кол-во экз. в библиотеке/ онлайн
6.1.2.1	Михайленко, М. Н. Финансовые рынки и институты : учебник для вузов - 2-е изд. пер. и доп. М. Н. Михайленко. Москва : Юрайт, 2022. - 336с. - Текст: электронный. - URL: <a href="https://urait.ru/bcode/489000">https://urait.ru/bcode/489000</a> (дата обращения: 09.09.2022)	Онлайн
6.1.2.2	Федотова, М. Ю. Финансовые рынки и финансово-кредитные институты : учебное пособие / М. Ю. Федотова. Пенза : ПГАУ, 2020. - 212с. - Текст: электронный. - URL: <a href="https://e.lanbook.com/book/170947">https://e.lanbook.com/book/170947</a> (дата обращения: 19.04.2023)	Онлайн

##### 6.1.3 Учебно-методические разработки (в т. ч. для самостоятельной работы обучающихся)

	Библиографическое описание	Кол-во экз. в библиотеке/ онлайн
6.1.3.1	Рябущенко, О.А. Методические указания по изучению дисциплины Б1.В.ДВ.03.01 Финансовые рынки и институты по специальности 38.03.01 Экономика, специализация Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности / О.А. Рябущенко ; ИрГУПС. – Иркутск : ИрГУПС, 2023. – 13 с. - Текст: электронный. - URL: <a href="https://www.irgups.ru/eis/for_site/umkd_files/mu_10356_1562_2022_1_signed.pdf">https://www.irgups.ru/eis/for_site/umkd_files/mu_10356_1562_2022_1_signed.pdf</a>	Онлайн

##### 6.2 Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

6.2.1	Научная электронная библиотека «КиберЛенинка» — <a href="https://cyberleninka.ru/">https://cyberleninka.ru/</a>
6.2.2	Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU — <a href="https://elibrary.ru/">https://elibrary.ru/</a>
6.2.3	Электронно-библиотечная система «BOOK.ru», <a href="https://www.book.ru/">https://www.book.ru/</a>
6.2.4	Электронно-библиотечная система «Издательство Лань», <a href="https://e.lanbook.com/">https://e.lanbook.com/</a>
6.2.5	Электронно-библиотечная система «Образовательная платформа ЮРАЙТ», <a href="https://urait.ru/">https://urait.ru/</a>
6.2.6	Электронно-библиотечная система «Университетская библиотека онлайн», <a href="https://biblioclub.ru/">https://biblioclub.ru/</a>
6.2.7	Электронно-библиотечная система Polpred.com Обзор СМИ, <a href="https://polpred.com/">https://polpred.com/</a>

<b>6.3 Программное обеспечение и информационные справочные системы</b>	
<b>6.3.1 Базовое программное обеспечение</b>	
6.3.1.1	Microsoft Windows Professional 10, государственный контракт от 20.07.2021 № 0334100010021000013-01
6.3.1.2	Microsoft Office Russian 2010, государственный контракт от 20.07.2021 № 0334100010021000013-01
6.3.1.3	FoxitReader, свободно распространяемое программное обеспечение <a href="http://free-software.com.ua/pdf-viewer/foxit-reader/">http://free-software.com.ua/pdf-viewer/foxit-reader/</a>
6.3.1.4	Adobe Acrobat Reader DC свободно распространяемое программное обеспечение <a href="https://get.adobe.com/ru/reader/enterprise/">https://get.adobe.com/ru/reader/enterprise/</a>
6.3.1.5	Яндекс. Браузер. Прикладное программное обеспечение общего назначения, Офисные приложения, лицензия – свободно распространяемое программное обеспечение по лицензии BSD License
<b>6.3.2 Специализированное программное обеспечение</b>	
6.3.2.1	Не предусмотрено
<b>6.3.3 Информационные справочные системы</b>	
6.3.3.1	Не предусмотрены
<b>6.4 Правовые и нормативные документы</b>	
6.4.1	Не предусмотрены

<b>7 ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ УЧЕБНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ</b>	
1	Корпуса А, Б, В, Г, Д, Е ИрГУПС находятся по адресу г. Иркутск, ул. Чернышевского, д. 15; корпус Л ИрГУПС находится – по адресу г. Иркутск, ул. Лермонтова, д.80
2	Учебная аудитория Л-205 для проведения лекционных и практических занятий, лабораторных работ, групповых и индивидуальных консультаций, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), текущего контроля и промежуточной аттестации. Основное оборудование: специализированная мебель, мультимедиапроектор, экран, компьютер. Для проведения занятий имеются учебно-наглядные пособия (презентации, плакаты).
3	Учебная аудитория Л-210 для проведения лекционных и практических занятий, лабораторных работ, групповых и индивидуальных консультаций, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), текущего контроля и промежуточной аттестации. Основное оборудование: специализированная мебель, мультимедиапроектор, экран, компьютер. Для проведения занятий имеются учебно-наглядные пособия (презентации, плакаты).
4	Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой, подключенной к информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», и обеспечены доступом в электронную информационно-образовательную среду ИрГУПС. Помещения для самостоятельной работы обучающихся: – читальные залы; – учебные залы вычислительной техники А-401, А-509, А-513, А-516, Д-501, Д-503, Д-505, Д-507; – помещения для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования – А-521

<b>8 МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ</b>	
Вид учебной деятельности	Организация учебной деятельности обучающегося
Лекция	<p>Лекция (от латинского «lection» – чтение) – вид аудиторных учебных занятий. Лекция: закладывает основы научных знаний в систематизированной, последовательной, обобщенной форме; раскрывает состояние и перспективы развития соответствующей области науки и техники; концентрирует внимание обучающихся на наиболее сложных, узловых вопросах; стимулирует познавательную активность обучающихся.</p> <p>Во время лекционных занятий обучающийся должен уметь сконцентрировать внимание на изучаемых проблемах и включить в работу все виды памяти: словесную, образную и моторно-двигательную. Для этого весь материал, излагаемый преподавателем, обучающемуся необходимо конспектировать. На полях конспекта следует пометить вопросы, выделенные обучающимся для консультации с преподавателем. Выводы, полученные в виде формул, рекомендуется в конспекте подчеркивать или обводить рамкой, чтобы лучше запоминались. Полезно составить краткий справочник, содержащий определения важнейших понятий лекции. К каждому занятию следует разобрать материал предыдущей лекции. Изучая материал по учебнику или конспекту лекций, следует переходить к следующему вопросу только в том случае, когда хорошо усвоен предыдущий вопрос. Ряд вопросов дисциплины может быть вынесен на самостоятельное изучение. Такое</p>

	<p>задание требует оперативного выполнения. В конспекте лекций необходимо оставить место для освещения упомянутых вопросов. Обозначить вопросы, термины, материал, который вызывает трудности, пометить и попытаться найти ответ в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удастся разобраться в материале, то необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на консультации, на практическом занятии</p>
Практическое занятие	<p>Практическое занятие – вид аудиторных учебных занятий, целенаправленная форма организации учебного процесса, при реализации которой обучающиеся по заданию и под руководством преподавателя выполняют практические задания. Практические задания направлены на углубление научно-теоретических знаний и овладение определенными методами работы, в процессе которых вырабатываются умения и навыки выполнения тех или иных учебных действий в данной сфере науки. Практические занятия развивают научное мышление и речь, позволяют проверить знания обучающихся, выступают как средства оперативной обратной связи; цель практических занятий – углублять, расширять, детализировать знания, полученные на лекции, в обобщенной форме и содействовать выработке навыков профессиональной деятельности.</p> <p>На практических занятиях подробно рассматриваются основные вопросы дисциплины, разбираются основные типы задач. К каждому практическому занятию следует заранее самостоятельно выполнить домашнее задание и выучить лекционный материал к следующей теме. Систематическое выполнение домашних заданий обязательно и является важным фактором, способствующим успешному усвоению дисциплины</p>
Самостоятельная работа	<p>Обучение по дисциплине «Финансовые рынки и институты» предусматривает активную самостоятельную работу обучающегося. В разделе 4 рабочей программы, который называется «Структура и содержание дисциплины», все часы самостоятельной работы расписаны по темам и вопросам, а также указана необходимая учебная литература: обучающийся изучает учебный материал, разбирает примеры и решает разноуровневые задачи в рамках выполнения как общих домашних заданий, так и индивидуальных домашних заданий (ИДЗ) и других видов работ, предусмотренных рабочей программой дисциплины. При выполнении домашних заданий обучающемуся следует обратиться к задачам, решенным на предыдущих практических занятиях, решенным домашним работам, а также к примерам, приводимым лектором. Если этого будет недостаточно для выполнения всей работы можно дополнительно воспользоваться учебными пособиями, приведенными в разделе 6.1 «Учебная литература». Если, несмотря на изученный материал, задание выполнить не удастся, то в обязательном порядке необходимо посетить консультацию преподавателя, ведущего практические занятия, и/или консультацию лектора.</p> <p>Домашние задания, индивидуальные домашние задания и другие работы, предусмотренные рабочей программой дисциплины должны быть выполнены обучающимся в установленные преподавателем сроки в соответствии с требованиями к оформлению текстовой и графической документации, сформулированным в Положении «Требования к оформлению текстовой и графической документации. Нормоконтроль»</p>
<p>Комплекс учебно-методических материалов по всем видам учебной деятельности, предусмотренным рабочей программой дисциплины (модуля), размещен в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет</p>	

# **Приложение № 1 к рабочей программе**

## **ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ**

**для проведения текущего контроля успеваемости  
и промежуточной аттестации**



## 1. Общие положения

Фонд оценочных средств (ФОС) является составной частью нормативно-методического обеспечения системы оценки качества освоения обучающимися образовательной программы.

Фонд оценочных средств предназначен для использования обучающимися, преподавателями, администрацией ИрГУПС, а также сторонними образовательными организациями для оценивания качества освоения образовательной программы и уровня сформированности компетенций у обучающихся.

Задачами ФОС являются:

- оценка достижений обучающихся в процессе изучения дисциплины;
- обеспечение соответствия результатов обучения задачам будущей профессиональной деятельности через совершенствование традиционных и внедрение инновационных методов обучения в образовательный процесс;
- самоподготовка и самоконтроль обучающихся в процессе обучения.

Фонд оценочных средств сформирован на основе ключевых принципов оценивания: валидность, надежность, объективность, эффективность.

Для оценки уровня сформированности компетенций используется трехуровневая система:

- минимальный уровень освоения, обязательный для всех обучающихся по завершению освоения образовательной программы; дает общее представление о виде деятельности, основных закономерностях функционирования объектов профессиональной деятельности, методов и алгоритмов решения практических задач;

- базовый уровень освоения, превышение минимальных характеристик сформированности компетенций; позволяет решать типовые задачи, принимать профессиональные и управленческие решения по известным алгоритмам, правилам и методикам;

- высокий уровень освоения, максимально возможная выраженность характеристик компетенций; предполагает готовность решать практические задачи повышенной сложности, нетиповые задачи, принимать профессиональные и управленческие решения в условиях неполной определенности, при недостаточном документальном, нормативном и методическом обеспечении.

## 2. Перечень компетенций, в формировании которых участвует дисциплина.

### Программа контрольно-оценочных мероприятий. Показатели оценивания компетенций, критерии оценки

Дисциплина «Финансовые рынки и институты» участвует в формировании компетенций:

ПК-4. Способен систематизировать и анализировать информацию о финансовых операциях хозяйствующих субъектов с использованием действующей нормативно-правовой базы с целью последующего обеспечения экономической безопасности

#### Программа контрольно-оценочных мероприятий очная форма обучения

№	Наименование контрольно-оценочного мероприятия	Объект контроля	Код индикатора достижения компетенции	Наименование оценочного средства (форма проведения*)
<b>4 семестр</b>				
<b>1.0</b>	<b>Раздел 1. Основы функционирования финансовых рынков, его структура</b>			
1.1	Текущий контроль	Сущность и функции финансового рынка. Инфраструктура финансовых рынков	ПК-4.3 ПК-4.4	Собеседование (устно)
1.2	Текущий контроль	Финансовые институты	ПК-4.3 ПК-4.4	Собеседование (устно)
1.3	Текущий контроль	Риск и доход на финансовых рынках	ПК-4.3 ПК-4.4	Собеседование (устно) В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
1.4	Текущий контроль	Регулирование финансового рынка	ПК-4.3 ПК-4.4	Собеседование (устно)
<b>2.0</b>	<b>Раздел 2. Рынок производных финансовых инструментов</b>			
2.1	Текущий контроль	Понятие, сущность и функции производных финансовых инструментов	ПК-4.3 ПК-4.4	Собеседование (устно)
2.2	Текущий контроль	Формы и инструменты международных расчетов.	ПК-4.3 ПК-4.4	Собеседование (устно) В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
2.3	Текущий контроль	Биржевой и внебиржевой рынок	ПК-4.3 ПК-4.4	Собеседование (устно)
2.4	Текущий контроль	Методы оценки рисков производных финансовых инструментов	ПК-4.3 ПК-4.4	Собеседование (устно)
	Промежуточная аттестация	Раздел 1. Основы функционирования финансовых рынков, его структура. Раздел 2. Рынок производных финансовых инструментов.	ПК-4.3 ПК-4.4	Зачет (собеседование) Зачет - тестирование (компьютерные технологии)

#### Программа контрольно-оценочных мероприятий заочная форма обучения

№	Наименование контрольно-оценочного мероприятия	Объект контроля	Код индикатора достижения компетенции	Наименование оценочного средства (форма проведения*)
<b>3 курс, сессия установочная</b>				
<b>1.0</b>	<b>Раздел 1. Основы функционирования финансовых рынков, его структура.</b>			
1.1	Текущий контроль	Сущность и функции финансового рынка. Инфраструктура финансовых рынков	ПК-4.3 ПК-4.4	Ситуационная задача (письменно) Собеседование (устно)
1.2	Текущий контроль	Финансовые институты	ПК-4.3 ПК-4.4	Собеседование (устно)

1.3	Текущий контроль	Риск и доход на финансовых рынках	ПК-4.3 ПК-4.4	Собеседование (устно) В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
1.4	Текущий контроль	Регулирование финансового рынка	ПК-4.3 ПК-4.4	Ситуационная задача (письменно) Собеседование (устно)
<b>2.0</b>	<b>Раздел 2. Рынок производных финансовых инструментов.</b>			
2.1	Текущий контроль	Понятие, сущность и функции производных финансовых инструментов	ПК-4.3 ПК-4.4	Собеседование (устно)
2.2	Текущий контроль	Формы и инструменты международных расчетов.	ПК-4.3 ПК-4.4	Разноуровневые задачи (задания/письменно) В рамках ПП**: Собеседование (устно)
2.3	Текущий контроль	Биржевой и внебиржевой рынок	ПК-4.3 ПК-4.4	Собеседование (устно)
2.4	Текущий контроль	Методы оценки рисков производных финансовых инструментов	ПК-4.3 ПК-4.4	Собеседование (устно)
<b>3 курс, сессия зимняя</b>				
	Текущий контроль	Раздел 1. Основы функционирования финансовых рынков, его структура. Раздел 2. Рынок производных финансовых инструментов.	ПК-4.3 ПК-4.4	Контрольная работа (КР) (письменно)
	Промежуточная аттестация	Раздел 1. Основы функционирования финансовых рынков, его структура. Раздел 2. Рынок производных финансовых инструментов.	ПК-4.3 ПК-4.4	Зачет (собеседование) Зачет - тестирование (компьютерные технологии)

\*Форма проведения контрольно-оценочного мероприятия: устно, письменно, компьютерные технологии.

\*\*ПП – практическая подготовка

### **Описание показателей и критериев оценивания компетенций.**

#### **Описание шкал оценивания**

Контроль качества освоения дисциплины включает в себя текущий контроль успеваемости и промежуточную аттестацию. Текущий контроль успеваемости и промежуточная аттестация обучающихся проводятся в целях установления соответствия достижений обучающихся поэтапным требованиям образовательной программы к результатам обучения и формирования компетенций.

Текущий контроль успеваемости – основной вид систематической проверки знаний, умений, навыков обучающихся. Задача текущего контроля – оперативное и регулярное управление учебной деятельностью обучающихся на основе обратной связи и корректировки. Результаты оценивания учитываются в виде средней оценки при проведении промежуточной аттестации.

Для оценивания результатов обучения используется четырехбалльная шкала: «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно» и двухбалльная шкала: «зачтено», «не зачтено».

Перечень оценочных средств, используемых для оценивания компетенций, а также краткая характеристика этих средств приведены в таблице.

### Текущий контроль

№	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в ФОС
1	Контрольная работа (КР)	Средство для проверки умений применять полученные знания по заранее определенной методике для решения задач или заданий по разделу дисциплины. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Типовое задание для выполнения контрольной работы по разделам/темам дисциплины
2	Собеседование	Средство контроля на практическом занятии, организованное как специальная беседа преподавателя с обучающимся на темы, связанные с изучаемой дисциплиной, и рассчитанное на выяснение объема знаний обучающегося по определенному разделу, теме, проблеме и т.п. Может быть использовано для оценки знаний обучающихся	Вопросы для собеседования по темам/разделам дисциплины
3	Ситуационная задача	Проблемное задание, в котором обучающемуся предлагают осмыслить реальную профессионально-ориентированную ситуацию, необходимую для решения данной проблемы. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, а также отдельных компетенций (в рамках дисциплины)	Типовое задание для решения ситуационной задачи
4	Разноуровневые задачи (задания)	Различают задачи: – репродуктивного уровня, позволяющие оценивать и диагностировать знание фактического материала (базовые понятия, алгоритмы, факты) и умение правильно использовать специальные термины и понятия, узнавание объектов изучения в рамках определенного раздела дисциплины; может быть использовано для оценки знаний и умений обучающихся; – реконструктивного уровня, позволяющие оценивать и диагностировать умения синтезировать, анализировать, обобщать фактический и теоретический материал с формулированием конкретных выводов, установлением причинно-следственных связей; может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся; – творческого уровня, позволяющие оценивать и диагностировать умения, интегрировать знания различных областей, аргументировать собственную точку зрения; может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Комплект разноуровневых задач и заданий или комплекты задач и заданий определенного уровня

### Промежуточная аттестация

№	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в ФОС
1	Зачет	Средство, позволяющее оценить знания, умения, навыков и (или) опыта деятельности обучающегося по дисциплине. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Перечень теоретических вопросов и практических заданий к зачету
2	Тест – промежуточная аттестация в форме зачета	Система автоматизированного контроля освоения компетенций (части компетенций) обучающимся по дисциплине (модулю) с использованием информационно-коммуникационных технологий. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Фонд тестовых заданий

**Критерии и шкалы оценивания компетенций в результате изучения дисциплины при проведении промежуточной аттестации в форме зачета. Шкала оценивания уровня освоения компетенций**

Шкала оценивания	Критерии оценивания	Уровень освоения компетенции
«зачтено»	Обучающийся правильно ответил на теоретические вопросы. Показал отличные знания в рамках учебного материала. Правильно выполнил практические задания. Показал отличные умения и владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Ответил на все дополнительные вопросы	Высокий
	Обучающийся с небольшими неточностями ответил на теоретические вопросы. Показал хорошие знания в рамках учебного материала. С небольшими неточностями выполнил практические задания. Показал хорошие умения и владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Ответил на большинство дополнительных вопросов	Базовый
	Обучающийся с существенными неточностями ответил на теоретические вопросы. Показал удовлетворительные знания в рамках учебного материала. С существенными неточностями выполнил практические задания. Показал удовлетворительные умения и владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Допустил много неточностей при ответе на дополнительные вопросы	Минимальный
«не зачтено»	Обучающийся при ответе на теоретические вопросы и при выполнении практических заданий продемонстрировал недостаточный уровень знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. При ответах на дополнительные вопросы было допущено множество неправильных ответов	Компетенция не сформирована

**Тест – промежуточная аттестация в форме зачета**

Шкала оценивания	Критерии оценивания
«зачтено»	Обучающийся верно ответил на 70 % и более тестовых заданий при прохождении тестирования
«не зачтено»	Обучающийся верно ответил на 69 % и менее тестовых заданий при прохождении тестирования

**Критерии и шкалы оценивания результатов обучения при проведении текущего контроля успеваемости**

**Контрольная работа**

Шкалы оценивания	Критерии оценивания
«отлично»	«зачтено»
«хорошо»	
«удовлетворительно»	

Обучающийся полностью и правильно выполнил задание контрольной работы. Показал отличные знания и умения в рамках усвоенного учебного материала. Контрольная работа оформлена аккуратно и в соответствии с предъявляемыми требованиями

Обучающийся выполнил задание контрольной работы с небольшими неточностями. Показал хорошие знания и умения в рамках усвоенного учебного материала. Есть недостатки в оформлении контрольной работы

Обучающийся выполнил задание контрольной работы с существенными неточностями. Показал удовлетворительные знания и умения в рамках усвоенного учебного материала.

		Качество оформления контрольной работы имеет недостаточный уровень
«неудовлетворительно»	«не зачтено»	Обучающийся не полностью выполнил задания контрольной работы, при этом проявил недостаточный уровень знаний и умений

### Собеседование

Шкалы оценивания		Критерии оценивания
«отлично»	«зачтено»	Глубокое и прочное усвоение программного материала. Полные, последовательные, грамотные и логически излагаемые ответы при видоизменении задания. Обучающийся свободно справляется с поставленными задачами, может обосновать принятые решения, демонстрирует владение разносторонними навыками и приемами выполнения практических работ
«хорошо»		Знание программного материала, грамотное изложение, без существенных неточностей в ответе на вопрос, правильное применение теоретических знаний, владение необходимыми навыками при выполнении практических задач
«удовлетворительно»		Обучающийся демонстрирует усвоение основного материала, при ответе допускаются неточности, при ответе недостаточно правильные формулировки, нарушение последовательности в изложении программного материала, затруднения в выполнении практических заданий Слабое знание программного материала, при ответе возникают ошибки, затруднения при выполнении практических работ
«неудовлетворительно»	«не зачтено»	Не было попытки выполнить задание

### Ситуационная задача

Шкалы оценивания		Критерии оценивания
«отлично»	«зачтено»	Обучающийся излагает материал логично, грамотно, без ошибок; свободно владеет профессиональной терминологией; умеет высказывать и обосновать свои суждения; дает четкий, полный, правильный ответ на теоретические вопросы; организует связь теории с практикой
«хорошо»		Обучающийся грамотно излагает материал; ориентируется в материале; владеет профессиональной терминологией; осознанно применяет теоретические знания для решения кейса, но содержание и форма ответа имеют отдельные неточности. Ответ обучающегося правильный, полный, с незначительными неточностями или недостаточно полный
«удовлетворительно»		Обучающийся излагает материал неполно, непоследовательно, допускает неточности в определении понятий, в применении знаний для решения кейса, не может доказательно обосновать свои суждения; обнаруживается недостаточно глубокое понимание изученного материала
«неудовлетворительно»	«не зачтено»	У обучающегося отсутствуют необходимые теоретические знания; допущены ошибки в определении понятий, искажен их смысл, не решен кейс. В ответе обучающийся проявляется незнание основного материала учебной программы, допускаются грубые ошибки в изложении, не может применять знания для решения кейса

### Разноуровневые задачи (задания)

Шкалы оценивания		Критерии оценивания
«отлично»	«зачтено»	Демонстрирует очень высокий/высокий уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Все требования, предъявляемые к заданию, выполнены
«хорошо»		Демонстрирует достаточно высокий/выше среднего уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Все требования, предъявляемые к заданию, выполнены
«удовлетворительно»		Демонстрирует средний уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Большинство требований, предъявляемых к заданию, выполнены.

		Демонстрирует низкий/ниже среднего уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Многие требования, предъявляемые к заданию, не выполнены
«неудовлетворительно»	«не зачтено»	Демонстрирует очень низкий уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Не ответа.

### **3. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности**

#### **3.1 Типовые контрольные задания для выполнения контрольных работ**

Контрольные варианты заданий выложены в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.

Ниже приведен образец типовых вариантов заданий для выполнения контрольных работ.

Образец типового варианта контрольной работы

Тема «Финансовые инструменты»

1. Дать определения: финансовый инструмент, дилер, косвенное финансирование, производные ценные бумаги
2. Приведите классификацию финансовых рынков по временному и институциональному критерию
3. Дать определение: арбитражеры, хеджеры
4. Виды спекулянтов в зависимости от спекулятивной техники
5. Функции финансовых рынков, способы уменьшения транзакционных издержек посредниками
6. Виды дохода
7. Среднерыночная доходность = 7,3%, доходность безрискового актива 4,8%. Есть данные по 4-ём акциям: Найти коэффициент  $\beta$  для каждого вида акций.

#### **3.2 Типовые контрольные задания для проведения собеседования**

Контрольные варианты заданий выложены в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.

Ниже приведен образец типовых вариантов заданий для проведения собеседований.

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования

«Сущность и функции финансового рынка. Инфраструктура финансовых рынков»

1. Экономическое содержание финансовых рынков.
2. Функции финансовых рынков.
3. Структура финансовых рынков.
4. Классификация финансовых рынков.
5. Модели финансовых рынков.
6. Основные мировые тенденции развития финансовых рынков.
7. История развития финансовых рынков в России.

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования

«Сегменты финансовых рынков»

1. Понятие сегментов финансовых рынков.
2. Кредитный рынок.
3. Валютный рынок.
4. Рынок ценных бумаг.
5. Рынок производных финансовых инструментов.
6. Рынок драгоценных металлов.
7. Страховой рынок.

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования  
«Риск и доход на финансовых рынках»

1. Финансовые риски
2. Снижение деловых и финансовых рисков
3. Рыночные риски
4. Процентный риск
5. Инфляционный риск (риск снижения покупательной способности)
6. Связь между рисками и доходностью

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования  
«Регулирование финансового рынка»

1. Понятие, цели, задачи финансового регулирования.
2. Виды финансового регулирования.
3. Государственное регулирование финансовых рынков и саморегулирование финансовых рынков.
4. Модели финансового регулирования.
5. Действующая система финансового регулирования в России.

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования  
«Понятие, сущность и функции производных финансовых инструментов»

1. Понятие и свойства производных финансовых инструментов
2. Характеристика операции хеджирования, спекуляции, арбитража с использованием производных финансовых инструментов
3. Истории становления срочного рынка в мире, особенностях формирования и развития срочного рынка в России

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования  
«Формы и инструменты международных расчетов.»

1. Понятие и формы международных расчетов
2. Денежные формы расчетов
3. Особенности организации международных расчетов операций

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования  
«Биржевой и внебиржевой рынок»

1. Особенности организации и ведения биржевой торговли производными финансовыми и товарными продуктами-инструментами
2. Характеристика биржевого и внебиржевого рынков производных: по набору типов инструментов, структурам, объемам операций на этих рынках
3. Соотношение (по удельным весам) финансовых инструментов с различными базисными ценностями на биржевом рынке.
4. Биржевая статистика

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования  
«Методы оценки рисков производных финансовых инструментов»

1. Количественные методы оценки рыночного риска
2. Метод Монте-Карло
3. Альтернативные количественные показатели рыночного риска
4. Метод VaR

### **3.3 Типовые контрольные задания для решения ситуационной задачи**

Контрольные варианты заданий выложены в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.

Ниже приведен образец типовых вариантов заданий для решения ситуационных задач.



#### Образец типового варианта ситуационной задачи

##### «Сущность и функции финансового рынка. Инфраструктура финансовых рынков»

1. Создается 3 группы, которые на время обсуждения являются представителями определенного этапа развития финансового рынка. Задачей каждой группы представление своего периода развития российского финансовых рынков по следующим критериям: общая характеристика, субъекты, объекты, механизмы торговли, достижения, слабые стороны. «Представители» других групп имеют право задавать вопросы и уточнять интересующие аспекты.

#### Образец типового варианта ситуационной задачи

##### «Регулирование финансового рынка»

1. Создается 3 группы, которые на время обсуждения являются представителями традиционной модели, модели единого регулятора, модели двух регуляторов. Задачей каждой группы является убедить оппонентов в справедливости основных положений своей модели. «Представители» других моделей имеют право задавать вопросы и уточнять интересующие аспекты.

### **3.4 Типовые контрольные задания для решения разноуровневых задач (заданий)**

Контрольные варианты заданий выложены в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.

Ниже приведен образец типовых вариантов заданий для решения разноуровневых задач.

#### Образец заданий для решения разноуровневых задач

##### «Риск и доход на финансовых рынках»

1. Имеются два варианта вложения капитала. Установлено, что при вложении капитала в мероприятие А получение прибыли в сумме 15 млн р. имеет вероятность 0,6, а в мероприятие В получение прибыли в сумме 20 млн р. – вероятность 0,4. Определите ожидаемое получение прибыли от вложения капитала (математическое ожидание) и рассмотрите вероятность наступления события объективным и субъективным методами.

2. Если предприниматель стоит перед выбором, сколько ему закупить товара: 100 или 200 единиц. При закупке 100 единиц товара затраты составят 120 тыс. р. за единицу, а при закупке 200 единиц – 100 тыс. р. за единицу. Предприниматель данный товар будет продавать по 180 тыс. р. за единицу. Однако он не знает, будет ли спрос на него. Весь не проданный в срок товар может быть реализован только по цене 90 тыс. р. и менее. При продаже товара вероятность составляет «50 на 50», т.е. существует вероятность 0,5 для продажи 100 единиц товара и 0,5 для продажи 200 единиц товара.

#### Образец заданий для решения разноуровневых задач

##### «Формы и инструменты международных расчетов.»

1. Рассматриваются два варианта поставок оборудования в Россию: а) сумма кредита 500 тыс. евро, процентная ставка 12% годовых; использование равными долями, в течение трех лет; погашение 10 равными полугодовыми взносами, начиная через 6 месяцев последнего использования; б) сумма кредита 500 тыс. евро; процентная ставка – 10% годовых; использование – равномерно в течение трех лет, погашение 13 равными полугодовыми взносами, начиная через 6 мес. после последнего использования. Определите стоимость кредита по каждому варианту и определите, какой вариант выгоднее для российской стороны, если рыночная процентная ставка – 14%.

2. Торговая компания получила кредит на общую сумму 500 тыс. USD. В соответствии с условиями кредитного соглашения использование кредита осуществляется равными суммами по 100 тыс. USD через каждые 3 месяца, начиная с 1 января 2005 г. Погашение кредита осуществляется пятью равными ежеквартальными взносами, начиная 21 с 1 июля 2007 г. Определить полный срок кредита, льготный период и грант-элемент

### 3.5 Типовые контрольные задания для проведения тестирования

Фонд тестовых заданий по дисциплине содержит тестовые задания, распределенные по разделам и темам, с указанием их количества и типа.

#### Структура фонда тестовых заданий по дисциплине

Индикатор достижения компетенции	Тема в соответствии с РПД	Характеристика ТЗ	Количество тестовых заданий, типы ТЗ
ПК-4.3 ПК-4.4	Сущность и функции финансового рынка. Инфраструктура финансовых рынков	Знание	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-4.3 ПК-4.4	Финансовые институты	Знание	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-4.3 ПК-4.4	Риск и доход на финансовых рынках	Знание	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-4.3 ПК-4.4	Регулирование финансового рынка	Знание	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-4.3 ПК-4.4	Понятие, сущность и функции производных финансовых инструментов	Знание	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-4.3 ПК-4.4	Формы и инструменты международных расчетов.	Знание	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-4.3 ПК-4.4	Биржевой и внебиржевой рынок	Знание	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-4.3 ПК-4.4	Методы оценки рисков производных финансовых инструментов	Знание	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ

		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	2 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Итого	48 – ОТЗ 48 – ЗТЗ

Полный комплект ФТЗ хранится в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС и обучающийся имеет возможность ознакомиться с демонстрационным вариантом ФТЗ.

Ниже приведен образец типового варианта итогового теста, предусмотренного рабочей программой дисциплины.

**1. Размещение эмиссионных ценных бумаг для продажи публике через посредника:**

- а) *андеррайтинг*
- б) эмиссия
- в) биржевая спекуляция

**2. Сумма всех тарифных ставок комиссионных сборов за брокерскую деятельность, деленная на число ставок:**

- а) рыночная капитализация
- б) *индекс брокерской комиссии*
- в) сумма сделки

**3. Ликвидность портфеля означает возможность его превращения в денежную наличность без потери стоимости, так ли это:**

- а) нет
- б) отчасти
- в) *да*

**4. Оперативный лизинг подразумевает лизинговые контракты, заключаемые на короткий и средний срок, согласно которым арендатору предоставляется право в любое другое время расторгнуть договор, так ли это:**

- а) нет
- б) *да*
- в) отчасти

**5. Деятельность, осуществляемая регистраторами, осуществляющими сбор, фиксацию, обработку, хранение и предоставление информации, составляющей систему ведения реестра, – это деятельность:**

- а) депозитарная
- б) по организации торговли на рынке ценных бумаг
- в) *по ведению реестра владельцев ценных бумаг*

**6. Участник срочного рынка, цель которого – получение прибыли за счет одновременной покупки и продажи одного и того же актива на разных рынках, если на них наблюдается разная динамика цен:**

- а) спекулянт
- б) хеджер
- в) *арбитражер*

**7. При обратной котировке (например, в Великобритании при курсе 1,9 USD/GBR, или 1 фунт = 1,9 долл.) при снижении курса национальная валюта дешевеет или дорожает?**

**8. Курс доллара к евро – 1,23 долл./EUR. При снижении курса до уровня 1,20 \$/EUR доллар дешевеет или дорожает?**

**9. Допустим, что ставка по долларовым депозитам в США (до кризиса) 1,5%, а в Германии по депозитам в евро – 2%. Курс доллара к евро за год вырос на 5%. В этом случае депозит в евро менее выгоден, чем депозит в долларах. Чистая выгода от валютно-депозитной операции в USD составит:  $2\% - (1,5\% + 5\%) = 4,5\%$ . При росте курса доллара на 0,5% возникает паритет процентных ставок в США и Германии. Объясните, где в этом случае выгодно размещать валютные депозиты?**

**10. Необходимо соотнести понятия, данные в левой части таблицы, с признаками (свойствами), которые указаны в правой части таблицы.**

Понятие		Признаки	
1	Международные валютные отношения	А	это целевые операции Центробанка страны по купле продаже иностранной валюты для ограничения динамики курса национальной валюты определенными пределами его повышения или понижения
2	Валютная интервенция	Б	это совокупность общественных отношений, складывающихся при функционировании валюты в мировом хозяйстве и обслуживающих взаимный обмен результатами деятельности национальных хозяйств
3	Международная валютная ликвидность	В	является особой категорией конвертируемой валюты. Она выполняет функции международного платежного и резервного средства, служит базой определения валютного паритета и валютного курса для других стран
4	Международная резервная валюта	Г	способность страны (или группы стран) обеспечивать своевременное погашение своих международных обязательств приемлемыми для кредитора платежными средствами.

**11. Вексель — это право купить или продать собственность по установленной цене, называемой ценой исполнения, которое предоставляется в обмен на уплату определенной согласованной суммы денег, так ли это:**

- а) да
- б) *нет*
- в) отчасти

**12. Инвестиции портфельные – это вложение средств в акции, облигации и другие ценные бумаги долгосрочного характера с целью получения прибыли, так ли это:**

- а) нет
- б) *да*
- в) отчасти

**13. Диверсификация вложений – это основной принцип портфельного инвестирования, суть которого в том, что нельзя вкладывать все средства только в одну бумагу, даже самую привлекательную, так ли это:**

- а) *да*
- б) нет
- в) отчасти

**14. Совокупность организаций различных форм собственности, главная цель деятельности которых – осуществление финансовых отношений в обществе:**

- а) финансовые сферы
- б) финансовые инструменты
- в) *финансовые институты*

**15. Основные операторы на финансовом рынке, предметом деятельности которых является привлечение свободных денежных средств и их использование на финансирование, кредитование и другие операции с применением разнообразных финансовых инструментов:**

- а) институт финансов
- б) *финансовые институты*
- в) *финансовые схемы*

**16. Одним из основных финансовых институтов является:**

- а) финансовая пирамида
- б) магазин
- в) *банк*

**17. Одними из основных финансовых институтов является:**

- а) денежный перевод
- б) *страховые компании*
- в) интернет-магазин

**18. Одними из основных финансовых институтов является:**

- а) *пенсионные фонды*
- б) магазин
- в) финансовая пирамида

### **3.6 Перечень теоретических вопросов к зачету** (для оценки знаний)

1. Экономическое содержание финансовых рынков
2. Функции финансовых рынков.
3. Структура финансовых рынков.
4. Классификация финансовых рынков.
5. Модели финансовых рынков.
6. Основные мировые тенденции развития финансовых рынков.
7. История развития финансовых рынков в России.
8. Понятие инструментов финансовых рынков.
9. Экономическая характеристика инструментов финансовых рынков.
10. Классификация инструментов финансовых рынков.
11. Первичные финансовые инструменты.
12. Ценные бумаги.
13. Денежные инструменты.
14. Производные финансовые инструменты.
15. Участники финансовых рынков и виды их деятельности.
16. Эмитенты как потребители капитала.
17. Инвесторы как поставщики капитала.
18. Финансовые посредники как участники финансовых рынков.
19. Виды финансовых посредников.
20. Депозитные финансовые организации.
21. Недепозитные финансовые организации.
22. Профессиональные участники рынка ценных бумаг.
23. Иные виды посредников на финансовых рынках.
24. Понятие, цели, задачи финансового регулирования.
25. Виды финансового регулирования.
26. Государственное регулирование финансовых рынков
27. Саморегулирование финансовых рынков.
28. Модели финансового регулирования.
29. Действующая система финансового регулирования в России.
30. Понятие сегментов финансовых рынков.
31. Кредитный рынок
32. Валютный рынок.
33. Рынок ценных бумаг.
34. Рынок производных финансовых инструментов.
35. Рынок драгоценных металлов.
36. Страховой рынок.
37. Понятие операций на финансовых рынках.
38. Классификация операций и сделок с финансовыми инструментами:
39. Основные положения фундаментального анализа.
40. Основные положения технического анализа.

### 3.7 Перечень типовых простых практических заданий к зачету

(для оценки умений)

1. В стране обращается 1000ед. национальной валюты. Курс американского доллара, выраженный в валюте данной страны равен 5. Какое количество долларов должен иметь валютный центр данной страны, при режиме валютного управления.

2. Страна получает ежегодно платежи по международному кредиту в 100 ден. ед. в течении 10 лет. По условиям договора выплачивает 20% ежегодно за всю сумму полученного кредита. В каком соотношении будет находиться ежегодно получаемый кредит и сумма, выплачиваемых процентов через 5 лет?

3. Заключен форвардный контракт, в котором зафиксирован курс валюты равный 100 единицам валюты Б на срок 3 месяца. В момент валютирования рыночный курс валюты А стал равным 60 валюты Б. Кто – продавец или покупатель на этом контракте и на какую сумму?

### 3.8 Перечень типовых практических заданий к зачету

(для оценки навыков и (или) опыта деятельности)

1. Лицо, формирующее рынок, дает следующие котировки:

STG 1, 5575/85

YEN 129, 25/40

А) При каком курсе лицо, формирующее рынок. Продаст клиенту фунты стерлинги за доллары?

Б) При каком курсе клиент может/буде продавать фунты стерлинги лицу, формирующему рынок?

В) При каком курсе клиент банка покупает иены?

2. Австралийский винодел экспортирует вино в Англию. Предположим:

GBR/USD 1, 8750

ASD/USD 0, 8250

Рассчитать кросс-курс, если доллар является валютой котировки для обеих валют.

3. Немецкий импортер должен заплатить поставщику из Гонконга. Рынок марка/доллар не является активным. В банк поступят немецкие марки от клиента, и банк обменяет их на доллары США. Затем продаст доллары США в обмен на доллары Гонконга, и зачислит их на счет своему клиенту

Каковы будут соответствующие курсы по этой двойной банковской операции, если доллар США является базой котировки для обеих валют, и если:

USD/DEM 1, 5750; USD/HK \$ 7, 7595?

#### **4. Методические материалы, определяющие процедуру оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности**

В таблице приведены описания процедур проведения контрольно-оценочных мероприятий и процедур оценивания результатов обучения с помощью оценочных средств в соответствии с рабочей программой дисциплины.

Наименование оценочного средства	Описания процедуры проведения контрольно-оценочного мероприятия и процедуры оценивания результатов обучения
Контрольная работа	Преподаватель на установочном занятии доводит до обучающихся: темы, количество заданий в контрольной работе. Контрольная работа должна быть выполнена в установленный срок и в соответствии с правилами оформления (текстовой и графической частей), сформулированными в Положении «Требования к оформлению текстовой и графической документации. Нормоконтроль» в последней редакции. Выполненная контрольная работа передается для проверки преподавателю в установленные сроки. Если контрольная работа выполнена не в соответствии с указаниями или не в полном объеме, она возвращается на доработку
Собеседование	Собеседование, предусмотренное рабочей программой дисциплины, проводится на практическом занятии. Преподаватель на практическом занятии, предшествующем занятию проведения контроля, доводит до обучающихся тему, вопросы для подготовки к собеседованию. Результаты собеседования преподаватель доводит до обучающихся сразу после завершения собеседования
Ситуационная задача	Преподаватель не менее, чем за неделю до срока решения ситуационных задач должен довести до сведения обучающихся предлагаемые ситуационные задачи. Решенные ситуационные задачи в назначенный срок сдаются на проверку преподавателю
Разноуровневая задача (задание)	Выполнение разноуровневых задач (заданий), предусмотренных рабочей программой дисциплины, проводятся во время практических занятий. Во время выполнения задач (заданий) разрешается пользоваться учебниками, справочниками, конспектами лекций, тетрадями для практических занятий

Для организации и проведения промежуточной аттестации составляются 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.

Перечень теоретических вопросов и типовые практические задания разного уровня сложности для проведения промежуточной аттестации обучающиеся получают в начале семестра через электронную информационно-образовательную среду ИрГУПС (личный кабинет обучающегося).

#### **Описание процедур проведения промежуточной аттестации в форме зачета и оценивания результатов обучения**

При проведении промежуточной аттестации в форме зачета преподаватель может воспользоваться результатами текущего контроля успеваемости в течение семестра. С целью использования результатов текущего контроля успеваемости, преподаватель подсчитывает среднюю оценку уровня сформированности компетенций обучающегося (сумма оценок, полученных обучающимся, делится на число оценок).

#### **Шкала и критерии оценивания уровня сформированности компетенций в результате изучения дисциплины при проведении промежуточной аттестации в форме зачета по результатам текущего контроля (без дополнительного аттестационного испытания)**

Средняя оценка уровня сформированности компетенций по результатам текущего контроля	Шкала оценивания
Оценка не менее 3,0 и нет ни одной неудовлетворительной оценки по текущему контролю	«зачтено»

Оценка менее 3,0 или получена хотя бы одна неудовлетворительная оценка по текущему контролю	«не зачтено»
---	--------------

Если оценка уровня сформированности компетенций обучающегося не соответствует критериям получения зачета без дополнительного аттестационного испытания, то промежуточная аттестация проводится в форме собеседования по перечню теоретических вопросов и типовых практических задач или в форме компьютерного тестирования.

Промежуточная аттестация в форме зачета с проведением аттестационного испытания проходит на последнем занятии по дисциплине.

При проведении промежуточной аттестации в форме компьютерного тестирования вариант тестового задания формируется из фонда тестовых заданий по дисциплине случайным образом, но с условием: 50 % заданий должны быть заданиями открытого типа и 50 % заданий – закрытого типа.