Приложение 1

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

Дисциплины Б1.В.01 «Рынок ценных бумаг»

Специальность 38.05.01 «Экономическая безопасность»

Специализация «Экономическая безопасность и экспертиза деятельности хозяйствующих субъектов»

Квалификация выпускника экономист

ПАСПОРТ ФОНДА ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

дисциплины Б1.В.01 «Рынок ценных бумаг»

№ п/п	Контролируемые разделы (модули) дисциплины	Код индикатора достижения компетенций	Наименование оценочного средства и иных материалов	Кол-во
1	В целом	УК-10.1, УК-10.2, УК-10.3, ПК-1.1	Описание показателей и критериев оценивания сформированности компетенций, описание шкал оценивания	4
2			Типовые контрольные задания и иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения дисциплины	2
3			Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций	3

1 ОПИСАНИЕ ПОКАЗАТЕЛЕЙ И КРИТЕРИЕВ ОЦЕНИВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ, ОПИСАНИЕ ШКАЛ ОЦЕНИВАНИЯ

1.1 Описание шкалы оценивания сформированности компетенций

Сформированность компетенций по дисциплине оцениваются двумя оценками: «зачтено», «не зачтено».

1.2 Описание показателей и критериев оценивания сформированности компетенций по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов освоения образовательной программы

Код компетенции (индикатора достижения компетенции)	Результат обучения по дисциплине	Критерии и показатели оценивания результатов обучения	
		«не зачтено»	«зачтено»
1	**2**	**3**	**4**
УК-10 (УК-10.1, УК-10.2, УК-10.3)	Знать понятие, классификацию и функции рынка ценных бумаг, основные его структурные элементы и механизм функционирования, виды ценных бумаг; законодательные документы регламентирующие деятельность на рынке ценных бумаг; критерии оценки экономической эффективности инвестиций; методы оценки показателей стоимости и доходности по основным видам ценных бумаг.	Фрагментарные знания понятия, классификации и функций рынка ценных бумаг, основных его структурных элементов и механизмов функционирования, видов ценных бумаг; законодательных документов регламентирующих деятельность на рынке ценных бумаг; критериев оценки экономической эффективности инвестиций; методов оценки показателей стоимости и доходности по основным видам ценных бумаг / Отсутствие знаний	Сформированные или неполные знания понятия, классификации и функций рынка ценных бумаг, основных его структурных элементов и механизмов функционирования, видов ценных бумаг; законодательных документов регламентирующих деятельность на рынке ценных бумаг; критериев оценки экономической эффективности инвестиций; методов оценки показателей стоимости и доходности по основным видам ценных бумаг

1	2	3	4
УК-10 (УК-10.1, УК-10.2, УК-10.3)	Уметь применять понятийно-категориальный аппарат рынка ценных бумаг и законодательные документы, регламентирующие его деятельность; оценивать экономическую эффективность инвестиций; проводить расчет, анализ и оценку стоимости и доходности по основным видам ценных бумаг.	Фрагментарное умение применять понятийно-категориальный аппарат рынка ценных бумаг и законодательные документы, регламентирующие его деятельность; оценивать экономическую эффективность инвестиций; проводить расчет, анализ и оценку стоимости и доходности по основным видам ценных бумаг. / Отсутствие умений	В целом успешное умение применять понятийно-категориальный аппарат рынка ценных бумаг и законодательные документы, регламентирующие его деятельность; оценивать экономическую эффективность инвестиций; проводить расчет, анализ и оценку стоимости и доходности по основным видам ценных бумаг.
	Владеть теоритическими и практическими навыками в сфере механизма функционирования рынка ценных бумаг; навыками принятия обоснованных экономических решений при инвестировании в ценные бумаги на основе проведенного анализа.	Фрагментарное применение теоритических и практических навыков в сфере механизма функционирования рынка ценных бумаг; навыков принятия обоснованных экономических решений при инвестировании в ценные бумаги на основе проведенного анализа. / Отсутствие навыков	В целом успешное применение теоритических и практических навыков в сфере механизма функционирования рынка ценных бумаг; навыков принятия обоснованных экономических решений при инвестировании в ценные бумаги на основе проведенного анализа.
ПК-1 (ПК-1.1)	Знать понятие и классификацию рисков на рыке ценных бумаг, принципы управления рисками; методы оценки и стратегии управления рисками на рынке ценных бумаг.	Фрагментарные знания понятия и классификации рисков на рыке ценных бумаг, принципов управления рисками; методов оценки и стратегий управления рисками на рынке ценных бумаг./ Отсутствие знаний	Сформированные или неполные знания понятия и классификации рисков на рыке ценных бумаг, принципов управления рисками; методов оценки и стратегий управления рисками на рынке ценных бумаг
	Уметь применять понятийно-категориальный аппарат в области оценки рисков; проводить анализ и оценку рисков на рынке ценных бумаг для управления инвестициями.	Фрагментарное умение применять понятийно-категориальный аппарат в области оценки рисков; проводить анализ и оценку рисков на рынке ценных бумаг для управления инвестициями.. / Отсутствие умений	В целом успешное умение применять понятийно-категориальный аппарат в области оценки рисков; проводить анализ и оценку рисков на рынке ценных бумаг для управления инвестициями.

1	2	3	4
ПК-1 (ПК-1.1)	Владеть навыками проведения экономического анализа и оценки рисков с целью снижения их влияния на инвестиции в ценные бумаги.	Фрагментарное применение навыков проведения экономического анализа и оценки рисков с целью снижения их влияния на инвестиции в ценные бумаги.. / Отсутствие навыков	В целом успешное применение навыков проведения экономического анализа и оценки рисков с целью снижения их влияния на инвестиции в ценные бумаги.

1.3 Описание шкалы оценивания освоения дисциплины в форме зачета

Знания, умения, навыки обучающегося по дисциплине оцениваются оценками: «зачтено», «не зачтено».

1.4 Описание показателей и критериев оценивания компетенций дисциплины в форме зачета

Оценка	Критерии
Зачтено	выполнен установленный по дисциплине объем самостоятельных работ, в процессе обучения или в ходе собеседования (при необходимости) продемонстрированы достаточно твердые знания материала, умения и навыки их использования при решении конкретных задач, показана сформированность соответствующих компетенций, проявлено понимание сущности и взаимосвязи рассматриваемых процессов и явлений, даны правильные, полные ответы на большинство вопросов; нет грубых ошибок, при ответах на отдельные вопросы могут быть допущены отдельные неточности
Не зачтено	не выполнен установленный по дисциплине объем самостоятельных работ, соответствующие компетенции не сформированы полностью или частично, в ходе собеседования не дано ответа, или даны неправильные ответы на большинство вопросов, продемонстрировано непонимание сущности предложенных вопросов, допущены грубые ошибки при ответе на вопросы

2 ТИПОВЫЕ КОНТРОЛЬНЫЕ ЗАДАНИЯ И ИНЫЕ МАТЕРИАЛЫ, НЕОБХОДИМЫЕ ДЛЯ ОЦЕНКИ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ, НАВЫКОВ И ОПЫТА ДЕЯТЕЛЬНОСТИ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ В ПРОЦЕССЕ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

2.1 Вопросы к зачету

№ вопроса	Содержание раздела в дидактических единицах	Коды индикаторов достижения компетенций
1	2	3
1	Понятие РЦБ.	УК-10.1
2	Функции РЦБ.	
3	Виды ЦБ.	
4	Участники РЦБ.	
5	Профессиональные участники, занимающиеся торговлей на РЦБ (брокеры, дилеры, доверительные управляющие).	
6	Клиринговая и депозитарная деятельность.	
7	Деятельность по ведению реестра владельцев ЦБ.	
8	Организаторы торговли на РЦБ.	
9	Размещение ЦБ.	УК-10.1, УК-10.2
10	Этапы процесса эмиссии (принятия решения о размещении, утверждение документа «Решение о выпуске эмиссионных ЦБ», государственная регистрация эмиссионных ЦБ).	
11	Этапы процесса эмиссии (размещение ЦБ, отчет об итогах выпуска эмиссионных ЦБ).	
12	Недобросовестная эмиссия.	
13	Деятельность по организации торговли на рынке ценных бумаг и внебиржевая торговля ценными бумагами.	УК-10.1, УК-10.2
14	Крупнейшие фондовые биржи.	УК-10.1
15	Биржевые индексы.	УК-10.1, УК-10.3
16	Виды сделок на рынке ценных бумаг.	УК-10.1
17	Понятие акций. Основные виды акций.	
18	Размещение акций.	УК-10.1, УК-10.2
19	Дивиденды по акциям.	УК-10.1, УК-10.3
20	Виды стоимости и доходности акций.	
21	Понятие облигации. Виды облигаций.	УК-10.1
22	Выплата дохода по облигациям.	УК-10.1, УК-10.3
23	Определение доходности облигаций (показатели дисконтной и купонной облигации).	
24	Основные виды государственных ЦБ в РФ и их особенности.	УК-10.1
25	Муниципальные облигации.	
26	Оценка доходности государственных ЦБ.	УК-10.1, УК-10.3
27	Сберегательные и депозитные сертификаты.	
28	Чеки. Разновидности чеков.	УК-10.1
29	Регулирование РЦБ и структура регулирующих органов.	УК-10.1, УК-10.2, УК-10.3
30	Роль Банка России, Министерства финансов России, Центрального банка РФ по регулированию рынка ценных бумаг.	

1	2	3
31	Саморегулируемые организации.	УК-10.1
32	Система раскрытия информации.	УК-10.1, УК-10.2
33	Раскрытие информации на этапах эмиссии ценных бумаг.	
34	Виды раскрываемой информации на рынке ценных бумаг.	
35	Понятие и классификация рисков на РЦБ.	ПК-1.1
36	Принципы управления риском.	
37	Метод оценки риска с помощью его стоимостного выражения (метод Value at Risk).	
38	Стратегии по снижению риска на фондовом рынке.	
39	Страхование как метод управления рисками.	
40	Управление инвестициями в ценные бумаги.	УК-10.1, УК-10.2
41	Виды инвестиционных стратегий.	
42	Портфельное инвестирование (охарактеризовать стратегии «купил и держи», стратегию индексного фонда, аукционные стратегии).	
43	Портфельное инвестирование (охарактеризовать стратегии спекулятивного конкурсанта, арбитражную стратегию, стратегию «пылесоса»).	
44	Портфельное инвестирование (охарактеризовать рейтинговую стратегию, стратегию «гибкого реагирования», стратегию «рыночного опережения»).	
45	Стратегии краткосрочных, среднесрочных и долгосрочных инвестиций (пояснить стратегию «скальпирование»).	

2.2 Примерные варианты практических задач

1. Инвестор купил 100 акций компании «А» по рыночной стоимости 30 у.е. Через год курс этих акций повысился на 15%. Инвестор продал весь пакет акций и все полученные средства вложил в покупку акций «Б» по курсу 7 у.е. Сколько акций купил инвестор с учетом налогообложения?

2. Под вексель поставлен товар стоимостью 2 млн у.е. Ставка коммерческого кредита установлена в размере 20% годовых. Рассчитайте сумму дисконтного векселя, если срок действия векселя 4 месяца.

3. Определить ориентировочную рыночную стоимость дисконтной облигации номиналом 1000 у.е., выпущенной на срок 184 дня, при условии, что рыночная ставка составляет 15% годовых.

4. Номинальная стоимость акции ОАО «Х» составляет 50 у.е. Определите ориентировочную курсовую стоимость акции на рынке ценных бумаг, если известно, что размер дивиденда ожидается на уровне 25%, а размер банковской ставки составляет 10%?

5. Облигация федерального займа с постоянным купонным доходом была приобретена юридическим лицом за 67 дней до своего погашения по цене 101% (с учетом накопленного купонного дохода). Длительность последнего купонного периода составляет 94 дня. Размер купона 17% годовых. Определите сумму налогов, которую заплатит инвестор (юридическое лицо) при погашении.

3 МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИЕ ПРОЦЕДУРЫ ОЦЕНИВАНИЯ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ, НАВЫКОВ И ОПЫТА ДЕЯТЕЛЬНОСТИ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ

1. Положение о текущем контроле и промежуточной аттестации обучающихся, осваивающих образовательные программы высшего образования – программы бакалавриата, программы специалитета, программы магистратуры СМК-П-02.01-04-21 / разраб. Т.А. Лашина. – Зерноград: Азово-Черноморский инженерный институт ФГБОУ ВО Донской ГАУ, 2021. – 15 с.
2. Положение о проведении текущего контроля и промежуточной аттестации обучающихся с применением электронного обучения, дистанционных образовательных технологий в условиях усиления санитарно-эпидемиологических мероприятий. СМК-П-02.01-01-20 / разраб. Т.А. Лашина. – Зерноград: Азово-Черноморский инженерный институт ФГБОУ ВО Донской ГАУ, 2020. – 8 с.
3. Рабочая программа дисциплины Б1.В.01 «Рынок ценных бумаг» / разраб. А.С. Панасюк. – Зерноград: Азово-Черноморский инженерный институт ФГБОУ ВО Донской ГАУ, 2022. – 51 с.