

МИНОБРНАУКИ РОССИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Волгоградский государственный социально-педагогический университет»
Факультет управления и экономико-технологического образования
Кафедра менеджмента и экономики образования

*Приложение к программе
учебной дисциплины*

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

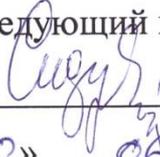
для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации студентов
по дисциплине «**Рынок ценных бумаг**»

Направление 44.03.01 «Педагогическое образование»

Профиль «Экономика»

очная форма обучения

Заведующий кафедрой

 | Сигурова Г.И.
«30» 06 2016 г.

Волгоград
2016

1. ПАСПОРТ ФОНДА ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

1.1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

Процесс освоения дисциплины направлен на овладение следующими компетенциями:

– готовностью использовать систематизированные теоретические и практические знания в области экономики для осуществления профессиональной деятельности (СК-1).

Этапы формирования компетенций в процессе освоения ОПОП

Код компетенции	Этап базовой подготовки	Этап расширения и углубления подготовки	Этап профессионально-практической подготовки
СК-1		Бухгалтерский учет, Внешнеэкономическая деятельность, Государственное регулирование экономики, Инвестиции, Инвестиционный анализ, Инновационный менеджмент, Институциональная экономика, Коммерческая деятельность, Маркетинг, Маркетинг образовательных услуг, Мировая экономика, Налоги и налогообложение, Налоги физических и юридических лиц, Национальная экономика, Национальные модели рыночной экономики, Основы делопроизводства, Основы предпринимательства и бизнеса, Планирование и прогнозирование, Рынок ценных бумаг, Стратегический менеджмент, Страхование, Теория организации, Управленческие	

		решения, Финансовая деятельность образовательных учреждений, Финансы и кредит, Экономика малого бизнеса, Экономика отраслевых рынков, Экономика предприятия, Экономический анализ	
--	--	---	--

1.2. Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

Показатели оценивания компетенций на различных этапах их формирования в процессе освоения учебной дисциплины

№	Разделы дисциплины	Формируемые компетенции	Показатели сформированности (в терминах «знать», «уметь», «владеть»)
1	Сущность и роль финансового рынка в рыночной экономической системе. Основные функции и индикаторы финансового рынка	СК-1	<p>знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> – понятие и роль финансового рынка в рыночной экономике, сегменты финансового рынка, рынок кредитов, валютный рынок, рынок прямых инвестиций, фондовый рынок (рынок ценных бумаг), страховой рынок; <p>уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> – характеризовать основные функции финансового рынка, создание крупных фондов денежных средств, анализировать трансформацию собранных денежных средств в инвестиции, увеличение объема доходов, создаваемых в обществе; <p>владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> – подходами формирования системы процентных ставок в экономике, основных индикаторов финансового рынка (ИФР); анализом особенностей применения ИФР на российском и мировом финансовых рынках;
2	Участники финансового рынка: классификация и отличительные характеристики	СК-1	<p>знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> – понятия: участники, выполняющие ключевые функции на финансовом рынке, прямые

			<p>участники: инвесторы и заемщики, финансовые посредники: кредитные организации, финансовые институты, инвестиционные институты, участники, выполняющие вспомогательные функции на финансовом рынке: фондовая и валютная биржи, депозитарии ценных бумаг, регистраторы ценных бумаг, расчетно-клиринговые центры, органы регулирования и контроля (АУВЕР, НАУФОР, ПОРТАД, АРБ на мировом финансовом рынке; Банк России и ФСФР на российском финансовом рынке);</p> <p>уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> – отличать особенности правового статуса и характера деятельности финансовых посредников на финансовом рынке России: кредитных организаций, инвестиционных институтов, страховых компаний, трастовых (управляющих) компаний, негосударственных пенсионных фондов (НПФ); <p>владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> – понятиями: финансовый брокер и финансовый дилер; <p>государственные требования РФ к финансовым посредникам и/или инвестиционным институтам;</p>
3	Первичные ценные бумаги: понятия, классификация, расчеты стоимости (цены) и доходности для инвестора	СК-1	<p>знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> – понятие и основные характеристики современной ценной бумаги; классификацию ценных бумаг; эмиссионные и неэмиссионные ценные бумаги; классификацию видов акций; простые и привилегированные акции; <p>уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> – анализировать способы и этапы эмиссии акций; процесс размещения и оплаты, первоначального публичного предложения акций (IPO) виды цен акций, дивиденды; <p>владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> – понятиями: облигаций и их видов, номинальная стоимость, курс, рыночная цена, текущая

			доходность, полная доходность облигации к погашению, рейтинги облигаций и других видов ценных бумаг; характеризовать вексель и его виды, схемы движения простого, переводного векселя;
4	Производные финансовые инструменты и особенности их оборота на российском рынке ценных бумаг	СК-1	<p>знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> – понятие и классификацию производных финансовых инструментов на фондовом рынке (рынке ценных бумаг); опцион; опцион колл; опцион путо, ценку стоимости опционов; <p>уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> – анализировать временную стоимость опциона; биномиальную модель; модель Блэка-Шоулза; особенности фьючерсного контракта по сравнению с опционом; <p>владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> – расчетной стоимостью фьючерсного контракта; финансового фьючерса; краткосрочный и долгосрочного финансовых фьючерсов;
5	Сделки с ценными бумагами на фондовом рынке (рынке ценных бумаг)	СК-1	<p>знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> – сущность и классификацию сделок с ценными бумагами; кассовые и срочные сделки и прочее; <p>уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> – анализировать вертикальный и горизонтальный (календарный) спрэд; <p>владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> – комбинациями опционов; синтетической опционной моделью, фьючерсными сделками и прочее; механизмом игры на повышение и понижение курса акций;
6	Инвестиционный портфель: понятие, цель, задачи, принципы и этапы формирования. Классификация портфелей ценных бумаг.	СК-1	<p>знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> – понятие и основную цель формирования инвестиционного портфеля (портфеля ценных бумаг); задачи формирования инвестиционного портфеля; классификацию портфелей ценных бумаг; портфели роста и дохода; комбинированный агрессивный, умеренный, консервативный портфель; <p>уметь:</p>

			<ul style="list-style-type: none"> – применять принципы формирования инвестиционного портфеля: безопасность, доходность, рост и ликвидность; этапами формирования портфеля ценных бумаг; оценкой приемлемого сочетания риска и дохода портфеля; схемой управления портфелем;
7	Доходность портфеля ценных бумаг: методы и модели расчета	СК-1	<p>знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> – доходность ценных бумаг; . модель Гарри Марковица; ожидаемую доходность; стандартное отклонение (мера риска); статистические методы определения доходности инвестиционного портфеля: ковариация и корреляция; <p>уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> – формировать состав оптимального портфеля ценных бумаг; определять риски ценной бумаги и риска инвестиционного портфеля; <p>владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> – методом Марковица; индексной моделью Шарпа и алгоритм Марковица-Тобина; алгоритмом Элтона-Груббера-Падберга;
8	Понятие, структура и инфраструктура рынка ценных бумаг. Сегменты рынка ценных бумаг	СК-1	<p>знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> – сущность рынка ценных бумаг и его место в системе финансовых рынков; правовое регулирование и особенности российского рынка ценных бумаг; структуру рынка ценных бумаг; эмитенты, инвестор, брокеры, дилеры; <p>уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> – анализировать инфраструктуру рынка ценных бумаг, фондовых бирж, внебиржевую торговлю; <p>владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> – характеристиками: торговые системы, расчетно-клиринговые системы, информационные сети, сегменты рынка ценных бумаг, организованный рынок, неорганизованный рынок, первичный и вторичный рынки, биржевой и внебиржевой рынки, кассовый и срочный рынки;
9	Фондовая биржа и ее роль на современном рынке ценных бумаг.	СК-1	<p>знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> – понятие фондовой биржи; ретроспективы зарождения и

			<p>развития ведущих фондовых бирж мира; фондовые биржи в России; функции фондовой биржи;</p> <p>уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> – анализировать мобилизацию временно свободных денежных средств; процесс установления рыночного курса финансового актива; организацию торгов финансовыми активами между членами биржи; <p>владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> – аналитической базой подготовки и проведения биржевых операций; биржевыми индексами; ведущими мировыми биржевыми индексами; российскими биржевыми индексами;
10	<p>Фундаментальный и технический анализ на рынке ценных бумаг. Риски операций с ценными бумагами.</p>	СК-1	<p>знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> – понятие и уровни фундаментального анализа; технический анализ; изучение рынка с помощью анализа цены, объема и открытого интереса (объема открытых позиций); риски операций с ценными бумагами; <p>уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> – анализировать систематический и селективный риск; кредитный, инфляционный, отзывной риски; <p>владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> – мероприятиями по предотвращению риска операций с ценными бумагами; систематическим анализом доходности по разным видам ценных бумаг; оценкой степени возникающего риска;

Критерии оценивания компетенций

Код компетенции	Пороговый (базовый) уровень	Повышенный (продвинутый) уровень	Высокий (превосходный) уровень
СК-1	<p>Владеет основными экономическими категориями, знает основные признаки рыночной экономики, механизм рынка, свойства денег.</p>	<p>Способен определять точку безубыточности, способен охарактеризовать основные факторы развития рыночной экономики, имеет представления об</p>	<p>Способен прогнозировать развитие деятельности фирмы, принимать стратегические решения по развитию бизнеса в сфере образования.</p>

		эволюции экономической мысли в России и за рубежом.	
--	--	---	--

**Оценочные средства и шкала оценивания
(схема рейтинговой оценки)**

№	Оценочное средство	Баллы	Оцениваемые компетенции	Семестр
1	Выполнение докладов по вопросам семинаров	15	СК-1	6
2	Участие в дискуссии	10	СК-1	6
3	Выполнение практических заданий	20	СК-1	6
4	Выполнение реферата с презентацией	15	СК-1	6
5	Экзамен	40	СК-1	6

Итоговая оценка по дисциплине определяется преподавателем на основании суммы баллов, набранных студентом в течение семестра и период промежуточной аттестации.

Оценка «отлично», «хорошо», «удовлетворительно» и «неудовлетворительно» выставляется с учётом требований следующей шкалы:

- «отлично» – от 91 до 100 баллов – теоретическое содержание курса освоено полностью, сформированы необходимые практические навыки работы с освоенным материалом, все предусмотренные программой обучения учебные задания выполнены, качество их выполнения оценено числом баллов, близким к максимальному.
- «хорошо» – от 76 до 90 баллов – теоретическое содержание курса освоено полностью, без пробелов, некоторые практические навыки работы с освоенным материалом сформированы недостаточно, все предусмотренные программой обучения учебные задания выполнены, качество выполнения ни одного из них не оценено минимальным числом баллов, некоторые виды заданий выполнены с ошибками.
- «удовлетворительно» – от 61 до 75 баллов – теоретическое содержание курса освоено частично, но пробелы не носят существенного характера, необходимые практические навыки работы с освоенным материалом в основном сформированы, большинство предусмотренных программой обучения учебных заданий выполнено, но не высокого качества.
- «неудовлетворительно» – 60 и менее баллов – теоретическое содержание курса не освоено, необходимые практические навыки работы не сформированы, выполненные учебные задания содержат грубые ошибки, дополнительная самостоятельная работа над материалом курса не приведет к существенному повышению качества выполнения учебных заданий.

2. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА

Данный раздел содержит 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. Описание каждого оценочного средства содержит методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций.

Перечень оценочных средств, материалы которых представлены в данном разделе:

1. Выполнение докладов по вопросам семинаров
2. Участие в дискуссии
3. Выполнение практических заданий
4. Выполнение реферата с презентацией
5. Экзамен