

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«РЯЗАНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ РАДИОТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИМЕНИ В.Ф. УТКИНА»

Кафедра «Экономики, менеджмента и организации производства»

ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

**Б1.В.14 «СИСТЕМЫ ПРИНЯТИЯ РЕШЕНИЙ НА
ФИНАНСОВЫХ РЫНКАХ»**

Направление подготовки
01.03.02 «Прикладная математика и информатика»

Направленность (профиль) подготовки
«Программирование и анализ данных»

Квалификация выпускника – бакалавр

Форма обучения – очная

1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Оценочные материалы – это совокупность учебно-методических материалов (контрольных заданий, описаний форм и процедур), предназначенных для оценки качества освоения обучающимися данной дисциплины как части основной профессиональной образовательной программы.

Цель – оценить соответствие знаний, умений и уровня приобретенных компетенций, обучающихся целям и требованиям основной профессиональной образовательной программы в ходе проведения промежуточной аттестации.

Промежуточный контроль по дисциплине осуществляется путем проведения зачета с оценкой. Форма проведения контроля – тестирование и устный ответ в форме беседы с обучаемым по утвержденным вопросам, сформулированным с учетом содержания учебной дисциплины. Кроме того, в ходе беседы могут быть проверены задания на самостоятельную работу.

2. ПАСПОРТ ОЦЕНОЧНЫХ МАТЕРИАЛОВ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

№ п/п	Контролируемые разделы (темы) дисциплины	Код контролируемой компетенции (или её части)	Вид, метод, форма оценочного мероприятия
1	Основы принятия решений на финансовых рынках	ПК-4.1, ПК-4.2	Зачет с оценкой
2	Информация как основа принятия решений на финансовых рынках	ПК-4.1, ПК-4.2	Зачет с оценкой
3	Управленческие основы принятия решения на финансовых рынках	ПК-4.1, ПК-4.2	Зачет с оценкой
4	Государственное регулирование финансовых рынков и институтов	ПК-4.1, ПК-4.2	Зачет с оценкой
5	Организационно-правовые основы функционирования финансовых рынков	ПК-4.1, ПК-4.2	Зачет с оценкой
6	Риск при принятии инвестиционных решений	ПК-4.1, ПК-4.2	Зачет с оценкой
7	Поведенческие основы принятия решения на финансовых рынках	ПК-4.1, ПК-4.2	Зачет с оценкой
8	Формирование портфеля инструментов на финансовых рынках	ПК-4.1, ПК-4.2	Зачет с оценкой
10	Фундаментальный анализ при принятии решения на финансовых рынках	ПК-4.1, ПК-4.2	Зачет с оценкой
11	Технический анализ на финансовых рынках	ПК-4.1, ПК-4.2	Зачет с оценкой

3. ОПИСАНИЕ ПОКАЗАТЕЛЕЙ И КРИТЕРИЕВ ОЦЕНИВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ

Сформированность компетенции в рамках освоения данной дисциплины оценивается по трехуровневой шкале:

1) пороговый уровень является обязательным для всех обучающихся по завершении освоения дисциплины;

1) продвинутый уровень характеризуется превышением минимальных характеристик сформированности компетенций по завершении освоения дисциплины;

2) эталонный уровень характеризуется максимально возможной выраженностью компетенций и является важным качественным ориентиром для самосовершенствования.

Уровень освоения компетенций, формируемых дисциплиной:

а) описание критериев и шкалы оценивания тестирования:

Шкала оценивания	Критерий
5 балла (эталонный уровень)	Уровень усвоения материала, предусмотренного программой: процент верных ответов на тестовые вопросы от 85 до 100%
4 балла (продвинутый уровень)	Уровень усвоения материала, предусмотренного программой: процент верных ответов на тестовые вопросы от 70 до 84%
3 балла (пороговый уровень)	Уровень усвоения материала, предусмотренного программой: процент верных ответов на тестовые вопросы от 50 до 69%
0 баллов	Уровень усвоения материала, предусмотренного программой: процент верных ответов на тестовые вопросы от 0 до 49%

б) описание критериев и шкалы оценивания теоретического вопроса:

Шкала оценивания	Критерий
5 баллов (эталонный уровень)	выставляется студенту, который дал полный ответ на вопрос, показал глубокие систематизированные знания, смог привести примеры, ответил на дополнительные вопросы преподавателя
3 балла (продвинутый уровень)	выставляется студенту, который дал полный ответ на вопрос, но на некоторые дополнительные вопросы преподавателя ответил только с помощью наводящих вопросов
1 балла (пороговый уровень)	выставляется студенту, который дал неполный ответ на вопрос в билете и смог ответить на дополнительные вопросы только с помощью преподавателя
0 баллов	выставляется студенту, который не смог ответить на вопрос

На промежуточную аттестацию (зачет с оценкой) выносятся тест, два теоретических вопроса. Итоговый суммарный балл студента, полученный при прохождении промежуточной аттестации, переводится в традиционную форму по системе «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно». Необходимым условием выставления положительной оценки является выполнение заданий на самостоятельную работу.

Шкала оценивания	Критерий	
отлично (эталонный уровень)	12 – 15 баллов	Обязательным условием является выполнение всех предусмотренных в течение семестра заданий (при самостоятельной работе)
хорошо (продвинутый уровень)	8 – 11 баллов	
удовлетворительно (пороговый уровень)	4 – 7 баллов	
неудовлетворительно	0 – 3 балла	Студент не выполнил всех предусмотренных в течение семестра текущих заданий (при самостоятельной работе)

«Неудовлетворительно» выставляется обучающемуся, обнаружившему пробелы в знаниях основного учебно-программного материала, допустившему принципиальные ошибки в выполнении предусмотренных программой заданий. Как правило, оценка «неудовлетворительно» ставится обучающимся, которые не могут продолжить обучение или приступить к профессиональной деятельности по окончании вуза без дополнительных занятий по соответствующей дисциплине.

4. ТИПОВЫЕ КОНТРОЛЬНЫЕ ЗАДАНИЯ ИЛИ ИНЫЕ МАТЕРИАЛЫ

4.1. Промежуточная аттестация

<i>Коды компетенций</i>	<i>Результаты освоения ОПОП Содержание компетенций</i>
ПК-4.1	Проводит сбор и анализ информации бизнес-анализа для формирования возможных решений

а) типовые тестовые вопросы закрытого типа:

1. Виды нормативных актов, которые регулируют финансовые рынки:
 - 1) Конституция, законы, обычаи делового оборота;
 - 2) Конституция, Кодексы, законы, обычаи делового оборота
 - 3) **Конституция, Кодексы, законы, указы Президента, постановления Правительства, нормативные акты федерального органа исполнительной власти в сфере финансовых рынков, иных федеральных органов исполнительной власти, обычаи делового оборота**
 - 4) Конституция, Кодексы, законы, указы Президента, постановления Правительства и обычаи делового оборота
2. К основным угрозам, которые необходимо учитывать при принятии решений на финансовых рынках, определенные в Стратегии экономической безопасности РФ, относятся:
 - 1) стремление развитых государств использовать свои преимущества в уровне развития экономики, высоких технологий (в том числе информационных) в качестве инструмента глобальной конкуренции;
 - 2) усиление структурных дисбалансов в мировой экономике и финансовой системе, рост частной и суверенной задолженности, увеличение разрыва между стоимостной оценкой реальных активов и производных ценных бумаг;
 - 3) использование дискриминационных мер в отношении ключевых секторов экономики, ограничение доступа к иностранным финансовым ресурсам и современным технологиям;
 - 4) повышение конфликтного потенциала в зонах экономических интересов РФ, а также вблизи ее границ;
 - 5) усиление колебаний конъюнктуры мировых товарных и финансовых рынков;
 - 6) подверженность финансовой системы РФ глобальным рискам (в том числе в результате влияния спекулятивного иностранного капитала), а также уязвимость информационной инфраструктуры финансово-банковской системы;
 - 7) 1, 2, 4, 6
 - 8) **все вышеперечисленное**
3. Группы участников финансовых рынков:
 - 1) инвестор;
 - 2) эмитент;
 - 3) финансовый посредник;
 - 4) 1 и 2
 - 5) 1 и 3
 - 6) **1, 2, 3**
4. Финансовые инструменты:
 - 1) валюта;
 - 2) драгоценные металлы;
 - 3) ценные бумаги
 - 4) денежные средства;
 - 5) договор займа;
 - 6) 1,2,3,4;
 - 7) **1,2,3,4,5**
5. Регулятор отечественных финансовых рынков и институтов:
 - 1) Правительство РФ;
 - 2) **Банк России;**
 - 3) Министерство труда РФ;

- 4) Федеральная Налоговая Служба РФ
6. Финансовый рынок включает следующие рынки:
- 1) денежный рынок и рынок капитала
 - 2) только рынок срочных бумаг и денежный рынок
 - 3) только рынок капитала и рынок деривативов
 - 4) рынок акций и производных ценных бумаг
 - 5) валютный рынок
 - 6) 1, 5
 - 7) **1, 4, 5**

б) типовые тестовые вопросы открытого типа:

1. Метод анализа финансовых активов, основанный на прогнозе доходов, называется _____ анализ (**фундаментальный**)
2. Базовая модель оценки доходности долгосрочных финансовых активов (CAPM) в качестве параметра риска использует коэффициент _____ (**бета**)
3. Организатор торговли может оказывать услуги по проведению организованных торгов на товарном и (или) финансовом рынках на основании _____ торговой системы (**лицензии**)
4. После проведения компанией выкупа собственных акций на открытом рынке и их погашения, финансовый риск компании _____ (**возрастает**)
5. Характеристика модели безопасности информации, определяющая возможность ее несанкционированной модификации _____ (**целостность**)

Коды компетенций	Результаты освоения ОПОП Содержание компетенций
ПК-4.2	. Формирует возможные решения бизнес-проблем

а) типовые тестовые вопросы закрытого типа:

1. Основные международные долгосрочные риски, которые необходимо учитывать инвестору:
 - 1) рост стоимости жизни;
 - 2) высокая инфляция;
 - 3) высокая долговая нагрузка;
 - 4) обострение борьбы за ресурсы;
 - 5) 1,2,3;
 - 6) 2,3,4;
 - 7) **все перечисленное**
2. Учет и осуществление перехода прав собственности на государственные ценные бумаги на биржевом рынке государственных ценных бумаг происходит в:
 - 1) торговой системе;
 - 2) расчетной системе;
 - 3) Банке России
 - 4) **депозитарной системе**
3. В состав инфраструктуры биржевого рынка государственных ценных бумаг входят:
 - 1) расчетная система;
 - 2) торговая система;
 - 3) депозитарная система;
 - 4) Банк России;
 - 5) 2, 3;
 - 6) 2, 3, 4;
 - 7) **1, 2, 3;**
 - 8) все перечисленное
4. Какие организации относятся к финансовым:
 - 1) банк;
 - 2) ломбард;
 - 3) пенсионный фонд

- 4) кредитный потребительский кооператив;
 - 5) лизинговая компания;
 - 6) 1,2,3;
 - 7) 1,2,3,4;
 - 8) 1,2,3,5;
 - 9) все перечисленное**
5. Основными функциями финансового рынка в рыночной экономике являются:
- 1) Трансформация сбережений в ссудный и инвестиционный капитал;
 - 2) Формирование рыночных цен на финансовые инструменты (активы);
 - 3) Осуществление квалифицированного посредничества между продавцами и покупателями финансовых инструментов (активов);
 - 4) Ускорение оборота средств, способствующее активизации экономических процессов;
 - 5) 1, 2, 3
 - 6) 1, 2, 4
 - 7) все перечисленное**
6. Показатель стоимости под риском (VaR), представляет собой:
- 1) максимально возможную величину потерь по финансовому активу
 - 2) максимально возможную величину потерь по финансовому активу, которая не будет превышена в течение определенного периода времени с заданной вероятностью;**
 - 3) максимально возможную величину потерь по финансовому активу, которая не будет превышена с заданной вероятностью
7. К основным задачам по реализации устойчивого развития национальной финансовой системы, которые определены в Стратегии экономической безопасности РФ, относятся:
- 1) снижение критической зависимости национальной денежно-кредитной системы от колебаний конъюнктуры на международных финансовых и товарных рынках;
 - 2) снижение использования иностранной валюты при осуществлении хозяйственной деятельности в российской юрисдикции;
 - 3) развитие внутренних (национальных) источников долгосрочных финансовых ресурсов, обеспечение нормы накопления, достаточной для устойчивого развития национальной экономики;
 - 4) развитие механизмов и инструментов инвестиционно ориентированной государственной финансовой политики, предусматривающей в том числе увеличение нормы накопления, а также привлечение накоплений для реализации инвестиционных проектов;
 - 5) совершенствование специализированных инструментов поддержки кредитования стратегических отраслей экономики, наукоемких и высокотехнологичных производств;
 - 6) развитие инфраструктуры национального финансового рынка, национальной платежной системы, национальной системы платежных карт и системы передачи финансовых сообщений;
 - 7) совершенствование регулирования деятельности финансовых организаций, развитие системы надзора и методик стресс-тестирования;
 - 8) 1, 2, 3, 4, 5, 6
 - 9) все перечисленное**
8. Виды ответственности за правонарушения на финансовых рынках:
- 1) административная;
 - 2) уголовная;
 - 3) инклюзивная
 - 4) 1 и 2**
 - 5) 1, 2, 3
9. В целях информирования инвесторов и предупреждения их о совершенных и возможных правонарушениях на рынке ценных бумаг Банк России на своем официальном сайте в информационно-телекоммуникационной сети "Интернет" размещает информацию:
- 1) Об аннулировании или приостановлении действия лицензий на осуществление профессиональной деятельности;
 - 2) О саморегулируемых организациях в сфере финансового рынка;
 - 3) Об административных взысканиях, наложенных Банком России;
 - 4) О судебных решениях, вынесенных по искам Банка России;
 - 5) О всех судебных решениях по правонарушениям на рынке ценных бумаг в отношении

инвесторов.

6) 1,2,3,4

7) все перечисленное

10. В каких странах из перечисленных действует модель финансовой системы, основанная на банках?

1) США;

2) Германия;

3) Италия;

4) Канада;

5) 1, 2;

6) 2, 3;

7) 1, 4

б) типовые тестовые вопросы открытого типа:

1. Рост процентных ставок в экономике является фактором _____ деловой активности
(снижения, сокращения)

2. Основной функцией менеджмента является _____ (планирование)

3. Метод анализа на финансовом рынке, основанный на прошлой информации, называется _____ анализ (технический)

4. Инвестор подвержен _____ риску, если он имеет 1000 руб., которые хранятся в сейфе
(финансовому)

5. Даны следующие вероятности роста доходности финансовых активов «А», «В» и «С»:
 $P(A)=0,8$; $P(B)=0,9$; $P(C)=0,7$. Вероятность того, что вырастет доходность только актива «В» равна (в
отн. ед.) _____ (0,054)

Типовые теоретические вопросы на зачет по дисциплине (ПК-4.1, ПК-4.2)

1. Финансовые рынки. Виды и участники.
1. Финансовые рынки. Финансовые инструменты.
2. Международные финансовые рынки.
3. Функции управленческой деятельности. Планирование.
4. Методы анализа на финансовых рынках
5. Прогнозирование. Методы прогнозирования на финансовых рынках.
6. Информационные системы. Виды и задачи.
7. Управленческая деятельность. Подходы к автоматизации.
8. Основы разработки и поддержки систем принятия решений.
9. Информационные системы принятия решения.
10. Принятие управленческого решения. Задачи и ограничения.
11. Финансовая информация. Виды и свойства.
12. Финансовая информация. Асимметричность информации.
13. Финансовая информация. Информационные ресурсы.
14. Управленческие решения. Методы диагностики проблем.
15. Управленческие решения. Методы решения проблемных ситуаций.
16. Бизнес-план в управленческой деятельности.
17. Государственное регулирование финансовых рынков. Формы и методы.
18. Нормативно-правовые акты, регулирующие финансовые рынки. Гражданский кодекс.
19. Нормативно-правовые акты, регулирующие финансовые рынки. Налоговый кодекс.
20. Законодательная ответственность участников финансовых рынков.
21. Риск при принятии инвестиционных решений. Методы анализа рисков
22. Риск при принятии инвестиционных решений. Методы управления рисками
23. Психологические эффекты при принятии управленческих решений
24. Ментальные ловушки при принятии решений на финансовых рынках
25. Портфели на финансовых рынках. Методы анализа
26. Портфели на финансовых рынках. Методы формирования
27. Учет фактора времени при анализе финансовых рынков
28. Фундаментальный анализ. Макроэкономические показатели

29. Фундаментальный анализ. Микроэкономические показатели
30. Фундаментальный анализ финансовых рынков и инструментов
31. Анализ и прогнозирование кризисов на финансовых рынках
32. Технический анализ на финансовых рынках
33. Показатели технического анализа финансовых рынков и инструментов
34. Прогнозирование на основе технического анализа
35. Соотношение фундаментального и технического анализа на финансовых рынках

Оператор ЭДО ООО "Компания "Тензор"

ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ

СОГЛАСОВАНО

ФГБОУ ВО "РГРТУ", РГРТУ, Евдокимова Елена Николаевна, Заведующий
кафедрой ЭМОП

Простая подпись