

Автономная некоммерческая организация высшего образования
«Сибирский институт бизнеса, управления и психологии»

Экономический факультет



РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.10 СОВРЕМЕННЫЕ ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ

Направление подготовки 38.03.01 Экономика

Направленность (профиль) образовательной программы Мировая экономика

Квалификация выпускника Бакалавр

Форма обучения Очная

Кафедра Мировой экономики

Красноярск, 2023

Рабочая программа дисциплины составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, утвержденного приказом Минобрнауки России от «12» 11 2015 г. № 1327

Рабочую программу составил:
Старший преподаватель кафедры мировой экономики
(должность, кафедра, ученая степень, ученое звание)



(подпись)

Ю.А. Радаев
инициалы, фамилия

Рабочая программа дисциплины обсуждена на заседании кафедры-разработчика Мировой экономики

Протокол от 18 мая 2023 г. № 8

И.о. заведующего кафедрой Мировой экономики



И.В. Молодан

Рабочая программа дисциплины обсуждена на заседании выпускающей кафедры Мировой экономики

Протокол от 18 мая 2023 г. № 8

И.о. заведующего кафедрой Мировой экономики



И.В. Молодан

Рабочая программа рассмотрена и одобрена научно-методическим советом направления (факультета) 38.03.01 Экономика

Протокол от 25 мая 2023 г. № 9

Председатель НМС к.э.н., доцент



М.В. Полубелова

Введение

Учебно-методический комплекс предназначен в помощь студентам в системном овладении ими знаниями по дисциплине «Современные финансовые рынки». Изучение курса должно подготовить будущих специалистов теоретически и практически к пониманию функционирования финансовых рынков, решению вопросов их фундаментального и технического анализа, принятия аналитических, инвестиционных и торговых решений в процессе работы на международных финансовых рынках.

Рабочая программа входит в вариативную часть обязательного изучения дисциплины по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, профиль «Мировая экономика». Программа разработана с учетом требований федерального государственного образовательного стандарта (ФГОС), соответствует утвержденному учебному плану.

Учебно-методический комплекс содержит тематический план учебной дисциплины, методические пояснения к ее изучению, планы и краткое содержание лекционных и семинарских занятий, списки рекомендуемой литературы, планирование самостоятельной работы, вопросы к экзамену и т. д.

Рабочая программа предназначена для преподавателей, ведущих данную дисциплину, и обучающихся, участвующих в процессе изучения дисциплины.

1. Цели и задачи освоения дисциплины

Цель курса «Современные финансовые рынки» состоит в том, чтобы дать студентам базовые знания об основных финансовых рынках: фондовом, валютном, страховом, денежном, рынке производных финансовых инструментов, и тенденциях их развития. В процессе изучения курса студент должен приобрести навыки анализа ценообразования и процессов, происходящих на ведущих мировых финансовых рынках.

Основные задачи курса:

- изучение теоретических основ международных и национальных финансовых рынков;
- изучение теоретических основ инвестиционного процесса;
- освоение принципов и механизмов проведения анализа и финансово-торговых операций на рынках;
- изучение методов и инструментов проведения технического и фундаментального анализа, широко используемых в международной и национальной практиках;
- приобретение умений решения задач и проведение расчетов по финансовым операциям на рынках.

2. Результаты обучения по дисциплине

В соответствии с требованиями к результатам освоения основных образовательных программ бакалавриата, определенными федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, в результате освоения дисциплины «Современные финансовые рынки» у обучающихся должны быть сформированы следующие общекультурные компетенции (ОПК-2, ОПК-3; ПК-4, ПК-10):

Код компетенции	Наименование компетенции	Планируемые результаты обучения по дисциплине
Общепрофессиональные компетенции		
ОПК-2	способен осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач	<u>Знать:</u> функционирование фондового, валютного, срочного и денежного рынков; инвестиционный процесс. <u>Уметь:</u> собирать необходимую информацию в текстовом, графическом и цифровом виде из

		различных источников в целях их дальнейшего анализа. <u>Владеть:</u> навыками сбора информации в текстовом, графическом и цифровом виде из различных источников в целях их дальнейшего анализа.
ОПК-3	способен выбрать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, проанализировать результаты расчетов и обосновать полученные выводы	<u>Знать:</u> методики технического анализа на финансовых рынках; методики фундаментального анализа на фондовом рынке. <u>Уметь:</u> проводить технический анализ на финансовых рынках; проводить фундаментальный анализ на фондовом рынке. <u>Владеть:</u> навыками проведения технического и фундаментального анализа на фондовом рынке.
Профессиональные компетенции		
ПК-4	способен на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и экономические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты	<u>Знать:</u> портфельную теорию управления инвестициями. <u>Уметь:</u> моделировать портфели из разных классов финансовых активов. <u>Владеть:</u> навыками моделирования портфеля из разных классов финансовых активов
ПК-10	способен использовать для решения коммуникативных задач современные технические средства и информационные технологии	<u>Знать:</u> особенности и принципы проведения финансово-торговых операций на фондовом, денежном и срочном рынках через специализированные программы. <u>Уметь:</u> проводить финансово-торговые операции на фондовом, валютном и срочном рынках. <u>Владеть :</u> Навыками проведение финансово-торговых операций на фондовом, валютном и срочном рынках

3. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Современные финансовые рынки» относится к профессиональному циклу дисциплин (вариативная часть, обязательные дисциплины).

Необходимыми условиями для освоения дисциплины являются знание по дисциплинам «Финансы», «Основы финансовых вычислений», «Деньги, кредит, банки».

Дисциплина «Современные финансовые рынки» относится к реализации программы воспитания по профессионально-трудовому направлению.

Главной целью дисциплины в реализации воспитательной программы в институте является формирование у обучающихся профессиональной и практической работы на финансовых рынках, критического мышления, мотивации к самостоятельной деятельности.

Задачи дисциплины в реализации воспитательной программы:

- развитие интереса к предмету и самостоятельной деятельности, способностей выдвигать новые идеи, критически мыслить, формулировать основные цели-задачи выполняемой работы;
- формирование навыков самообразования и самоорганизации, умение действовать самостоятельно, активно и ответственно, правильно оценивать смысл и последствия своих действий.

Необходимыми условиями для освоения дисциплины являются:

- знание общей экономики, экономической географии, основ обществознания и иных общеобразовательных дисциплин, реализуемых на уровне среднего общего образования.

Требования к входным знаниям, умениям и компетенциям студента, необходимым для ее изучения:

- умение самостоятельно принимать решения, нести ответственность за свои действия, критически мыслить;
- способность выражать и отстаивать свое мнение.

4. Структура и содержание дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины «Современные финансовые рынки» составляет 5 зачётных единиц трудоемкости (ЗЕТ), 180 академических часов.

4.1 Объем дисциплины по видам учебной работы (очная форма обучения).

Вид учебной работы	Всего з.е.	Всего часов	Курс 3
			Семестр 6 (з.е./час.)
1	2	3	4
Общая трудоемкость дисциплины	5	180	180
Контактная работа с преподавателем Всего:	1,68	60,3	60,3
В том числе аудиторные занятия:	1,67	60	60
занятия лекционного типа/из них в форме практической подготовки	0,83	30	30
занятия семинарского типа/из них в форме практической подготовки	-	-	-
занятия практического типа/из них в форме практической подготовки	0,83	30	30
лабораторные занятия/из них в форме практической подготовки	-	-	-
Контактная работа при проведении промежуточной аттестации (экзамен)	0,01	0,3	0,3
Самостоятельная работа. Всего:	2,33	84	84
В том числе: курсовая работа	-	-	-
Другие виды самостоятельной работы	2,33	84	84
Вид промежуточного контроля (экзамен):	0,99	35,7	35,7

4.2 Тематический план изучения дисциплины (очная форма обучения):

№ п/п	Наименован ие раздела дисциплины	Тема раздела дисциплины	Коды компет енций	Всего часов	Контактная работа с преподавателем, час.			Самостоятел ьная работа, час.
					лекц ии	прак тиче ские	лабор аторн ые	
1	2	3	4	5	6	7	8	9
3 курс 6 семестр								
1.	Введение в финансы	Введение в финансы	ОПК-2		1	2		4
		Международные и национальные финансовые рынки (структура, взаимосвязи)			1	2		4
		Основные финансовые институты.			2	2		4
2.	Фондовые рынки	Мировой фондовый рынок и фондовый рынок России.	ОПК-2 ОПК-3 ПК-4 ПК-10		2	2		6
		Активы (инструменты) обращающиеся на Московской и Санкт-Петербургской биржи			2	2		5
		Технический анализ графиков цен.			2	2		5
		Фундаментальный анализ компаний-эмитентов и ценных бумаг.			2	2		5
		Принципы проведение торговых операций на Московской бирже.			2	2		6
3.	Валютные рынки	Валютная секция Московской биржи.	ОПК-2 ОПК-3 ПК-10		1	1		4
		Международный внебиржевой валютный рынок Форекс.			2	1		4

		Основные валютные пары и валютные инструменты, обращающиеся на валютном рынке			2	1		4
		Принципы проведение торговых операций с валютами на Валютной бирже и рынке Форекс			1	1		4
4.	Денежный рынок	Денежный рынок и его основные инструменты	ОПК-2		2	2		4
5.	Страховой рынок и страхование рисков	Международный страховой рынок	ОПК-2		2	2		8
		Особенности формирования и управление рисками на финансовых рынках			2	2		8
6.	Рынок срочных контрактов	Рынок срочных контрактов	ОПК-2 ОПК-3 ПК-10		2	2		4
		Принципы проведение торговых операций с инструментами ПФИ на срочном рынке Московской биржи.			2	2		5
Итого часов:					30	30		84

4.2.1 Тематический план лекций представлен в таблице:

№ п/п	Тема лекции, краткое содержание	Формы и методы обучения, способствующие формированию и развитию компетенции	Формы образовательных технологий, применяемых на занятиях*
Раздел 1 Введение в финансы			
1	Введение в финансы Понятие: финансы, денежные средства и денежные фонды. Финансы на уровне государства, предприятия и домохозяйств.	Экспресс-опрос	Лекция-визуализация
2	Международные и национальные финансовые рынки	Экспресс-опрос	Лекция-визуализация

	(структура, взаимосвязи) Фондовый, валютный рынок и рынок форекс, рынок производных инструментов, страховой рынок, денежный рынок, рынок золота, мировые финансовые кризисы Их функционирование и важные отличительные особенности.		лизация
3	Основные финансовые институты. Центральный банк; Коммерческие и инвестиционные банки; кредитные союзы; инвестиционные фонды (взаимные, паевые, венчурные и хеджевые); пенсионные фонды; страховые компании; профессиональные участники рынка (брокеры, дилеры, биржи, НКЦ, НРД). Особенности функционирования, решаемые задачи, их роль и значимость в финансовой сфере.	Экспресс-опрос	Лекция-визуализация.
Раздел 2. Фондовые рынки			
4	Мировой фондовый рынок и фондовый рынок России. Знакомство с крупнейшими рынками США, Европы (Англия, Германия, Франция), Японии и Китая Международная классификация, правила функционирования, особенности. Фондовый рынок России: организация (федеральные законы и регламенты), современное функционирование и правила работы (время и режимы, секции); понятие спекулянта и инвестора их сходства и отличия.	Экспресс-опрос	Лекция-визуализация.
5	Активы (инструменты) обращающиеся на Московской и Санкт-Петербургской биржи Изучение основных инструментов: Акции российских и иностранных эмитентов; облигации ОФЗ и корпоративные; депозитарные расписки; биржевые фонды (банковские, УК и ETF)	Экспресс-опрос	Лекция-визуализация.
6	Технический анализ графиков цен. Методика классического технического анализа: теория Доу; графический анализ (тенденция, каналы движения, фигуры разворота и продолжения трендов); математический анализ (индикаторы трендовые и каналы и их принципы работы). Другие методики анализа: свечной; волновой и т.п.	Экспресс-опрос	Лекция-визуализация.
7	Фундаментальный анализ компаний-эмитентов и ценных бумаг. Макроэкономический анализ экономики страны. Анализ по методу дисконтирования денежных потоков (DCF) и сравнительный анализ. Общий анализ основных показателей по отчетности МСФО. Нахождение справедливой стоимости актива и его текущий потенциал	Экспресс-опрос	Лекция-визуализация.

8	Принципы проведение торговых операций на Московской бирже. Операции спот и срочные операции. Правила торгов (торговый стакан и цены продавца и покупателя; торговый лот; заявки; сделки); пример сделок с акциями и облигациями ОФЗ	Экспресс-опрос	Лекция-визуализация.
Раздел 3. Валютные рынки			
9	Валютная секция Московской биржи. Особенности функционирования, рынок наличной валюты (спот); основные активы (валютные пары с рублем; валютные не рублевые пары; режимы поставки) Стратегии торговли.	Экспресс-опрос	Лекция-визуализация.
10	Международный внебиржевой валютный рынок Форекс. Особенности функционирования; понятие форвардных контрактов на валютные пары форекс; ценообразование; особенности торговли (совершение сделок, маржинальная торговля); форекс-брокеры и форекс-дилеры на рынке.	Экспресс-опрос	Лекция-визуализация.
11	Основные валютные пары и валютные инструменты, обращающиеся на валютном рынке Основные пары с долларом США; основные кросс-курсы; базовая валюта и валюта котирования; валютный курс и котировка на бирже; прямая и обратная котировка; сырьевые и не сырьевые валюты; валюты убежища; торговый лот; спред; кредитное плечо.	Экспресс-опрос	Лекция-визуализация
12	Принципы проведение торговых операций с валютами на Валютной бирже и рынке Форекс Особенности работы программы Мета трейдер 4 и 5 для анализа и торговли валютными парами. Торговля маржинальная с залогом через понятие кредитного плеча (понятие маржи-залога; уровня достаточности средств; формирование прибыли и убытка от сделок)	Экспресс-опрос	Лекция-визуализация
Раздел 4. Денежный рынок			
13	Денежный рынок и его основные инструменты Операции РЕПО (особенности проведения, участники), депозитные операции на денежном рынке Московской биржи (особенности проведения, участники, примеры). Банковские депозиты как инструмент внебиржевого денежного рынка.	Экспресс-опрос	Лекция-визуализация
Раздел 5. Страховой рынок и страхование рисков			
14	Международный страховой рынок История развития страхового рынка в мире, в России; Страховой рынок и страховые продукты США, Японии, Европы и России	Экспресс-опрос	Лекция-визуализация

15	Особенности формирования и управление рисками на финансовых рынках Понятие риска, основные виды риска на финансовом рынке; показатели оцениваемые риск; операции страхования и хеджирования риска (примеры) Особенности использования и применение фьючерсных и опционных контрактов как инструментов страхования риска.	Экспресс-опрос	Лекция-визуализация
Раздел 6. Рынок срочных контрактов			
16	Рынок срочных контрактов Форвардные контракты; фьючерсные контракты; опционные контракты; своп; структурные продукты (здесь же и облигации со структурным доходом). Особенности инструментов; гарантийное обеспечение контрактов; особенности применения в целях спекуляции и хеджирования рисков.	Экспресс-опрос	Лекция-визуализация
17	Принципы проведение торговых операций с инструментами ПФИ на срочном рынке Московской биржи. Гарантийная и вариационная маржа, фиксинг цен; устанавливаемый диапазон колебания цены; издержки, кредитное плечо, риски по инструментам. Примеры торговых сделок с фьючерсными контрактами на индекс РТС, валютную пару доллар-рубли; золото.	Экспресс-опрос	Лекция-визуализация

4.2.2. Тематический план практических занятий представлен в таблице:

№ п/п	Тема практического занятия, краткое содержание	Формы и методы обучения, способствующие формированию и развитию компетенции	Формы образовательных технологий, применяемых на занятиях*
Раздел 1 Введение в финансы			
1	Международные и национальные финансово-товарные рынки. Доклады студентов с презентациями: фондовый, валютный рынок форекс, рынок производных инструментов, страховой рынок, денежный рынок, рынок золота, товарный рынок, мировые финансовые кризисы Их важные отличительные особенности.	Тестирование	Доклады
2	Финансовые институты Доклады студентов с презентациями: коммерческие и инвестиционные банки; кредитные союзы; инвестиционные фонды (паевые, хеджевые); пенсионные фонды; страховые компании; профессиональные участники рынка (брокеры, дилеры,	Тестирование	Доклады

	биржи). Обсуждение их роли и значимости.		
3	Личный бюджет и основы финансовых вычислений Личные финансы (доходы и расходы); простой и сложный процент; наращение и дисконтирование	Тестирование	Тренинг
Раздел 2. Фондовые рынки			
4	Московская фондовая биржа и ее инструменты Демонстрация работы биржи через торговую систему Квик (видео презентация: инструменты, графики, совершение торговых сделок, таблицы)	Тестирование	Семинар-беседа.
5	Технический анализ графиков Методика классического технического анализа: теория Доу; графический анализ (тенденция, каналы движения, фигуры разворота и продолжения трендов); математический анализ (индикаторы трендовые и каналы и их принципы работы). Другие методики анализа: свечной; волновой и т.п.	Тестирование	Тренинг
6	Фундаментальный анализ компаний-эмитентов и ценных бумаг Анализ по методу дисконтирования денежных потоков (DCF) и сравнительный анализ. Общий анализ основных показателей по отчетности МСФО. Нахождение справедливой стоимости актива и его текущий потенциал	Тестирование	Тренинг
7	Практические умения проведения торговых операций и расчет основных издержек, прибылей и убытков по ним на инструментах фондового рынка (акции и облигации)	Тестирование	Тренинг
Раздел 3. Валютные рынки			
8	Торговые операции с наличной валютой на Московской бирже Правила котирования; совершение сделок; расчет издержек и результатов.	Тестирование	Тренинг
9	Торговые операции с валютными контрактами на рынке форекс. Правила котирования; расчет маржинальных сделок и понятие кредитного плеча (залог, уровень маржи, доступность средств, стоп аут); расчет результатов по сделки (стоимость пункта в денежной единице)	Тестирование	Тренинг
Раздел 4. Денежный рынок			
10	Инструменты денежного рынка Операции РЕПО, депозитные операции на денежном рынке Московской биржи.	Тестирование	Тренинг
Раздел 5. Страховой рынок и страхование рисков			
11	Международный страховой рынок Доклады и презентации: История развития страхового рынка в мире, в России; Страховой рынок и страховые продукты США, Японии, Европы и России. Обсуждение и разбор страховых продуктов. Расчет	Тестирование	Доклады

	страховых инструментов инвестиционного типа на примере страховых российских компаний (сайты компаний)		
12	Страхование рисков на финансовых рынках. Особенности использования и применение фьючерсных и опционных контрактов.	Тестирование	Тренинг
13	Формирование инвестиционного портфеля с целью диверсификации риска Статистический сбор и анализ активов, формирование портфеля из 10 активов. Расчет доходности и риска (дисперсия и стандартное отклонение, бета коэффициент, ковариация и корреляция, VaR), построение портфельной матрицы, итоговые расчеты.	Тестирование	Тренинг
Раздел 6. Рынок срочных контрактов			
14	Производные финансовые инструменты Доклады и презентации по основным инструментам ПФИ: форвардные контракты; фьючерсные контракты; опционные контракты; своп; структурные продукты (здесь же и облигации со структурным доходом)	Тестирование	Доклады
15	Практические умения проведения торговых операций с фьючерсами и опционами на Московской бирже. Расчет ГО, вариационной маржи, фиксинг цен; устанавливаемый диапазон колебания цены; издержки, кредитное плечо, риски по инструментам.	Тестирование	Тренинг
16	Структурные продукты на финансовых рынках. Принципы составления и функционирования; доходность и риски	Тестирование	Семинар-беседа.

4.2.3. Лабораторные работы по дисциплине не предусмотрены.

4.2.4. Занятия в форме практической подготовки по дисциплине не предусмотрены.

4.2.5. Тематический план самостоятельной работы обучающихся представлен в таблице (очная форма обучения):

Раздел/тема дисциплины	Вид самостоятельной работы	Трудоемкость ¹ , часов
Введение в финансы	1. Доклады и презентации к финансово-товарным рынкам. 2. Доклады и презентации к финансовым институтам.	12

Фондовые рынки	3. Домашнее задание по практической теме №5: проведение технического анализа по графику цен (провести анализ валютной пары в программе мета трейдер 5, скачиваем с сайта разработчика) 4. Подготовка к практической теме №6: скачиваем финансовую годовую отчетность компании за последний год с сайта. Дополнительная домашняя работа по ходу проведения анализа DCF 5. Подготовка к текущему контролю	27
Валютные рынки	6. Подготовка к практическому занятию темы №9 (скачанная программа мета трейдер 5): домашнее задание (провести в торговой платформе мета трейдер 5 минимум 1-2 сделки, и рассчитать издержки и результат по сделкам). 7. Подготовка к текущему контролю	16
Денежный рынок	8. Подготовка к практической теме №10 (изучение операций репо)	4
Страховой рынок и страхование рисков	9. Доклады и презентации к теме №11 10. Домашняя работа по теме №13: формирование инвестиционного портфеля (проведение расчетов в эксель) 11. Подготовка к текущему контролю	16
Рынок срочных контрактов	12. Доклады и презентации к теме №14 по основным инструментам ПФИ	9
Итого:		84

¹Время, затрачиваемое на выполнение самостоятельной (внеаудиторной) работы обучающихся определено с учетом сложности и объема изучаемого материала учебной дисциплины по каждой теме через наблюдение преподавателем за выполнением заданий и (или) собственных временных затрат преподавателя на решение того или иного задания с поправкой на уровень подготовки студентов. Данное распределение времени, затрачиваемого на выполнение самостоятельной (внеаудиторной) работы обучающимися по дисциплине, рассмотрено и одобрено на заседании кафедры при утверждении (актуализации) рабочей программы дисциплины.

Подготовка к практическим занятиям заключается в изучении лекционного материала рассматриваемого на занятиях и представленного в курсе лекций, подготовка докладов, презентаций. Форма контроля – опрос.

Подготовка к текущий контролю заключается в изучении лекционного материала, решенных задач, рассмотренных примеров. Текущий контроль осуществляется после изучения каждой темы в виде тестирования.

Самостоятельная работа обучающихся организуется с целью развития у них навыков работы с учебной и научной литературой, специализированными программами, отработкой практических умений в анализе и торговле на финансовых рынках, для систематического изучения курса и для формирования умения самостоятельно приобретать, расширять и углублять знания.

Самостоятельное изучение темы заключается в изучении лекционного материала рассматриваемого на занятиях и представленного в курсе лекций, поиск информации в сети интернет и других источников. Форма контроля – опрос, проверка доклада или презентации, решение задач.

Задачи самостоятельной работы:

– освоить теоретический материал;

– закрепить знание теоретического материала, используя необходимый инструментарий практическим путем (выполнение контрольных заданий, решение задач, тестов для самопроверки и т. д.);

– применить полученные знания и умения для формирования правильного мышления.

– применить знания и умения в практической деятельности на финансовых рынках (основные виды практической деятельности: анализ рынка и активов; совершение торговых операций; управление активами).

4.2.6. Тематика реферативных работ.

Реферативные работы по дисциплине учебным планом не предусмотрены.

4.2.7. Тематика курсовых работ (проектов).

Курсовые работы по дисциплине учебным планом не предусмотрены.

4.2.8. Условия реализации учебной дисциплины с применением электронного обучения и дистанционных образовательных технологий.

Образовательная деятельность с использованием электронного обучения и дистанционных образовательных технологий основывается на сочетании контактной работы (аудиторной и внеаудиторной) с преподавателем и самостоятельной работы обучающегося. При использовании дистанционных образовательных технологий обучающийся и преподаватель взаимодействовать в образовательном процессе в следующих формах:

онлайн – лекционные и практические занятия в объеме часов предусмотренных учебным планом и расписанием проводятся в браузерной видеоконференции Платформа proficonf.com.

офлайн – консультации студентов проводятся в электронной информационнообразовательной среде СИБУП с использованием таких элементов курса как форум или чат, контроль знаний студентов реализуется посредством таких элементов курса как задание, тест и т.п..

Место размещения страницы учебной дисциплины на платформе дистанционного обучения <http://do.sibup.ru/course/view.php?id=200>

5. Формы контроля, оценка результатов освоения дисциплины и фонд оценочных средств

Обучение по дисциплине «Современные финансовые рынки» предусматривает следующие формы текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации:

Текущая аттестация студентов производится в дискретные временные интервалы лектором и преподавателем (ями), ведущими практические занятия по дисциплине в следующих формах:

- опрос;
- письменные домашние задания;
- тестирование

В рамках эксперимента, реализуемого в институте, для текущей аттестации обучающихся очной формы может использоваться модульно-рейтинговая система оценки успеваемости студентов в дискретные временные интервалы.

Промежуточная аттестация по результатам изучения дисциплины проходит:

- в шестом семестре в форме экзамена.

Перечень компетенций в зависимости от этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

Код компетенции/ наименование компетенции	Этап формирования*	Наименование дисциплин, практик, ГИА обеспечивающих формирование компетенции
ОПК-2 Способен осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач	промежуточный	Математический анализ, Линейная алгебра, Теория вероятностей и математическая статистика, Статистика, Бухгалтерский учет и анализ, Маркетинг, Экономическая информатика, Основы финансовых вычислений, Профессиональные компьютерные системы, Международные валютно-кредитные отношения, Международный бизнес, Современные финансовые рынки , Логика, Информационные системы в экономике, Информационные технологии в менеджменте, Экономика недвижимости, Учебная практика, Практика по получению первичных профессиональных умений и навыков, в том числе первичных умений и навыков научно-исследовательской деятельности, Производственная практика, Практика по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности, Научно - исследовательская работа, Преддипломная практика, Подготовка к сдаче и сдача государственного экзамена, Защита выпускной квалификационной работы, включая подготовку к процедуре защиты и процедуру защиты, Анализ фондовых рынков
ОПК-3 Способен выбрать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, проанализировать результаты расчетов и обосновать полученные выводы	промежуточный	Математический анализ, Линейная алгебра, Теория вероятностей и математическая статистика, Методы оптимальных решений, Эконометрика, Статистика, Маркетинг, Макроэкономическое планирование и прогнозирование, Экономическая информатика, Профессиональные компьютерные системы, Современные финансовые рынки , Информационные системы в экономике, Информационные технологии в менеджменте, Учебная практика, Практика по получению первичных профессиональных умений и навыков, в том числе первичных умений и навыков научно-исследовательской деятельности, Производственная практика, Практика по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности, Преддипломная практика, Защита выпускной квалификационной работы, включая подготовку к процедуре защиты и процедуру защиты

ПК-4 Способен на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и экономические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты	промежуточный	Математический анализ, Методы оптимальных решений, Микроэкономика, Макроэкономика, Эконометрика, Финансы, Деньги, кредит, банки, Менеджмент, Мировая экономика и международные экономические отношения, Макроэкономическое планирование и прогнозирование, Культурология, Политология, Современные финансовые рынки , Логика, История Сибири, Экономика предприятия, Стратегическое планирование, Производственная практика, Научно-исследовательская работа, Преддипломная практика, Подготовка к сдаче и сдача государственного экзамена, Защита выпускной квалификационной работы, включая подготовку к процедуре защиты и процедуру защиты
ПК-10 Способен использовать для решения коммуникативных задач современные технические средства и информационные технологии	промежуточный	Методы оптимальных решений, Основы финансовых вычислений, Международный бизнес, Современные финансовые рынки , Таможенно-тарифное регулирование, Управление внешнеэкономической деятельностью, Экономика стран Азиатско-тихоокеанского региона, Учебная практика, Практика по получению первичных профессиональных умений и навыков, в том числе первичных умений и навыков научно-исследовательской деятельности, Производственная практика, Практика по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности, Преддипломная практика, Подготовка к сдаче и сдача государственного экзамена, Защита выпускной квалификационной работы, включая подготовку к процедуре защиты и процедуру защиты

Перечень основных средств для проведения контрольной аттестации (текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации):

- опросы;
- практические задания;
- письменные домашние задания (задачи);
- тесты;
- вопросы к экзамену.

Фонд оценочных средств, включающий виды средств, описание: процедур текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся, методов и средств оценивания уровня подготовки по дисциплине, критериев оценивания, а также вопросы к экзамену по дисциплине, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы, приведены в Приложении 4 к рабочей программе.

5.1. Описание показателей, критериев и шкал оценивания компетенций в рамках дисциплины.

5.1.1. Уровни сформированности компетенций представлены в таблице.

№ п\п	Уровни сформированности компетенций	Оценки сформированности компетенций	Общая характеристика сформированности компетенции	Критерии оценивания	Шкала переводов баллов в оценки (количество баллов)
1	2	3	4	5	6
1.	Компетенция не сформирована	Оценка «неудовлетворительно»/ не зачтено	Компетенция недостаточно сформирована. Имеющихся знаний, умений и навыков недостаточно для решения профессиональных задач в области профессиональной деятельности.	Не знает содержание основных теоретических тем дисциплины. Не умеет применять и использовать основной инструментарий (правила, формулы). Не владеет основными формами логического мышления, методами и средствами самоорганизации и самообразования правилами ведения диалога для решения задач межличностного и межкультурного взаимодействия.	Менее 50
2.	Пороговый (низкий) уровень сформированности компетенции	Оценка «удовлетворительно»/ зачтено	Сформированность компетенции соответствует минимальным требованиям базового уровня. Имеющихся знаний, умений и навыков достаточно для решения теоретических задач в области профессиональной деятельности.	Знает: Обучающийся демонстрирует не глубокие или разрозненные знания по основным темам дисциплины. Умеет: Слабо ориентироваться в методах и средствах самоорганизации и самообразования; применять и использовать основной инструментарий (правила, формулы). Владеет: Определенными формами логического мышления, методами и средствами самоорганизации и самообразования, правилами ведения диалога для решения задач межличностного и межкультурного взаимодействия; методами и средствами самоорганизации и самообразования.	От 50 до 70
3.	Базовый (средний) уровень сформированности	Оценка «хорошо»/ зачтено	Сформированность компетенции в целом соответствует	Знает: Обучающийся демонстрирует основные знания по всем темам дисциплины. Умеет: Применять основной	От 71 до 84

	ванности компетенции		<p>требованиям порогового уровня.</p> <p>Имеющихся знаний, умений и навыков достаточно для решения стандартных теоретических и профессиональных задач в области профессиональной деятельности.</p>	<p>инструментарий (правила, формулы) для решения практических задач.</p> <p>Ориентироваться в методах и средствах самоорганизации и самообразования.</p> <p>Владеет: Навыками логического мышления, методами и средства самоорганизации и самообразования; различными коммуникативными стратегиями, правилами ведения диалога для решения задач межличностного и межкультурного взаимодействия.</p>	
4.	Повышенный (высокий) уровень сформированности компетенции	Оценка «отлично»/зачтено	<p>Сформированность компетенции полностью соответствует требованиям по дисциплине.</p> <p>Имеющихся знаний, умений и навыков и мотивации в полном объеме достаточно для решения сложных практических и профессиональных задач в области профессиональной деятельности.</p>	<p>Знает: Полностью владеет основными темами дисциплины и без пробелов, компетенции полностью сформированы, все предусмотренные программой обучения учебные задания выполнены.</p> <p>Обучающийся демонстрирует знание и применение основного инструментария (правила, законы, формулы) для решения теоретических, практических и профессиональных задач, различные коммуникативные стратегии в устной и письменной формах, правила ведения диалога.</p> <p>Умеет: Ориентироваться в методах и средствах самоорганизации и самообразования; в основах и самостоятельной, индивидуальной и коллективной работы при выполнении учебных заданий; в знаниях основных форм логического мышления, различных коммуникативных стратегиях в устной и письменной формах, в правилах ведения диалога.</p>	От 85 до 100

6. Методические материалы по видам занятий для обучающихся по освоению дисциплины

Методические материалы по освоению дисциплины «Современные финансовые рынки» направлены на оказание методической помощи обучающимся в выполнении различных видов работ и представляют собой комплекс рекомендаций и разъяснений, позволяющих обучающемуся оптимальным образом организовать аудиторную и внеаудиторную самостоятельную работу.

Методические материалы (методические указания для самостоятельной работы обучающихся, методические указания к практическим (семинарским) занятиям, методические указания по выполнению контрольных работ для студентов заочной формы обучения и др.) и иные документы, разработанные образовательной организацией для обеспечения образовательного процесса размещены в электронно-библиотечной системе института в электронно-библиотечной системе института <https://ibs.sibup.ru/>, в электронной информационно-образовательной среде института <http://do.sibup.ru/> и на сайте института в разделе «Образование».

7. Обеспечение образовательного процесса для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья

Для осуществления процедур текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине «Современные финансовые рынки» для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья создаются ФОС, адаптированные с учетом особенностей таких лиц и позволяющие оценить их уровень сформированности компетенций, заявленных в программе.

Форма проведения текущей успеваемости, промежуточной аттестации для студентов-инвалидов устанавливается с учетом индивидуальных психофизических особенностей (устно, письменно на бумаге, письменно на компьютере, в форме тестирования и т.п.). При необходимости студенту-инвалиду предоставляется дополнительное время для подготовки ответа на экзамене.

Обучающимся с ограниченными возможностями здоровья и инвалидностью библиотекой предоставляется удаленный доступ к ресурсам:

- образовательная платформа Юрайт (urait.ru);
- электронно-библиотечная система znanium.com (znanium.com);
- eLIBRARY.RU – крупнейшая в России электронная библиотека научных публикаций, обладающая богатыми возможностями поиска и получения информации ([НЭБ eLIBRARY.RU](http://elibrary.ru));
- CYBERLENINKA - научная электронная библиотека, построенная на парадигме открытой науки (Open Science), основными задачами которой является популяризация науки и научной деятельности, общественный контроль качества научных публикаций, развитие междисциплинарных исследований, современного института научной рецензии, повышение цитируемости российской науки и построение инфраструктуры знаний.

8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины включают в себя:

- перечень основной литературы;
- перечень дополнительной учебной и учебно-методической литературы;
- учебно-методическое обеспечение для самостоятельной работы;
- ресурсы сети интернет;
- информационные справочные системы и профессиональные базы данных.

В ходе реализации целей и задач дисциплины обучающиеся могут использовать следующие электронные источники информации: образовательная платформа Юрайт (urait.ru), электронно-библиотечная система znanium.com (znanium.com), eLIBRARY.RU – крупнейшая в России электронная библиотека научных публикаций, обладающая богатыми возможностями

поиска и получения информации ([НЭБ eLIBRARY.RU](http://НЭБ_eLIBRARY.RU)), CYBERLENINKA - научная электронная библиотека, построенная на парадигме открытой науки (Open Science), ЭИОС института.

Справка о литературном обеспечении по дисциплине представлена в Приложении 1.

9. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Материально-технические условия полностью соответствуют установленным требованиям ФГОС при реализации рабочей программы. Помещения представляют собой учебные аудитории для проведения учебных занятий, предусмотренных программой бакалавриата, оснащены оборудованием и техническими средствами обучения, состав которых определен рабочей программой дисциплины. Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа к ЭИОС института. Институт обеспечен необходимым комплектом лицензионного: Windows, Microsoft Office, антивирус Dr.Web и свободно распространяемого программного обеспечения: PDF Sumatra Pdf, браузер Mozilla Firefox, архиватор 7-zip. Обучающимся обеспечен доступ, в том числе в случае применения электронного обучения, дистанционных образовательных технологий, к современным профессиональным базам данных и информационным справочным системам, состав которых определен рабочей программой дисциплины и подлежит при необходимости обновлению. Материально-техническое обеспечение дисциплины представлено в справке о материально-техническом обеспечении и оснащенности образовательного процесса (Приложение 2).

10. Приложения к рабочей программе дисциплины

В приложениях к рабочей программе дисциплины размещаются:

- справка о литературном обеспечении по дисциплине (приложение 1);
- справка о материально-техническом обеспечении и оснащенности образовательного процесса (Приложение 2);
- аннотация рабочей программы дисциплины (Приложение 3);
- фонд оценочных средств (Приложение 4).

11. Дополнения и изменения в рабочей программе дисциплины

В рабочую программу дисциплины «Современные финансовые рынки» основной профессиональной образовательной программы для обучающихся по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, направленность (профиль) образовательной программы Мировая экономика, в установленном порядке внесены изменения и дополнения, осуществляемые в рамках планового ежегодного обновления:

1. Учебные и учебно-методические издания, электронно-образовательные ресурсы, которые отражены в Приложении 1.
2. Информационные справочные системы и профессиональные базы данных отражены в Приложении 1.
3. Материально-техническое обеспечение дисциплины, перечень лицензионного программного обеспечения, которые отражаются в Приложении 2.
4. Фонд оценочных средств дисциплины Приложение 4.

Справка

о литературном обеспечении по дисциплине «Современные финансовые рынки» основной профессиональной образовательной программы высшего образования программы бакалавриата для обучающихся по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика», направленность (профиль) образовательной программы «Мировая экономика»

№ п/п	Наименование	Место хранения/ электронный адрес	Кол-во экземпляров/ точек доступа
Перечень основной литературы			
1.	Деньги, кредит, банки. Финансовые рынки. В 2 ч. Часть 1 : учебник для вузов / С. Ю. Янова [и др.] ; ответственный редактор С. Ю. Янова. – Москва : Издательство Юрайт, 2020. – 299 с.	ЭБС Юрайт https://urait.ru/bcode/453910 - режим доступа: по подписке	-
2.	Деньги, кредит, банки. Финансовые рынки. В 2 ч. Часть 2 : учебник для вузов / С. Ю. Янова [и др.] ; ответственный редактор С. Ю. Янова. – Москва : Издательство Юрайт, 2020. – 306 с.	ЭБС Юрайт https://urait.ru/bcode/455616 - режим доступа: по подписке	-
3.	Звонова, Е. А. Международный финансовый рынок: учебник / Е. А. Звонова, В. К. Бурлачков, В. А. Галанов ; под ред. В. А. Слепова. – 2-е изд., перераб. и доп. – Москва : Магистр : НИЦ ИНФРА-М, 2014. – 368 с.	ЭБС ZNANIUM.COM https://new.znanium.com/catalog/product/437522 - режим доступа: по подписке	-
4.	Мэрфи, Д. Межрыночный анализ: Принципы взаимодействия финансовых рынков / Д. Мэрфи. – Москва : Альпина Пабли., 2016. – 299 с.	ЭБС ZNANIUM.COM https://new.znanium.com/catalog/product/914314 - режим доступа: по подписке	-
5.	Чижик, В. П. Финансовые рынки и институты : учеб. пособие / В. П. Чижик. – Москва : ФОРУМ : ИНФРА-М, 2017. – 384 с.	ЭБС ZNANIUM.COM https://new.znanium.com/catalog/product/910150 - режим доступа: по подписке	-
Перечень дополнительной литературы			
1.	Азбука частного инвестора: путеводитель по финансовому рынку : практическое руководство / В. А. Зверев, А. В. Зверева, С. Г. Евсюков, Д. П. Никитина. – 4-е изд. – Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2019. – 248 с.	ЭБС ZNANIUM.COM https://new.znanium.com/catalog/product/1093001 - режим доступа: по	-

		подписке	
2.	Кириянов, И. В. Финансовый рынок: Рынок ценных бумаг : учебное пособие / И. В. Кириянов, С. Н. Часовников. - Москва : НИЦ ИНФРА-М, 2014. - 281 с.	ЭБС ZNANIUM.COM https://new.znanium.com/catalog/product/488348 - режим доступа: по подписке	-
3.	Евсин, М. Ю. Финансовые рынки. Практикум : учебное пособие / М. Ю. Евсин, В. А. Спесивцев. – Москва : ИНФРА-М, 2020. – 168 с.	ЭБС ZNANIUM.COM https://new.znanium.com/catalog/product/1013015 - режим доступа: по подписке	-
Информационные справочные системы и профессиональные базы данных			
1.	Znanium.com: Электронно-библиотечная система	http://znanium.com/	Внешняя сеть
2.	Юрайт: Образовательная платформа	https://urait.ru/	Внешняя сеть
3.	Elibrary.ru: Научная электронная библиотека	http://elibrary.ru/	Внешняя сеть
4.	КиберЛенинка: научная электронная библиотека	https://cyberleninka.ru/	Внешняя сеть
5.	КонсультантПлюс: справочная правовая система	http://www.consultant.ru/	Локальная сеть института

Заведующий кафедрой



подпись

И.В. Молодан
инициалы, фамилия

СОГЛАСОВАНО:

Заведующий библиотекой



(подпись)

Л.П. Силина
инициалы, фамилия

Справка

о материально-техническом обеспечении и оснащенности образовательного процесса по дисциплине «Современные финансовые рынки» основной профессиональной образовательной программы высшего образования программы бакалавриата для обучающихся по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика», направленность (профиль) образовательной программы «Мировая экономика»

№ п/п	Наименование учебных предметов, курсов, дисциплин (модулей), практики, иных видов учебной деятельности, предусмотренных учебным планом образовательной программы/наименование специализированной лаборатории	Наименование помещений для проведения всех видов учебной деятельности, предусмотренной учебным планом, в том числе помещения для самостоятельной работы, с указанием перечня основного оборудования, учебно-наглядных пособий и используемого программного обеспечения	Адрес (местоположение) помещений для проведения всех видов учебной деятельности, предусмотренной учебным планом(в случае реализации образовательной программы в сетевой форме дополнительно указывается наименование организации, с которой заключен договор)
1.	Современные финансовые рынки	<p>402. Актальный зал</p> <p>Учебное демонстрационное оборудование и учебные наглядные пособия: доска маркерная -1шт., экран -1шт., проектор - 1шт., стол 65-шт., стул -130 шт., кафедра-1шт., компьютер системный блок -1шт., монитор -1шт.</p> <p>Проводной доступ сети. Microsoft Office 2007 Professional (Лицензия Microsoft № 42834298 от 05.10.2007 г. (бессрочно)). Антивирус Dr. Web (Сублицензионный договор № 528 от 107.03.2019г., приложение к договору от 28.04.2020г (срок действия ключа до 10.04.2021 г.)) (ключ обновляется ежегодно). Браузер Mozilla Firefox (Mozilla Public License (бессрочно)). Программа просмотра файлов PDF SumatraPDF (GNU General Public License v3 (бессрочно)). Архиватор 7-zip (Лицензия GNU Lesser General Public License (бессрочно))</p>	Красноярский край, г. Красноярск, ул. Московская, 7 «А»

		<p>110 Библиотека. Читальный зал Стол компьютерный - 11шт., стул -11шт., компьютер системный блок -11шт., монитор - 11шт., принтер -1шт. стеложки с учебной литературой – 26шт., газетница -1шт. Учебное место для инвалидов: стол -1шт., стул -1шт., настольная лупа -1шт., 1 – клавиатура с системой «Брайля» -1шт., колонки D i ALOQW -203 -2 шт. Электронные учебники, словари, энциклопедии, тренинговые и другие программы на DVD -дисках; электронные библиотеки ЭБС Znanium и Юрайт; электронный каталог. Программное обеспечение, Windows 10 Pro 64bit Russian DSP OEI DVD (бессрочно) (OEM версия распространяется вместе с комплектующими). Пакет офисных программ Microsoft Office 2007 Professional (Лицензия Microsoft № 42834298 от 05.10.2007 г. (бессрочно)) Система автоматизации библиотек ИРБИС64 (Договор № 49 от 28.12.2019 г.) (подписка обновляется ежегодно) (подписка обновлена 28.02.2023г.) Антивирус Dr. Web (Сублицензионный договор № 528 от 07.03.2019 г., приложение к договору от 28.04.2020 г. (срок действия ключа до 10.04.2022 г.)) (ключ обновляется ежегодно)</p>	
--	--	--	--

Заключение о соответствии объекта защиты обязательным требованиям пожарной безопасности от 14 мая 2013 г. № 1104-2236, выданное главным управлением МЧС России по Красноярскому краю, управлением надзорной деятельности от 14 мая 2013 г., бессрочное.

Заведующий кафедрой


(подпись)

И.В. Молодан
инициалы, фамилия

СОГЛАСОВАНО:
Проректор по АХЧ и ОВ


(подпись)

Г. Ф. Субботина
инициалы, фамилия

Начальник ИТО


(подпись)

Т.А. Попов
инициалы, фамилия

**Аннотация
рабочей программы дисциплины
«Современные финансовые рынки»**

по направлению подготовки 38.03.01 Экономика

направленность (профиль) образовательной программы Мировая экономика

дисциплина реализуется на кафедре мировой экономики

Общая трудоемкость освоения дисциплины составляет: 43.е./144 часов.

Программой дисциплины предусмотрены:

очная форма обучения: лекционные занятия (16 часа), практические занятия (32 часа), самостоятельная работа обучающегося (60 часов) и контроль (35,7 часа).

Место дисциплины в структуре ООП.

«Современные финансовые рынки» относится к Части, формируемой участниками образовательных отношений Блока 1 «Дисциплины (модули)» учебных планов по программам подготовки бакалавров по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, направленность (профиль) образовательной программы Мировая экономика.

Цель изучения дисциплины «Современные финансовые рынки» – формирование теоретических знаний и практических навыков в области функционирования международных финансовых рынков.

Задачи дисциплины:

- ♦ получение целостного представления о финансовых рынках, истории их формирования и функционирования в мировой экономике;
- ♦ формирование практических умений для работы на финансовых рынках;
- ♦ изучение финансового механизма;
- ♦ расширение знаний в области международного права.

Дисциплина «Современные финансовые рынки» изучается на третьем курсе по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, направленность (профиль) образовательной программы Мировая экономика. Содержание дисциплины охватывает круг вопросов, связанных с возникновением, становлением и развитием международных финансовых рынков, их современного состояния, функционирования анализа и прогнозирования, международного кредитования.

Дисциплина нацелена на формирование компетенций:

УК-10 – Способен принимать обоснованные экономические решения в различных областях жизнедеятельности

УК - 10.1. Понимает базовые принципы функционирования экономики и экономического развития, целей и формы участия государства в экономике.

УК - 10.2. Применяет методы личного финансового планирования для достижения текущих и долгосрочных финансовых целей, контролирует собственные экономические и финансовые риски.

ПК-3 – Способен использовать нормативно-правовую базу национального, международного и наднационального регулирования для реализации внешнеэкономической деятельности

ПК – 3.1 – использует навыки работы с международно-правовыми актами;

ПК-3.2 – применяет нормы международного права при анализе проблем современных международных отношений;

ПК-3.3 – Подготавливает необходимую документацию для заключения внешнеторгового контракта в соответствии с требованиями законодательства РФ и международных актов;

ПК – 3.4 – Выявляет особенности деятельности организации на мировом рынке;

ПК – 3.5 – анализирует основные мировые и российские тенденции изменения законодательства, регулирующего экономическую и финансовую деятельность

ПК-5 – Способен использовать отечественный и зарубежный опыт в сфере внешней торговли товарами и услугами, а также практику проведения международных валютных, финансовых и кредитных операций

Преподавание дисциплины предусматривает следующие формы организации учебного процесса: лекции, практические занятия, самостоятельная работа студента.

ПК – 5.2 – проводит исследование международного финансового рынка и изучение предложений финансовых услуг (в том числе действующих правил и условий, тарифной политики и действующих форм документации)

Преподавание дисциплины предусматривает следующие **формы организации учебного процесса:** лекции, практические занятия, самостоятельная работа студентов, консультации.


Программой дисциплины предусмотрены следующие **виды контроля:** текущий контроль успеваемости в форме опросов, в форме тестирования и промежуточный контроль в форме экзамена.

Автономная некоммерческая организация высшего образования
«Сибирский институт бизнеса, управления и психологии»

Экономический факультет

УТВЕРЖДАЮ

Председатель научно-методического
совета факультета/направления
Протокол №«8» 25 мая 2023 г.


(подпись)

Полубелова М.В.
И.О. Фамилия

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной
аттестации обучающихся по дисциплине

Б1.В.10 СОВРЕМЕННЫЕ ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ

Направление подготовки 38.03.01 Экономика

Направленность (профиль) образовательной программы Мировая экономика

Квалификация выпускника Бакалавр

Программа подготовки Бакалавриат

Форма обучения Очная

Кафедра Мировой экономики

Разработчик(и) Е.Э. Лобанова к.экон.н., доцент, профессор
(И.О. Фамилия, ученая степень, ученое звание, должность)


(подпись)

Рассмотрено на заседании кафедры Мировой экономики

Протокол № 9 от 18 мая 2023 г.

Зав. кафедрой Молодан И.В.

(Ф.И.О.)


(подпись)

Красноярск, 2023

1. Описание назначения и состава ФОС по дисциплине

1.1. Цели и задачи формирования ФОС по дисциплине «Современные финансовые рынки»:

Целью создания ФОС является установление соответствия уровня подготовки выпускников в период обучения по дисциплине путем оценивая уровня сформированности компетенций на соответствие требованиям ФГОС по реализуемым направлениям подготовки.

Задачами ФОС являются:

1. Контроль и управление процессом приобретения выпускниками на разных этапах обучения необходимых знаний, умений, навыков и уровня сформированности компетенций, определенных ФГОС по направлению.

2. Управление процессом требований к оцениванию качества освоения образовательной программы.

3. Совершенствование самоконтроля и самоподготовки обучающихся.

4. Оценка достижений обучающихся в процессе изучения дисциплины с определением результатов как положительных, так и отрицательных и планированием необходимых предупреждающих и (или) корректирующих мероприятий.

5. Систематическая оценка совокупности запланированных результатов обучения по дисциплине обеспечивающей формирование у выпускника всех компетенций, установленных образовательной программой.

6. Обеспечение соответствия результатов обучения задачам будущей профессиональной деятельности через совершенствование традиционных и внедрение инновационных методов обучения в образовательный процесс института.

2. Перечень компетенций, подлежащих формированию в рамках дисциплины

Общепрофессиональные (ОПК):

ОПК-2 Способен осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач;

ОПК-3 Способен выбрать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, проанализировать результаты расчетов и обосновать полученные выводы;

Профессиональные (ПК):

ПК-4 Способен на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и экономические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты;

ПК-10 Способен использовать для решения коммуникативных задач современные технические средства и информационные технологии

Показатели и критерии оценивания компетенций на различных этапах их формирования, шкалы оценивания

Перечень компетенций в зависимости от этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

Компетенция	Оценочные средства
способность осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач (ОПК-2);	Контрольные вопросы к разделам, задания для текущего контроля, примерная тематика докладов, контрольный тест по курсу, выполнение контрольной работы.
способность выбрать инструментальные	Контрольные вопросы к разделам, задания для текущего

средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, проанализировать результаты расчетов и обосновать полученные выводы (ОПК-3);	контроля, задания для анализа с выданными материалами.
способность на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты (ПК-4);	Контрольные вопросы к разделам, задания для текущего контроля, примерная тематика докладов, контрольный тест по курсу, практические задания на моделирование портфелей.
способность использовать для решения коммуникативных задач современные технические средства и информационные технологии (ПК-10).	Контрольные вопросы к разделам, задания для текущего контроля, выполнение заданий в специализированных программах и компьютерной обработки

Показатель 1. Качество выполнения экспресс-опроса

Данный показатель применяется в процессе текущего контроля успеваемости студентов, в том числе при модульно-рейтинговая система оценки успеваемости

Критерии оценивания	Шкала оценивания, баллы / % по МРСО
удельный вес правильных ответов менее 50 %	0-2 балла/ 0%-18 %
удельный вес правильных ответов от 50 % до 70 %	3 балла / 27%
удельный вес правильных ответов от 71 % до 84%	4 балла / 36 %
удельный вес правильных ответов от 85 %	5 баллов /45%

Показатель 2. Качество выполнения домашнего задания

Данный показатель применяется в процессе текущего контроля успеваемости студентов, в том числе при модульно-рейтинговая система оценки успеваемости

Критерии оценивания	Шкала оценивания, баллы/% по МРСО
удельный вес правильных ответов менее 50 %	0-2 балла /0%-8 %
удельный вес правильных ответов от 50 % до 70 %	3 балла/ 12 %
удельный вес правильных ответов от 70 % до 84%	4 балла/ 16 %
удельный вес правильных ответов от 85 %	5 баллов/ 20%

Показатель 3. Качество выполнения теста

Данный показатель применяется в процессе текущего контроля успеваемости студентов, в том числе при модульно-рейтинговая система оценки успеваемости

Критерии оценивания	Шкала оценивания, баллы / % по МРСО
удельный вес правильных ответов менее 50 %	0-2 балла/ 0%
удельный вес правильных ответов от 50 % до 70	3 балла/ 3%

%	
удельный вес правильных ответов от 71 % до 84%	4 балла/ 4%
удельный вес правильных ответов от 85 %	5 баллов/ 5%

Показатель 4. Качество ответа на экзаменационные вопросы.

Данный показатель применяется в процессе промежуточной аттестации обучающихся на экзамене, завершающем изучение дисциплины. Оценка экзамена производится по 4-балльной системе на основе следующих критериев:

Критерии оценивания	Шкала оценивания, баллы
Ответ на теоретический вопрос полный, правильный, показывает, что обучающийся правильно и исчерпывающе раскрывает содержание вопроса, конкретизирует его фактическим материалом. Практическое (творческое) задание к экзамену выполнено полностью в полном соответствии с образцом	5
Ответ на теоретический вопрос удовлетворяет уже названным требованиям, но есть неточности в изложении фактов, определении понятий, объяснении взаимосвязей. Однако, обучающийся может легко устранить неточности по дополнительным и наводящим вопросам экзаменатора. Практическое (творческое) задание к экзамену выполнено полностью в соответствии с образцом, однако имеются небольшие неточности	4
Ответ на теоретический вопрос в целом правильный, но нечётко формулируются понятия, имеют место затруднения в самостоятельном объяснении взаимосвязей, непоследовательно излагается материал. Практическое (творческое) задание к экзамену выполнено полностью, но имеются некоторые неточности, которые обучающийся не может устранить	3
При ответе на теоретический вопрос обнаружено значительное незнание основного фактического материала, грубые ошибки в определении понятий, затруднения в понимании взаимосвязей; отказ ответов на дополнительные вопросы. Практическое (творческое) задание к экзамену не выполнено или не соответствует образцу	2

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

Набор тестов для экспресс-опросов по дисциплине «Современные финансовые рынки» направления подготовки 38.03.01 (080100) Экономика (профиль Мировая экономика)

Итоговый тест

№1. Самый ликвидный финансовый рынок.

1. Фондовый рынок 2. Валютный рынок

3. Срочный рынок

4. Страховой рынок

№2. Акции и облигации являются основными инструментами.

- | | |
|--------------------|--------------------|
| 1. Фондового рынка | 2. Валютного рынка |
| 3. Срочного рынка | 4. Денежного рынка |

№3. К “бессрочным” финансовым инструментам можно отнести

- | | |
|------------|--------------|
| 1. Акции | 2. Облигации |
| 3. Вексель | 4. Фьючерс |

№4. Рынок производных финансовых инструментов по-другому называется.

- | | |
|-------------------|-------------------|
| 1. Фондовый рынок | 2. Валютный рынок |
| 3. Срочный рынок | 4. Денежный рынок |

№5. Рынок, характеризующийся круглосуточной работой, кроме субботы и воскресенья.

- | | |
|-------------------|--------------------|
| 1. Фондовый рынок | 2. Валютный рынок |
| 3. Срочный рынок | 4. Страховой рынок |

№6. Институты взаимного кредитования.

- | | |
|-----------------------|-------------------------|
| 1. Коммерческие банки | 2. Хеджевые фонды |
| 3. Кредитные союзы | 4. Инвестиционные фонды |

№7. Институт, образуемый обычно в форме ограниченного товарищества между управляющим (главным лицом) и инвесторами (пассивными партнерами).

- | | |
|-------------------------------|-------------------|
| 1. Паевый инвестиционный фонд | 2. Венчурный фонд |
| 3. Взаимный фонд | 4. Хеджевый фонд |

№8. Средства этих институтов служат основным источником акционерного капитала для организации новых предприятий, внедрения новых технологий или исследований.

- | | |
|-----------------------|-------------------|
| 1. Коммерческие банки | 2. Венчурный фонд |
| 3. Взаимный фонд | 4. Хеджевый фонд |

№9. Институты, выполняющие функцию прямого финансирования на финансовых рынках.

- | | |
|-------------------------|------------------------|
| 1. Инвестиционные банки | 2. Брокерские компании |
| 3. Венчурные фонды | 4. Финансовые компании |

№10. Финансовый рынок, на котором обращаются фьючерсные и опционные инструменты.

- | | |
|-------------------|-------------------|
| 1. Фондовый рынок | 2. Валютный рынок |
| 3. Срочный рынок | 4. Денежный рынок |

№11. Вексель является инструментом финансового рынка.

- | | |
|-------------------|-------------------|
| 1. Фондовый рынок | 2. Валютный рынок |
| 3. Срочный рынок | 4. Денежный рынок |

№12. Институт, основной целью которого выступает получение прибыли выше среднерыночной.

- | | |
|------------------------|--------------------------------|
| 1. Коммерческие банки | 2. Паявые инвестиционные фонды |
| 3. Брокерские компании | 4. Хеджевые фонды |

№13. Фундаментальной теоретической основой риска на финансовых рынках является.

1. Теория эффективности 2. Теория волатильности
3. Теория хаоса 4. Теория вероятности

№14. Фундаментальной теоретической основой формирования цен активов на рынке является.

1. Закон спроса и предложения 2. Теория эффективности
3. Теория соотношения риска и доходности 4. Закон временной стоимости денег

№15. Теория, опирающаяся на законы природы.

1. Теория волатильности 2. Теория вероятности
3. Теория детерминированности 4. Теория эффективности

№16. Теория, описывающая поведение нелинейных динамических систем.

1. Теория игр 2. Теория вероятности
3. Теория хаоса 4. Теория эффективности

№17. Документ, безусловное денежное обязательство должника уплатить после наступления обозначенного в нем срока определенную сумму денег его владельцу.

1. Чек 2. Вексель
3. Аккредитив 4. Варрант

№18. Документ установленной формы, содержащий приказ владельца текущего счета в банке о выплате по его предъявлении обозначенной в нем суммы денег.

1. Чек 2. Вексель
3. Аккредитив 4. Варрант

№19. Соглашение об обмене активов и пассивов на аналогичные активы или пассивы с целью продления или сокращения сроков погашения или с целью повышения или снижения процентной ставки с тем, чтобы максимально увеличить доходы или минимизировать издержки финансирования.

1. Фьючерс 2. Форвард
3. Депозитарная расписка 4. Своп

№20. Производная ценная бумага, выпущенная на бумаги иностранного эмитента.

1. Варрант 2. Опцион
3. Депозитарная расписка 4. Стрип

№21. Показатель, который определяется как отношение текущих активов к краткосрочным обязательствам.

1. Коэффициент текущей ликвидности 2. Коэффициент финансовой устойчивости
3. Коэффициент оборачиваемости активов 4. Коэффициент рентабельности активов

№22. Аналитический показатель, равный объему прибыли до вычета расходов по процентам, уплаты налогов и амортизационных отчислений. Показатель служит для оценки того, насколько прибыльна основная деятельность компании.

1. Рентабельность ROAE (собственного капитала) 2. Рентабельность ROACE (вложенного капитала)
3. Показатель EVA (экономической прибыли) 4. Показатель EBITDA

№23. Показатель “кратное прибыли”, он демонстрирует, сколько готовы платить инвесторы за один рубль чистой прибыли.

- | | |
|---------|--------|
| 1. P/E | 2. P/S |
| 3. P/BV | 4. EV |

№24. Показатель показывает отношения капитализации к собственному капиталу.

- | | |
|---------|--------|
| 1. P/E | 2. P/S |
| 3. P/BV | 4. EV |

№25. Показатель, измеряющий общий риск рынка или актива, которым нельзя управлять.

- | | |
|-------------------------------|---|
| 1. Стандартное отклонение Dev | 2. Коэффициент бета |
| 3. Показатель VaR | 4. Показатель максимальной просадки MDD |

№26. Показатель, измеряющий рыночный риск только актива, которым можно управлять.

- | | |
|-------------------------------|---|
| 1. Стандартное отклонение Dev | 2. Коэффициент бета |
| 3. Показатель VaR | 4. Показатель максимальной просадки MDD |

№27. Показатель, измеряющий нерыночную составляющую доходности актива.

- | | |
|----------------------|----------------------|
| 1. Коэффициент альфа | 2. Коэффициент бета |
| 3. Профит фактор | 4. Коэффициент Шарпа |

№28. Показатель, измеряющий степень синхронности изменений двух активов или рынка с активом по отношению к друг другу.

- | | |
|---------------------------|-----------------------------|
| 1. Коэффициент корреляции | 2. Коэффициент Шарпа |
| 3. Показатель дисперсии | 4. Коэффициент детерминации |

№29. Показатель, измеряющий эффективность инвестирования в актив по отношению к альтернативному способу.

- | | |
|--------------------------------|--------------------------|
| 1. Профит фактор | 2. Фактор восстановления |
| 3. Коэффициент доходность/риск | 4. Коэффициент Шарпа |

№30. Показатель, измеряющий перекрытия прибылью максимального убытка.

- | | |
|----------------------|--------------------------------|
| 1. Коэффициент альфа | 2. Фактор восстановления |
| 3. Профит фактор | 4. Коэффициент доходность/риск |

№31. Укажите правильное утверждение в отношении структурной соподчиненности различных сегментов финансового рынка:

1. Денежный рынок является составной частью рынка капиталов
2. Кредитный рынок является составной частью денежного рынка
3. Валютный рынок является составной частью рынка капиталов
4. Денежный рынок и рынок капиталов являются составными частями фондового рынка

№32. Укажите правильное утверждение о соотношении риска и дохода при инвестировании на финансовом рынке:

1. Чем ниже риск, тем выше должен быть ожидаемый доход
2. Чем выше риск, тем выше должен быть ожидаемый доход
3. Чем выше доход, тем ниже должен быть предполагаемый риск
4. Риск и доход не связаны между собой

№33. Получение прибыли за счет разницы цен на одинаковые финансовые активы на различных рынках называется:

1. Спекуляция
2. Хеджирование
3. Арбитраж
4. Диверсификация

№34. Как называется высокорискованное вложение капитала, которое в перспективе позволяет получить высокую доходность?

1. Коллективное инвестирование
2. Венчурное инвестирование
3. Косвенное инвестирование
4. Портфельное инвестирование

№35. Способ снижения совокупного риска портфеля финансовых активов (ценных бумаг), заключающийся в распределении инвестиций между различными активами, входящими в него, называется:

1. Диверсификация
2. Секьюритизация
3. Арбитраж
4. Коллективное инвестирование

№36. Страхование рисков получения убытков от изменения цен на финансовые активы, процентных ставок или валютных курсов называется:

1. Хеджирование
2. Арбитраж
3. Секьюритизация
4. Диверсификация

Инструкция к проверке тестовых заданий.

№ задания	Ответ	№ задания	Ответ
1	2	16	3
2	1	17	2
3	1	18	1
4	3	19	4
5	2	20	3
6	3	21	1
7	4	22	4
8	2	23	1
9	1	24	3
10	3	25	1
11	4	26	2
12	4	27	1
13	2	28	1
14	1	29	4
15	3	30	2
31	2	32	2
33	3	34	2
35	1	36	1

Тематика рефератов

1. Мировой финансовый рынок.

2. Мировые финансовые кризисы.
3. Современный фондовый рынок России.
4. Фондовые рынки зарубежных стран.
5. Рынок срочных контрактов.
6. Современный валютный рынок.
7. Международный страховой рынок.
8. Современное состояние страхового рынка в России.
9. Денежный рынок.
10. Управление капиталом на финансовых рынках.
11. Страхование и управление рисками на финансовых рынках.
12. Портфельная теория управления активами на финансовых рынках.

Аудиторные задания (кейс 1)

1. Провести статистический анализ финансовых рынков и сделать выводы.

Таблица 1 - Исходные данные для анализа международного валютного рынка

Год	Месяц	Валютный рынок (индекс долл.)	Фондовый рынок США (S&P500)	Фондовый рынок России (ММВБ)	Рынок Золота (долл. за унцию)
2011	Январь	77,85	1282,20	1723,42	1333,80
	Февраль	76,96	1326,50	1777,84	1410,90
	Март	76,20	1321,80	1813,59	1431,48
	Апрель	73,16	1359,10	1741,85	1562,11
	Май	74,64	1343,50	1666,31	1534,78
	Июнь	74,67	1314,50	1666,60	1499,88
	Июль	74,03	1287,30	1705,18	1625,23
	Август	74,11	1217,00	1546,06	1823,55
	Сентябрь	79,26	1124,40	1279,24	1622,95
	Октябрь	76,60	1241,30	1498,60	1709,94
	Ноябрь	78,41	1244,60	1499,62	1749,01
	Декабрь	80,62	1251,40	1402,03	1562,51
2012	Январь	79,39	1306,50	1510,91	1736,50
	Февраль	78,84	1359,00	1594,32	1696,25
	Март	79,11	1402,70	1518,26	1668,29
	Апрель	78,82	1395,20	1470,00	1663,55
	Май	83,12	1305,70	1312,24	1559,65
	Июнь	81,78	1355,80	1386,85	1598,35
	Июль	82,69	1372,50	1406,36	1614,42
	Август	81,21	1404,20	1422,35	1691,65
	Сентябрь	80,03	1433,30	1459,07	1773,21
	Октябрь	79,96	1401,50	1423,46	1720,05
	Ноябрь	80,12	1413,70	1405,19	1713,50
	Декабрь	79,91	1400,70	1477,87	1662,48
2013	Январь	79,23	1495,70	1547,18	1663,58
	Февраль	82,02	1511,80	1487,46	1579,17
	Март	83,13	1563,60	1440,02	1596,54
	Апрель	81,73	1593,60	1385,60	1476,95
	Май	83,31	1629,80	1347,75	1384,86
	Июнь	83,39	1599,60	1330,91	1232,61
	Июль	81,71	1685,10	1375,93	1323,07
	Август	82,09	1629,60	1365,55	1393,91
	Сентябрь	80,29	1678,30	1464,15	1327,85
	Октябрь	80,30	1754,30	1509,62	1322,82
	Ноябрь	80,67	1803,80	1479,35	1251,52
	Декабрь	80,28	1841,10	1503,39	1202,75
	Январь	81,40	1782,59	1454,45	1240,10

2014	Февраль	79,72	1859,45	1444,71	1321,40
	Март	80,25	1872,34	1369,29	1283,40
	Апрель	79,53	1883,95	1306,01	1295,60
	Май	80,44	1923,57	1432,03	1249,70
	Июнь	79,82	1960,23	1476,38	1327,30
	Июль	81,53	1930,10	1379,61	1284,30
	Август	82,80	2003,37	1400,71	1287,70
	Сентябрь	86,03	1972,29	1411,07	1208,50
	Октябрь	87,02	2018,05	1488,47	1171,10
	Ноябрь	88,41	2067,56	1533,68	1175,20
	Декабрь	90,64	2058,90	1396,61	1184,10

Аудиторные задания (кейс 2)

Примерный вариант отображения итоговой числовой информации:

С сайта компании ОАО “Лукойл” скачайте последний опубликованный финансовый годовой отчет.

Используя информацию в отчете, заполните таблицы.

Укажите положительные и отрицательные моменты компании, анализируя финансовую отчетность.

Определите справедливую стоимость обыкновенных акций компании по анализу финансовой отчетности и рыночной стоимости бумаг.

Тематический тест для валютного рынка

Вариант I

№1. Какая из валютных пар записана неверно.

1. USD/JPY 2. CHF/USD
3. EUR/USD 4. GBP/USD

№2. Определить кросс-курс для валютной пары AUD/CAD, если AUD/USD=0.9320 и USD/CAD=1.0310

1. 0.9040 2. 1.1062
3. 0.9609 4. 0.0990

№3. Определить кросс-курс для валютной пары GBP/AUD, если GBP/USD=1.5480 и AUD/USD=0.9320

1. 1.6609 2. 0.6021
3. 1.4427 4. 0.6160

№4. Если кредитное плечо составляет 1:100, то с позиции маржи это означает.

1. 0,1% 2. 1%
3. 10% 4. 100%

№5. Для заключения сделки на \$100000 с использованием кредитного плеча 1:100, депозит должен быть

не меньше.

1. \$100 2. \$1000
3. \$10000 4. \$100000

№6. 21 июля в 12:30 по GMT (гринвичу) запланирован выход новостей из США. В какое время для

Красноярска выйдут новости.

- | | |
|----------|----------|
| 1. 12:30 | 2. 19:30 |
| 3. 05:30 | 4. 20:30 |

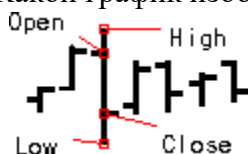
№7. На рынке по валютной паре EUR/USD сформировался бычий тренд, начавшийся с уровня 1.1800 и

находящийся на данный момент на уровне 1.3200. Какому уровню будет соответствовать возможная

коррекция по Фибоначчи в 38,2%. Уровень округлить до минимального пункта цены.

Ответ: _____

№8. Какой график изображен на рисунке.



- | | |
|--------------------|------------|
| 1. Линейный | 2. Баровый |
| 3. Японских свечей | 4. Каги |

№9. Какая свечная фигура из перечисленных подтверждает продолжение тенденции.

- | | |
|------------|----------------------|
| 1. Молот. | 2. Три метода |
| 3. Звезда. | 4. Завеса из облаков |

№10. Свеча медвежья.

- | | |
|------------|------------|
| 1. $C > O$ | 2. $C < O$ |
| 3. $L > O$ | 4. $L > C$ |

№11. Минимальное количество точек для построения восходящего канала.

- | | |
|------|------|
| 1. 1 | 2. 2 |
| 3. 3 | 4. 4 |

№12. Медвежий тренд определяется.

- | | |
|--------------------------|-------------------------|
| 1. Уровнем поддержки | 2. Линией поддержки |
| 3. Уровнем сопротивления | 4. Линией сопротивления |

№13. Минимальное количество точек для построения уровня.

- | | |
|------|------|
| 1. 1 | 2. 2 |
| 2. 3 | 4. 4 |

№14. Минимальное количество точек для построения линии.

- | | |
|------|------|
| 1. 1 | 2. 2 |
| 3. 3 | 4. 4 |

№15. Какая графическая фигура является разворотной.

- | | |
|-------------------|----------------|
| 1. Голова и плечи | 2. Треугольник |
| 3. Клин | 4. Флаг |

№16. Две сходящиеся линии консолидации образуют фигуру.

- | | |
|------------------|----------------|
| 1. Две вершины | 2. Треугольник |
| 3. Прямоугольник | 4. Флаг |

№17. Из перечисленных индикаторов выберите осциллятор.

- | | |
|--------------|---------|
| 1. Аллигатор | 2. RAVI |
| 3. RSI | 4. ADX |

№18. Какой индикатор имеет свойство конверта.

- | | |
|--------------|-----------------------|
| 1. Аллигатор | 2. Полосы Боллинджера |
| 3. RSI | 4. Стохастик |

№19. Если 24-периодная скользящая средняя ниже 48-периодной скользящей средней, а 12-периодная

скользящая средняя выше 24-периодной скользящей средней, то на рынке наблюдается.

- | | |
|----------------|--------------------------------|
| 1. Тренд вверх | 2. Разворот восходящего тренда |
| 3. Тренд вниз | 4. Разворот нисходящего тренда |

№20. Комбинация какого индикатора с графическим анализом позволяет увидеть дивергенцию.

- | | |
|--------------|-----------------------|
| 1. Аллигатор | 2. Линейная регрессия |
| 3. ADX | 4. RSI |

№21. Какой индикатор называется индикатором системы направлений.

- | | |
|--------|---------|
| 1. SMA | 2. RAVI |
| 3. RSI | 4. ADX |

№22. Фондовый индекс Германии.

- | | |
|--------|----------|
| 1. S&P | 2. DAX |
| 3. CAC | 4. FT-SE |

№23. Фондовый индекс Великобритании.

- | | |
|--------|----------|
| 1. S&P | 2. DAX |
| 3. CAC | 4. FT-SE |

№24. Показатель изменения числа занятых в несельскохозяйственном секторе США.

- | | |
|------------|--------|
| 1. Nonfarm | 2. ISM |
| 3. PPI | 4. CPI |

№25. Показатель инфляции в США, Евросоюзе.

- | | |
|------------|--------|
| 1. Nonfarm | 2. ISM |
| 3. PPI | 4. CPI |

№26. Показатель эффективности торговли трейдера.

- | | |
|-------|---------|
| 1. P | 2. MIDD |
| 3. RF | 4. PF |

№27. Показатель падения кривой доходности (нарастающего убытка).

1. P
2. MIDD
3. RF
4. PF

№28. Используя классическое правило управления капиталом 1:3, рассчитайте целевой уровень take-profit

при stop-loss в 90 пунктов, если цена открытия длинной позиции по паре GBP/USD составила 1.5475

Ответ: _____

№29. Планируется использовать первоначальный депозит в \$5000 и лот в \$40000. Торговая система

предполагает использовать кредитное плечо не больше 1:10, MIDD при лоте \$10000 составил \$200.

Спланируйте свою торговлю с заполнением всех пустующих ячеек таблицы.

№ п.п.	Депозит, долл.	Лот, долл.	MIDD, долл.
1			
2	5000	40000	
3			
4			
5			

№30. Завершите финансовый анализ ТС, начатый трейдером, с заполнением пустующих ячеек таблицы.

Главные показатели:	Итог:
Депозит, долл.	1200,00
Валовая прибыль $S(P_i)$, долл.	649,50
Валовый убыток $S(L_i)$, долл.	449,40
Чистая прибыль (убыток) P , долл.	
PF	
MIDD, долл.	120,00
RF	
Конечный депозит, долл.	
Изменение депозита (%)	

Таблица 1 Инструкция по проверке тестовых заданий.

№ задания	Ответ	№ задания	Ответ
1	2	16	2
2	3	17	3
3	1	18	2
4	2	19	4
5	2	20	4
6	4	21	4
7	1.2665	22	2
8	2	23	4
9	2	24	1
10	2	25	4
11	3	26	3
12	4	27	2
13	1	28	1.5745
14	2	29	см. таб. 2
15	1	30	см. таб. 3

Ответ на вопрос № 29 Таблица 2

№ п.п.	Депозит, долл.	Лот, долл.	MIDD, долл.
1	4200	30000	600
2	5000	40000	800
3	6000	50000	1000
4	7200	60000	1200
5	8600	70000	1400

Ответ на вопрос № 30 Таблица 3

Главные показатели:	Итог:
Депозит, долл.	1200,00
Валовая прибыль $S(P_i)$, долл.	649,50
Валовый убыток $S(L_i)$, долл.	449,40
Чистая прибыль (убыток) P , долл.	200,10
Профит-фактор (PF)	1,45
MIDD, долл.	120,00
Фактор восстановления (RF)	1,67
Конечный депозит, долл.	1400,10
Изменение депозита (%)	16,7%

Вопросы к экзамену

1. Финансы как экономическая категория
2. Мировой финансовый рынок и его составные части
3. Фундаментальные законы и теории, действующие на финансовых рынках
4. Основные институты на финансовом рынке
5. Участники финансового рынка
6. Международный валютный рынок форекс
7. Основные инструменты, обращающиеся на валютном рынке
8. Маржинальный принцип торговли
9. Управление капиталом на финансовых рынках
10. Портфельная теория управления Марковица
11. Технический анализ финансовых рынков
12. Статистический анализ финансовых рынков
13. Фундаментальный анализ финансовых рынков
14. Фондовый рынок России (ММВБ-РТС)
15. Основные инструменты, обращающиеся на фондовом рынке
16. Фондовые рынки зарубежных стран (США, Европы, Великобритании, Японии)
17. Мировой товарный рынок (рынок золота, сырьевой рынок)
18. Основные инструменты, обращающиеся на товарных рынках
19. Чикагская товарная биржа
20. Рынок срочных контрактов (деривативов)
21. Основные инструменты, обращающиеся на рынке срочных контрактов
22. Мировой страховой рынок
23. Основные инструменты, обращающиеся на страховом рынке
24. Денежный рынок
25. Основные инструменты, обращающиеся на денежном рынке
26. Международные финансово-кредитные организации
27. Международное нормативно-правовое регулирование финансовых рынков
28. Брокерское обслуживание на фондовом рынке России и зарубежных площадках
29. Брокерское обслуживание на международном валютном рынке в России

Соотнесение результатов обучения по дисциплине (модулю) или практике с показателями и критериями оценивания сформированности компетенций на различных этапах их формирования, шкалами и процедурами оценивания, оценочными средствами, приведенных выше, представлено в таблице «Результаты обучения (в формате компетенций) на данном этапе их формирования», которая является приложением к фонду оценочных средств по дисциплине.

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

Порядок формирования фондов оценочных средств и процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций обучающихся по образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, магистратуры в АНО ВО СИБУП определены в Методических рекомендациях по формированию фондов оценочных средств и процедурам оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта

деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций, утвержденных ректором института.

Результаты обучения (в формате компетенций) на данном этапе их формирования

Компетенции	Показатели, содержащие критерии и шкалы оценивания	Оценочные средства
способность осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач (ОПК-2);	1. экспресс-опрос; 2. письменные домашние задания (кейс 1); 3. тестирование; 4. реферат 5. экзамен;	1. Тематика экспресс-опросов (1-53) 2. комплект заданий (кейс) (1-12); 3. тесты 4. тематика рефератов (1-13) 5. вопросы к экзамену (1-29).
способность выбрать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, проанализировать результаты расчетов и обосновать полученные выводы (ОПК-3);	6. экспресс-опрос; 7. письменные домашние задания (кейс 1-2); 8. тестирование; 9. реферат 10. экзамен;	6. Тематика экспресс-опросов (1-53) 7. комплект заданий (кейс) (1-12); 8. тесты 9. тематика рефератов (1-13) 10. вопросы к экзамену (1-29).
способность на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты (ПК-4);	11. экспресс-опрос; 12. письменные домашние задания (кейс 2); 13. тестирование; 14. реферат 15. экзамен;	11. Тематика экспресс-опросов (1-53) 12. комплект заданий (кейс) (1-12); 13. тесты 14. тематика рефератов (1-13) 15. вопросы к экзамену (1-29).
способность использовать для решения коммуникативных задач современные технические средства и информационные технологии (ПК-10).	16. экспресс-опрос; 17. письменные домашние задания (кейс 1); 18. тестирование; 19. реферат 20. экзамен;	16. Тематика экспресс-опросов (1-53) 17. комплект заданий (кейс) (1-12); 18. тесты 19. тематика рефератов (1-13) 20. вопросы к экзамену (1-29).

РЕЦЕНЗИЯ

на рабочую программу дисциплины Современные финансовые рынки и фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся по данной дисциплине

по направлению подготовки 38.03.01. Экономика

направленность (профиль) образовательной программы Мировая экономика
форма обучения очная

экономического факультета Автономной некоммерческой организации высшего образования «Сибирский институт бизнеса, управления и психологии».

Представленная на экспертизу рабочая программа дисциплины разработана на основании федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки 38.03.01 Экономика (уровень бакалавриата), утвержденного приказом Минобрнауки России от «12» августа 2020 г

№ 954, которая представляет собой регламентирующий документ, входящий в состав образовательной программы, определяющий содержание и объем дисциплины, формируемые компетенции, перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы, фондом оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся, включает в себя перечень учебно-методического обеспечения и описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине.

В ходе рассмотрения представленных документов, на основании анализа результатов проведенной экспертизы сделаны следующие выводы:

В рабочей программе определены цели и задачи изучаемой дисциплины, общая характеристика дисциплины, ее место в плане учебного процесса, а также результаты освоения дисциплины. Тематическое планирование соответствует содержанию программы. В тематическом плане указано количество учебных часов, которые отведены на изучение материала: лекции, практические занятия и самостоятельную работу, описаны компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины.

Структура программы логична, соответствует наличию обязательных компонентов и раскрывает методику работы над содержанием изучаемого материала. Результаты обучения, представленные в программе в категориях знать, уметь, владеть соответствуют специфике и содержанию дисциплины и демонстрируют возможность получения заявленных результатов. Представленная программа предполагает использование современных образовательных технологий при реализации различных видов учебной работы. Формы образовательных технологий соответствуют специфике дисциплины и позволяют обеспечивать требуемое качество обучения на всех его этапах.

Учебно-методическое и материально-техническое обеспечение соответствует требованиям ФГОС ВО и обеспечивает использование современных образовательных, в том числе инновационных методов обучения.

Фонды оценочных средств для текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине «Современные финансовые рынки» соответствуют специфике дисциплины, формируемым компетенциям и требованиям к выпускникам. Форма промежуточной аттестации знаний бакалавра, предусмотренная программой, осуществляется в форме экзамена.

Оценочные средства и критерии оценивания представлены в полном объеме.

Показатели и критерии оценивания компетенций, а также шкалы оценивания обеспечивают возможность проведения всесторонней оценки результатов обучения, уровней сформированности компетенций.

Контрольные задания, тесты и иные материалы оценки результатов освоения ОПОП ВО разработаны на основе принципов оценивания: валидности, определенности, однозначности, надежности; соответствуют требованиям к составу и взаимосвязи оценочных средств, полноте по количественному составу оценочных средств и позволяют объективно оценить результаты обучения, уровни сформированности компетенций.

Таким образом, представленная к рецензированию рабочая программа учебной дисциплины «Современные финансовые рынки», составленная старшим преподавателем Радаевым Ю.А. соответствует учебному плану и требованиям ФГОС ВО по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, профилю образовательной программы Мировая экономика и может быть использована в образовательном процессе.

Представленный фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине «Современные финансовые рынки» соответствует предъявляемым требованиям ФГОС ВО и может быть использован для контроля и оценки результатов подготовки обучающихся.

Рецензент:

Руководитель ООО «Альпари-Красноярск»



(подпись)

В.В. Волков
(инициалы, фамилия)