Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Крылова Людмила Вячеславовна
Должность: Проректор по учебно-методической работе
Дата подписания: 09.11.2026 13:56:17
Уникальный программный ключ:
b066544bae1e449cd8bfce393f7224a676a271b2

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«ДОНЕЦКИЙ НАЦИОНАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ЭКОНОМИКИ И ТОРГОВЛИ ИМЕНИ МИХАИЛА ТУГАН-БАРАНОВСКОГО»

Кафедра финансов и экономической безопасности

УТВЕРЖДАЮ
Заведующий кафедрой
_____ Л. А. Омельянович
«21» _____02_____ 2024 г.

ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ

по учебной дисциплине

_____Б1.В.ДВ.01.02 Рынок ценных бумаг_____

_____38.03.01 Экономика _____
(код и наименование направления подготовки)

_____Финансы и кредит_____
(наименование профиля)

Разработчик:
доцент _____ Малецкий А.В.
(должность) (подпись)

Оценочные материалы рассмотрены и утверждены на заседании кафедры от «_21_»_____02_____2024 г., протокол № _21_

Донецк – 2024 г.

Паспорт

оценочных материалов по учебной дисциплине

_____Рынок ценных бумаг_____

(наименование учебной дисциплины)

Перечень компетенций, формируемых в результате освоения учебной дисциплины (модуля)

№ п/п	Код и наименование контролируемой компетенции	Контролируемые разделы (темы) учебной дисциплины	Этапы формирования (семестр изучения)
1	ПК-5. Способен проводить мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков	**Тема 1.** Рынок ценных бумаг: сущность, функции и роль в экономике.	8
		Тема 2. Профессиональные участники рынка ценных бумаг.	8
		Тема 3. Система регулирования рынка ценных бумаг.	8
		Тема 4. Эмиссия и обращение ценных бумаг.	8
		Тема 5. Рынок долгового капитала.	8
		Тема 6. Рынок акций.	8
		Тема 7. Рынок производных ценных бумаг.	8
		Тема 8. Международные рынки капитала.	8
		Тема 9. Государственные ценные бумаги.	8
		Тема 10. Модели анализа и прогнозирования доходности и риска ценных бумаг.	8

Показатели и критерии оценивания компетенций, описание шкал оценивания

Показатели оценивания компетенций

Код контролируемой компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Контролируемые разделы (темы) учебной дисциплины	Наименование оценочного средства
ПК-5. Способен проводить мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков	ИД-2$_{ПК-5}$ Осуществляет мониторинг информационных источников финансовой информации	Тема 1. Рынок ценных бумаг: сущность, функции и роль в экономике.	собеседование
		Тема 2. Профессиональные участники рынка ценных бумаг.	собеседование,
		Тема 3. Система регулирования рынка ценных бумаг.	собеседование, разноуровневые задачи и задания
		Тема 4. Эмиссия и обращение ценных бумаг.	собеседование, контрольная работа (ТМК 1)
	ИД-1$_{ПК-5}$ Проводит исследования финансового рынка и изучает предложения финансовых услуг (в том числе действующих правил и условий, тарифной политики и действующих форм документации)	Тема 5. Рынок долгового капитала.	собеседование, разноуровневые задачи и задания
		Тема 6. Рынок акций.	собеседование, разноуровневые задачи и задания
		Тема 7. Рынок производных ценных бумаг.	собеседование, разноуровневые задачи и задания
		Тема 8. Международные рынки капитала.	собеседование, разноуровневые задачи и задания
		Тема 9. Государственные ценные бумаги.	собеседование, разноуровневые задачи и задания
		Тема 10. Модели анализа и прогнозирования доходности и риска ценных бумаг.	собеседование, контрольная работа (ТМК 2)

Критерии и шкала оценивания по оценочному материалу «Собеседование»

Шкала оценивания (интервал баллов)	Критерии оценивания
5	Ответы на поставленные вопросы излагаются логично, последовательно и не требуют дополнительных пояснений. Полно раскрываются причинно-следственные связи между явлениями и событиями. Делаются обоснованные выводы. Демонстрируются глубокие знания базовых нормативно-правовых актов. Соблюдаются нормы литературной речи (количество правильных ответов > 90%)
3-4	Ответы на поставленные вопросы излагаются систематизировано и последовательно. Базовые нормативно-правовые акты используются, но в недостаточном объеме. Материал излагается уверенно. Раскрыты причинно-следственные связи между явлениями и событиями. Демонстрируется умение анализировать материал, однако не все выводы носят аргументированный и доказательный характер. Соблюдаются нормы литературной речи (количество правильных ответов >70%)
2	Допускаются нарушения в последовательности изложения. Имеются упоминания об отдельных базовых нормативно-правовых актах. Неполно раскрываются причинно-следственные связи между явлениями и событиями. Демонстрируются поверхностные знания вопроса, с трудом решаются конкретные задачи. Имеются затруднения с выводами. Допускаются нарушения норм литературной речи (количество правильных ответов >50%)
0-1	Материал излагается непоследовательно, сбивчиво, не представляет определенной системы знаний по дисциплине. Не раскрываются причинно-следственные связи между явлениями и событиями. Не проводится анализ. Выводы отсутствуют. Ответы на дополнительные вопросы отсутствуют. Имеются заметные нарушения норм литературной речи (количество правильных ответов <50%)

Критерии и шкала оценивания по оценочному материалу «Разноуровневые задачи и задания»

Шкала оценивания (интервал баллов)	Критерии оценивания
5	Задачи и задания выполнены на высоком уровне (даны правильные ответы на 75-100% вопросов/задач)
3-4	Задачи и задания выполнены на среднем уровне (даны правильные ответы на 50-74% вопросов/задач)
2	Задачи и задания выполнены на низком уровне (даны правильные ответы на 25-49% вопросов/задач)
0-1	Задачи и задания выполнены на неудовлетворительном уровне (даны правильные ответы на 0-24% вопросов/задач)

Критерии и шкала оценивания по оценочному материалу «Контрольная работа»

Шкала оценивания (интервал баллов)	Критерии оценивания
10-9	Контрольная работа выполнена на высоком уровне (правильные ответы даны на 90-100% вопросов/задач)
7-8	Контрольная работа выполнена на среднем уровне (правильные ответы даны на 75-89% вопросов/задач)
4-6	Контрольная работа выполнена на низком уровне (правильные ответы даны на 60-74% вопросов/задач)

Шкала оценивания (интервал баллов)	Критерии оценивания
0-3	Контрольная работа выполнена на неудовлетворительном уровне (правильные ответы даны менее чем 60%)

Перечень оценочных материалов

№ п/п	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в фонде
1.	Собеседование	Средство контроля, организованное как специальная беседа преподавателя с обучающимся на темы, связанные с изучаемой учебной дисциплиной, и рассчитанное на выяснение объема знаний обучающегося по учебной дисциплине или определенному разделу, теме, проблеме и т.п.	Вопросы по темам/разделам учебной дисциплины
2.	Разноуровневые задачи и задания	Различают задачи и задания: а) репродуктивного уровня, позволяющие оценивать и диагностировать знание фактического материала (базовые понятия, алгоритмы, факты) и умение правильно использовать специальные термины и понятия, узнавание объектов изучения в рамках определенного раздела учебной дисциплины; б) реконструктивного уровня, позволяющие оценивать и диагностировать умения интезировать, анализировать, обобщать фактический и теоретический материал с формулированием конкретных выводов, установлением причинно-следственных связей; в) творческого уровня, позволяющие оценивать и диагностировать умения, интегрировать знания различных областей, аргументировать собственную точку зрения	Комплект разноуровневых задач и заданий
3.	Контрольная работа	Средство проверки умений применять полученные знания для решения задач определенного типа по теме, разделу или учебной дисциплине	Комплект контрольных заданий по вариантам

Смысловой модуль 1.. Общие основы функционирования рынка ценных бумаг.

Примерные темы рефератов

1. Роль фондового рынка в обеспечении инвестиционного развития национальной экономики (на примере…)
2. История развития Центрального Республиканского Банка.
3. Фондовый рынок в условиях планово-распределительной экономики: исторический и функциональный аспекты.
4. Роль фондового рынка в развитии и экономических систем рыночного типа.
5. Классификация рынков ценных бумаг.
6. Функции рынка ценных бумаг в современных экономических условиях.
7. Сущность ценной бумаги и их классификация по инвестиционным и иным характеристикам.
8. Инвестиционные качества ценных бумаг.
9. Национальные модели рынков ценных бумаг: сравнительный анализ
10. Новые виды рынков и новые виды ценных бумаг (коммерческие бумаги, складские свидетельства).
11. Формирование, проблемы и перспективы вторичного рынка ценных бумаг в ДНР.
12. Формирование, проблемы и перспективы первичного рынка ценных бумаг в ДНР.
13. Роль организованного рынка ценных бумаг в реализации механизма привлечения инвестиций в реальный сектор экономики ДНР.
14. Формирование правовой инфраструктуры рынка ценных бумаг в ДНР.
15. Национальные модели рынков ценных бумаг: сравнительный анализ.
16. Ценные бумаги в системе инвестиционного проектирования.
17. Ценные бумаги в системе исламских финансов.
18. Рынок ценных бумаг: структура, роль в макро и микроэкономике, участники.
19. Технология банкротства на фондовом рынке
20. Долговые обязательства предприятий: отечественный и зарубежный опыт.

Смысловой модуль 1. Основы функционирования рынка ценных бумаг

Образец вопросов для коллоквиума

1. Дайте определение категории «ценная бумага».
2. Перечислите признаки ценных бумаг.
3. Раскройте свойства ценных бумаг.
4. Объясните разницу между «правом на бумагу» и «правом из бумаги».
5. Дайте определение «долевой ценной бумаги» и «долговой ценной бумаги», отметьте общее и отличное.
6. Институциональная структура рынка ценных бумаг.
7. Торговые посредники.
8. Институты учетной системы рынка ценных бумаг.
9. Охарактеризуйте составляющие системы регулирования рынка ценных бумаг.
10. Перечислите цели государственного регулирования рынка ценных бумаг.
11. Проанализируйте в чем отличие между рыночным и государственным регулированием рынка ценных бумаг.
12. Перечислите цели эмиссии.
13. Раскройте различия между открытой и закрытой эмиссией.
14. Перечислите этапы эмиссии ценных бумаг и охарактеризуйте каждый этап.
15. Назовите и охарактеризуйте сегменты рынка долгового капитала.
16. Дайте определение векселя и раскройте цели его выпуска.
17. Укажите отличия между простым и переводным векселем.
18. Дайте определение облигации и перечислите ее свойства.
19. Дайте определение акции и квалифицируйте ее как ценную бумагу.
20. Перечислите фундаментальные свойства акций.

21. Раскройте цель выпуска акций.

22. Объясните разницу между размещенными, оплаченными и объявленными акциями.

23. Дайте определение производной ценной бумаги.

24. Перечислите цели операций с деривативами.

25. Опишите методику хеджирования при помощи деривативов.

26. Назовите и охарактеризуйте секторы международного рынка капитала.

27. Охарактеризуйте историю развития и современное состояние рынка еврооблигаций.

28. Перечислите особенности выпуска еврооблигаций.

29. Перечислите цели выпуска государственных облигаций.

30. Перечислите виды государственных ценных бумаг.

31. Опишите механизм выпуска государственных ценных бумаг.

Смысловой модуль 2. Организация деятельности рынка ценных бумаг.

Образец практических заданий

Задача

Номинал облигации 100 руб., ожидаемая сумма купонных выплат 5 руб, рыночная цена облигации 85 руб., срок до погашения 4 месяца.

Определите: доходность облигации к погашению.

Задача

Фирма приобрела 3 банковских векселя 1 марта 1998 г. сроком по предъявлении, но не ранее 1 июня 1998 г. Номинал каждого векселя - 100 тыс. руб. Процентный доход, гарантированный банком по векселям, - 25% годовых. Векселя были предъявлены фирмой к платежу банку 1 июля 1998 г.

Определите доходность операции с векселями.

Задача

Рассчитайте доходность инвестиций, если первоначальные инвестиции составляют 500 тыс. руб., сумма продисконтированных денежных потоков – 1 200 тыс. руб.

Задача

Страйк-цена опциона пут 28 руб. Опционная премия - 2 руб. Спот-цена базового актива равна 26,5 руб. за единицу.

Определите внутреннюю и временную стоимость.

Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков

Оценивание знаний с использованием оценочных материалов «Практическое занятие» проводится в письменной форме и предполагает, что обучающимся раздаются задания, содержащие ситуационные задачи. Выполнение предполагает решение поставленной задачи с выводами и обоснованием ответа. Обучающийся выполняет задание самостоятельно. Использование в процессе ответа источников информации не допускается. Максимальное количество баллов, которое обучающийся может получить за выполнение задачи по каждой теме, предусматривающей оценивание в форме «практическое занятие» – 2-4 баллов. Таким образом, решая ситуационные задачи, обучающийся максимально может набрать 15 баллов.

Оценивание знаний с использованием оценочных материалов «Коллоквиум» проводится в устной форме и предполагает предоставление обучающимся устных ответов, на вопросы, задаваемые преподавателем. Ответы должны быть даны самостоятельно. Использование в процессе ответа источников информации не допускается. Максимальное количество баллов, которое обучающийся может получить за ответы по каждой теме, предусматривающей оценивание в форме «коллоквиум» – 2-4 баллов. Таким образом, отвечая на вопросы коллоквиума обучающийся максимально может набрать 15 баллов.

Процесс написания реферата включает: выбор темы; подбор нормативных актов, специальной литературы и иных источников, их изучение; составление плана; написание текста работы и ее оформление; устное изложение реферата. В реферате на основе тщательного анализа и обобщения научною материала сопоставляются различные взгляды авторов и определяется собственная позиция студента с изложением соответствующих аргументов. Объем реферата – от 5 до 15 страниц. Изложение материала должно быть кратким, точным, последовательным. Содержание реферата обучающийся докладывает на семинаре. Максимальное количество баллов, которое студент может набрать, подготовив и доложив реферат, составляет 10 баллов.

Распределение баллов, которые получают обучающиеся

Форма контроля	**Максимальное количество баллов**	
	За одну работу	**Всего**
Текущий контроль:		
- собеседование (темы 1-10)	1	8
- разноуровневые задачи и задания (темы 5-10)	2	16
- контрольная работа (ТМК 1)	1	8
- контрольная работа (ТМК 2)	4	8
Промежуточная аттестация	*экзамен*	*60*
Итого за семестр	*100*	