

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Наумова Наталия Александровна
Должность: Ректор
Дата подписания: 24.10.2024 14:21:41
Уникальный идентификатор:
6b5279da4e034bffa080a601c11149e1

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ МОСКОВСКОЙ ОБЛАСТИ
Государственное образовательное учреждение высшего образования Московской области
МОСКОВСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ ОБЛАСТНОЙ УНИВЕРСИТЕТ
(МГОУ)

Экономический факультет
Кафедра экономики и предпринимательства

УТВЕРЖДЕН

на заседании кафедры

протокол от «10» 2021 г., № 12

Заведующая кафедрой Т.Б. Фомина

**ФОНД
ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ**

По учебной дисциплине

Хеджирование ценовых и валютных рынков

Направление подготовки

38.03.01 Экономика

Профиль:

Экономика предприятий и организаций

Квалификация

Бакалавр

Формы обучения

Очная

Мытищи
2021

1. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕЙ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

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

Код и наименование компетенции	Этапы формирования
СПК-3 «Способностью критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий»	Работа на учебных занятиях Самостоятельная работа

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

Оцениваемые компетенции	Уровень сформированности	Этап формирования	Описание показателей	Критерии оценивания	Шкала оценивания
СПК-3 «Способностью критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий»	Пороговый	1. Работа на учебных занятиях 2. Самостоятельная работа	Знать: - структуру управленческих решений; - основные варианты управленческих решений. Уметь: - выделять, формулировать и аргументировать варианты управленческих решений; - обосновать предложения при принятии управленческих решений;	Реферат Рецензия Тест Экзамен	41-60
	Продвинутый	1. Работа на учебных занятиях 2. Самостоятельная работа	Знать: - структуру управленческих решений; - критерии оценки показателя социально-экономической эффективности; - особенности рисков и их последствия для социально-экономической составляющей общества; - основные варианты управленческих решений.	Реферат Рецензия Тест Экзамен	61-100

			Уметь: - корректно применять знания об управленческих планах; - анализировать возникшие риски и возможные социально-экономические последствия при разработке планов; - выделять, формулировать и аргументировать варианты управленческих решений; - обосновать предложения при принятии управленческих решений; - самостоятельно анализировать различные управленческие решения и прогнозировать социально-экономические последствия развития общественного производства. Владеть: - способностями к критической оценке и обосновывать предложения по совершенствованию управленческих решений; - способами управления рисками и выявлять социально-экономические последствия при не рациональном управленческом решении.		
--	--	--	--	--	--

3. 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

Примерные задания к текущему контролю:

Темы рефератов по курсу «Хеджирование ценовых и валютных рынков»

1. Эволюция развития рынка ценных бумаг в России.

2. Современное состояние рынка ценных бумаг в России.
3. Инвестиционный процесс в России и источники его финансирования.
4. Международный и российский рынки акций.
5. Рынок производных ценных бумаг и их роль на мировых фондовых рынках.
6. Биржевой и внебиржевой рынки ценных бумаг.
7. Хеджирование и биржевые спекуляции.
8. Организация и регулирование биржевой деятельности.
9. Технический анализ. Системы технического анализа на фондовом рынке.
10. Фундаментальный анализ на фондовом рынке.
11. Страхование операций с ценными бумагами.
12. Крупнейшие фондовые биржи в России и мире.
13. Управление процессом формирования курса ценных бумаг.
14. Биржевые индексы и методики их исчисления. Значение биржевых индексов для анализа состояния и динамики фондового рынка.
15. Основные международные модели рынка ценных бумаг.
16. Страхование операций с ценными бумагами.
17. Европейский рынок: основные фондовые инструменты.
18. Ценные бумаги на Европейском рынке.
19. Торговые системы рынка ценных бумаг.
20. Система электронных торгов на фондовом рынке.
21. Мировой финансовый рынок: операции с ценными бумагами.
22. Роль и значение фондового рынка в России.

Примерные тесты

Тест 1. Акция – это:

1. Долговое обязательство акционерного общества.
2. Срочное обязательство акционерного общества.
3. Документ, подтверждающий право собственности.
4. Бессрочное долговое обязательство акционерного общества.

Тест 2. Фьючерсный контракт – это:

1. Биржевой срочный контракт.
2. Внебиржевой срочный контракт.
3. Биржевой бессрочный контракт.
4. Внебиржевой бессрочный контракт.

Тест 3. Опционный контракт – это:

1. Биржевой срочный контракт с безусловным обязательством его выполнения.
2. Внебиржевой срочный контракт с безусловным обязательством его выполнения.
3. Биржевой бессрочный контракт с безусловным обязательством его выполнения.
4. Внебиржевой бессрочный контракт с безусловным обязательством его выполнения.

Тест 4. Длинный фьючерс – это:

1. Контракт, используемый в шорт-стратегии.
2. Контракт, используемый стратегии на рост
3. Контракт долгосрочный.
4. Контракт среднесрочный.

Тест 5. Короткий фьючерс – это:

1. Контракт, используемый в шорт-стратегии.
2. Контракт, используемый стратегии на рост
3. Контракт долгосрочный.
4. Контракт среднесрочный.

Тест 6. Опцион колл – это:

1. Опцион на продажу.

2. Опцион на покупку.
3. Опцион краткосрочный.
4. Опцион долгосрочный.

Тест 7. Опцион пут – это:

1. Опцион на продажу.
2. Опцион на покупку.
3. Опцион краткосрочный.
4. Опцион долгосрочный.

Тест 8. Вариационная маржа – это:

1. Платеж для удержания позиции.
2. Фиксированное обязательство брокеру.
3. Штраф за досрочное закрытие позиции.
4. Страховка фьючерсного контракта.

Тест 9. Премия опциона – это:

1. Платеж за опцион.
2. Прибыль с опциона.
3. Страховка опциона.
4. Выигрыш за использования опциона.

Тест 10. Хеджирование – это:

1. Спекулятивная стратегия.
2. Страховой продукт.
3. Стратегия биржевой торговли.
4. Защита от волатильности

Примерные вопросы к экзамену:

1. Предмет, цели, методология и функции учебного курса.
2. Понятие рынка ценных бумаг, его экономическое и социальное значение.
3. Понятие волатильности и ее причины.
4. Понятие и функции хеджирования ценовых и валютных рынков.
5. Понятие и экономическая роль ценных бумаг.
6. История и виды ценных бумаг.
7. Основные и производные ценные бумаги.
8. Первичные и вторичные ценные бумаги.
9. Понятие «ценной бумаги» в современном законодательстве, ее признаки.
10. Эмитенты ценных бумаг, характеристика и виды.
11. Инвесторы: институциональные и индивидуальные.
12. Понятие рынка ценных бумаг.
13. Экономическая и социальная роль рынка ценных бумаг.
14. Эмитенты, инвесторы и профессиональные участники рынка ценных бумаг.
15. Государственное регулирования рынка ценных бумаг.
16. Долговые ценные бумаги.
17. Имущественные ценные бумаги.
18. Профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг, ее виды.
19. Понятие биржевой торговли, история и экономическая функция биржи.
20. Товарная и валютная биржа.
21. Специализированные биржи.
22. Структура управления биржи.
23. Биржевые операции.
24. Торговые платформы.
25. Брокерская деятельности.
26. Биржевой и внебиржевой рынки ценных бумаг.

27. Организационное устройство товарной и фондовой биржи.
28. Организация биржевой торговли и состав ее участников.
29. Управление процессом формирования курса ценных бумаг, их котировка.
30. Биржевые сделки и их виды.
31. Понятие и цели анализа рынка ценных бумаг.
32. Фундаментальный анализ на рынке ценных бумаг.
33. Технический анализ на рынке ценных бумаг.
34. Теории движения цен.
35. Условия хеджирования фьючерсными контрактами.
36. Особенности торговли фьючерсными контрактами.
37. Модели хеджирования фьючерсными контрактами.
38. Условия хеджирования опционными контрактами.
39. Особенности торговли опционными контрактами.
40. Модели хеджирования опционными контрактами.

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

Основными формами текущего контроля являются тест, реферат, рецензия, промежуточная аттестация, экзамен в седьмом семестре.

Проверка домашних заданий регулярно осуществляется преподавателем на занятиях. Также на занятиях проводятся текущие устные опросы студентов. В промежуточную аттестацию включаются как теоретические вопросы, так и практические задания.

Требования к экзамену

Процедура оценивания знаний и умений для получения экзамена состоит из следующих составных элементов:

1. Учет посещаемости лекционных и практических занятий
2. Выполнение заданий текущего контроля

Соотношение оценки и баллов в рамках процедуры оценивания

Оценка по 5-балльной системе		Рейтинговые баллы
«5»	отлично	81 - 100
«4»	хорошо	61 - 80
«3»	удовлетворительно	41 - 60
«2»	неудовлетворительно	0 - 40

Соотношение вида работ и количества баллов в рамках процедуры оценивания

Вид работы	количество баллов
Посещаемость	до 10 баллов
Рецензия	До 10 баллов
Тест	до 25 баллов
Реферат	до 25 баллов
Экзамен	до 30 баллов

5.4.1. Шкала оценки посещаемости:

посещаемость, %	100	90	80	70	60	50	40	30	20	10	0
-----------------	-----	----	----	----	----	----	----	----	----	----	---

в баллах	10	10	9	8	7	4	3	2	0	0	0
----------	----	----	---	---	---	---	---	---	---	---	---

5.4.2. Написание теста оценивается по шкале от 0 до 25 баллов. Освоение компетенций зависит от результата написания теста: 20-25 баллов (80-100% правильных ответов) - компетенции считаются освоенными на высоком уровне (оценка отлично); 15-19 баллов (70-75 % правильных ответов) - компетенции считаются освоенными на базовом уровне (оценка хорошо); 8-10 баллов (50-65 % правильных ответов) - компетенции считаются освоенными на удовлетворительном уровне (оценка удовлетворительно); 0-7 баллов (менее 50 % правильных ответов) - компетенции считаются не освоенными (оценка неудовлетворительно).

5.4.2. Написание реферата оценивается по шкале от 0 до 25 баллов. Освоение компетенций зависит от результата написания реферата: 22-25 баллов - компетенции считаются освоенными на высоком уровне (оценка отлично); 19-21 баллов - компетенции считаются освоенными на продвинутом уровне (оценка отлично); 16-18 баллов - компетенции считаются освоенными на базовом уровне (оценка хорошо); 11-15 баллов - компетенции считаются освоенными на удовлетворительном уровне (оценка удовлетворительно); 0-10 баллов - компетенции считаются не освоенными (оценка неудовлетворительно).

Критерии оценивания	Интервал оценивания
1. Степень раскрытия темы	0-6
2. Личный вклад автора	0-3
3. Структурированность материала	0-2
4. Постраничные ссылки	0-2
5. Объем и качество используемых источников	0-4
6. Оформление текста и грамотность речи	0-2
7. Защита работы	0-6
Общая сумма баллов:	25

5.4.3. Рецензия оценивается от 0 до 10 баллов. Освоение компетенций зависит от результата написания рецензии: 9-10 баллов - компетенции считаются освоенными на высоком уровне (оценка отлично); 6-8 баллов - компетенции считаются освоенными на базовом уровне (оценка хорошо); 3-5 баллов - компетенции считаются освоенными на удовлетворительном уровне (оценка удовлетворительно); 0-2 баллов - компетенции считаются не освоенными (оценка неудовлетворительно).

Критерии оценивания	Интервал оценивания
1. владение профессиональной терминологией	0-2
2. умение высказывать и обосновать свои суждения	0-2
3. структурированность материала	0-3
4. оформление текста и грамотность речи	0-3
Общая сумма баллов:	10

Экзамен выставляется в соответствии с предложенной ниже Таблицей 1.

Таблица 1

№	ФИО	Сумма баллов, набранных в семестре	ИТОГО
---	-----	------------------------------------	-------

п/п		Посещение до 10 баллов	Реферат до 25 баллов	Рецензия до 10 баллов	Тест до 25 баллов	Экзамен до 30 баллов	
1	2	3	4	5	6	7	8
1.							
2.							

Неудовлетворительной сдачей экзамена считается экзаменационная составляющая менее или равная 40 баллам (при максимальном количестве баллов, отведенных на экзамен 100). При неудовлетворительной сдаче экзамена (менее или равно 40 баллам) или неявке по неуважительной причине на экзамен экзаменационная составляющая приравнивается к нулю (0). В этом случае студент в установленном в Университете порядке обязан пересдать экзамен.

При пересдаче экзамена или зачета используется следующее правило для формирования рейтинговой оценки:

- 1-я пересдача – фактическая рейтинговая оценка, полученная студентом за ответ, минус 10 баллов;
- 2-я пересдача – фактическая рейтинговая оценка, полученная студентом за ответ, минус 20 баллов.