

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«ЛУГАНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИМЕНИ ВЛАДИМИРА ДАЛЯ»

Экономический институт
Кафедра финансов и кредита

УТВЕРЖДАЮ:
Директор Экономического института
Тхор Е.С. _____
(подпись)
« 28 » февраля 2025 года



ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

по учебной дисциплине

Рынок ценных бумаг

(наименование учебной дисциплины, практики)

38.03.01 «Экономика»

(код и наименование направления подготовки (специальности))

«Финансы и кредит»

(наименование профиля подготовки (специальности, магистерской программы); при отсутствии ставится прочерк)

Разработчик:
доцент

(подпись)

Иванюк И.В.

ФОС рассмотрен и одобрен на заседании кафедры финансов и кредита от « 25 »
феврале 2025 г., протокол № 13

Заведующий кафедрой
финансов и кредита

(подпись)

Салита С.В.

Луганск 2025 г.

**Комплект оценочных материалов по дисциплине
«Рынок ценных бумаг»**

Задания закрытого типа

Задания закрытого типа на выбор правильного ответа

1. *Выберите один правильный ответ*

Кто занимается осуществлением организованного рынка ценных бумаг?

А) Государство

Б) Биржа

В) Предприятия

Правильный ответ: Б

Компетенции (индикаторы): ПК-1 (ПК-1.3)

2. *Выберите один правильный ответ*

Что является главной задачей рынка ценных бумаг?

А) Привлечение капитала для политического развития

Б) Удовлетворение общественных потребностей

В) Привлечение капитала для экономического развития

Правильный ответ: В

Компетенции (индикаторы): ПК-1 (ПК-1.3)

2. *Выберите один правильный ответ*

Фьючерсные контракты преимущественно обращаются на:

А) Бирже

Б) Организованном внебиржевом рынке

В) Цифровых площадках

Правильный ответ: А

Компетенции (индикаторы): ПК-1 (ПК-1.3)

Задания закрытого типа на установление соответствия

1. *Установите соответствие между понятием и его определением. Каждому элементу левого столбца соответствует только один элемент правого столбца.*

1) Облигация

А) Эмиссионная ценная бумага, закрепляющая права ее владельца на получение части прибыли акционерного общества в виде дивидендов

2) Акция

Б) Ничем не обусловленное обязательство векселедателя выплатить по наступлении предусмотренного срока полученную займы сумму

- 3) Инвестиционный пай В) Эмиссионная ценная бумага, закрепляющая право ее владельца на получение от эмитента в предусмотренный в ней срок ее номинальной стоимости
- 4) Простой вексель Г) Именная ценная бумага, которая подтверждает право её владельца на долю в имуществе фонда

Правильные ответы: 1-В, 2-А, 3-Г, 4-Б

Компетенции (индикаторы): ПК-1 (ПК-1.3)

2. *Установите соответствие. Каждому элементу левого столбца соответствует только один элемент правого столбца.*

- | | |
|------------------------------|--------------------------------|
| 1) Долевые ценные бумаги | А) Фьючерсы, форварды, опционы |
| 2) Долговые ценные бумаги | Б) Акции |
| 3) Производные ценные бумаги | В) Облигации |

Правильные ответы: 1-Б, 2-В, 3-А

Компетенции (индикаторы): ПК-1 (ПК-1.3)

3. *Установите соответствие. Каждому элементу левого столбца соответствует только один элемент правого столбца.*

- | | |
|-----------------|--|
| 1) Листинг | А) Выпуск в обращение ценных бумаг |
| 2) Хеджирование | Б) Установление рыночной цены ценной бумаги |
| 3) Эмиссия | В) Совокупность процедур по включению ценных бумаг в биржевой список |
| 4) Котировка | Г) Страхование риска снижения стоимости актива за счет занятия противоположной позиции к данному активу по основанному на нем деривативу |

Правильные ответы: 1-В, 2-Г, 3-А, 4-Б

Компетенции (индикаторы): ПК-1 (ПК-1.3)

Задания закрытого типа на установление правильной последовательности

1. *Установите последовательность этапов эмиссии акций. Запишите правильную последовательность букв слева направо:*

- А) Создание проспекта эмиссии
Б) Решение об эмиссии и первичном или вторичном размещении на рынке ценных бумаг
В) Составление отчёта об итогах
Г) Размещение

Правильная последовательность: Б, А, Г, В

Компетенции (индикаторы): ПК-1 (ПК-1.3)

2. *Установите последовательность этапов листинга:*

- А) Проверка документов биржей

- Б) Регистрация заявки на бирже
- В) Принятие решения о листинге
- Г) Подготовка документов

Правильная последовательность: Г, А, Б, В

Компетенции (индикаторы): ПК-1 (ПК-1.3)

3. *Установите последовательность выполнения фьючерса:*

- А) Каждый день биржа начисляет или списывает деньги в зависимости от того, как изменилась цена на актив и, соответственно, стоимость фьючерса
- Б) Инвестор покупает или продаёт фьючерс за неполную стоимость – на его счёте блокируют сумму гарантийного обеспечения
- В) Фьючерс выполняется: стороны выплачивают друг другу разницу между ценой актива, обозначенной в контракте, и рыночной ценой на дату расчётов

Правильная последовательность: Б, А, В

Компетенции (индикаторы): ПК-1 (ПК-1.3)

Задания открытого типа

Задания открытого типа на дополнение

1. *Напишите пропущенное словосочетание.*

Ценная бумага, удостоверяющая право ее владельца на долю в уставном капитале АО, на получение части дохода от деятельности АО и на участие в управлении АО – это _____.

Правильный ответ: простая акция

Компетенции (индикаторы): ПК-1 (ПК-1.3)

2. *Напишите пропущенное словосочетание.*

Долговая бумага, в которой векселедатель отдает письменное распоряжение плательщику безусловно оплатить названную сумму – это _____.

Правильный ответ: переводной вексель

Компетенции (индикаторы): ПК-1 (ПК-1.3)

3. *Напишите пропущенное словосочетание.*

Организованный рынок, где происходит купля-продажа ценных бумаг, называется _____.

Правильный ответ: фондовая биржа

Компетенции (индикаторы): ПК-1 (ПК-1.3)

Задания открытого типа с кратким свободным ответом

1. *Дайте определение фьючерсному контракту.*

Правильный ответ: Фьючерсный контракт это – обязательство купить или продать определенное количество товара по согласованной цене в определенную дату.

Компетенции (индикаторы): ПК-1 (ПК-1.3)

2. *Дайте определение производным финансовым инструментам.*

Правильный ответ: Производные финансовые инструменты это – Финансовые инструменты, ориентированные на новые договорные отношения, выходящие за рамки традиционных прав и обязательств по поводу приобретения или продажи классических финансовых инструментов по фиксированным ценам

Компетенции (индикаторы): ПК-1 (ПК-1.3)

3. *Дайте определение биржевому рынку ценных бумаг.*

Правильный ответ: Биржевой рынок ценных бумаг это – рынок ценных бумаг, организующий торговлю лучшими ценными бумагами среди лучших участников фондового рынка

Компетенции (индикаторы): ПК-1 (ПК-1.3)

Задания открытого типа с развернутым ответом

1. *Решите задачу. Приведите полное решение задачи.*

Покупатель приобрел колл-опцион на 100 акций с ценой исполнения 100 рублей и премией 10 рублей за акцию. Определить его прибыль (убыток), если при исполнении опциона рыночная цена акции составила 120 рублей.

Время выполнения – 15 минут.

Ожидаемый результат:

$\text{Сумма } (120 \times 100) \times 100 - (100 + 10) \times 100 = 1000 \text{ руб. (прибыль).}$

Ответ: 1000 руб.

Компетенции (индикаторы): ПК-1 (ПК-1.3)

2. *Решите задачу. Приведите полное решение задачи.*

Рассчитайте балансовую стоимость акции АОЗТ, если сумма активов АОЗТ – 800 тыс. руб., а сумма долгов – 300 тыс. руб. Количество оплаченных акций составило 3000 ед.

Время выполнения – 15 минут.

Ожидаемый результат:

$(800 - 300) / 3000 = 166 \text{ руб.}$

Ответ: 166 руб.

Компетенции (индикаторы): ПК-1 (ПК-1.3)

3. *Решите задачу. Приведите полное решение задачи.*

Рассчитать сумму дивидендов по простым акциям. Исходные данные: прибыль акционерного общества для выплаты дивидендов – 500 млн. руб., сумма привилегированных акций – 400 млн. руб., фиксированный размер дивиденда к номиналу привилегированной акции – 16%.

Время выполнения – 15 минут.

Ожидаемый результат:

$500 - (400 \times 0.16) = 436 \text{ млн. руб.}$

Ответ: 436 млн. руб.

Компетенции (индикаторы): ПК-1 (ПК-1.3)

Экспертное заключение

Представленный фонд оценочных средств (далее – ФОС) по дисциплине «Рынок ценных бумаг» соответствует требованиям ФГОС ВО.

Предлагаемые формы и средства текущего и промежуточного контроля адекватны целям и задачам реализации основной профессиональной образовательной программы по направлению подготовки / специальности 38.03.01. Экономика, профиль «Финансы и кредит».

Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины представлены в полном объеме.

Виды оценочных средств, включенные в представленный фонд, отвечают основным принципам формирования ФОС.

Разработанный и представленный для экспертизы фонд оценочных средств рекомендуется к использованию в процессе подготовки обучающихся по указанному направлению / специальности.

Председатель учебно-методической
комиссии экономического института



Шаповалова Е.Н.

Лист изменений и дополнений

№ п/п	Виды дополнений и изменений	Дата и номер протокола заседания кафедры (кафедр), на котором были рассмотрены и одобрены изменения и дополнения	Подпись (с расшифровкой) заведующего кафедрой (заведующих кафедрами)