***Приложение***

Министерство образования и науки Российской Федерации

**Муромский институт (филиал)**

**федерального государственного бюджетного образовательного учреждения**

**высшего образования**

«Владимирский государственный университет

имени Александра Григорьевича и Николая Григорьевича Столетовых»

Кафедра Менеджмента

Утверждаю

Заведующий кафедрой Менеджмента

|  |  |
| --- | --- |
| \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ | Чайковская Н. В. |
| подпись | инициалы, фамилия |

«\_11\_\_» \_\_\_\_\_\_\_12\_\_\_\_\_\_\_ 2015

Основание:

решение кафедры Менеджмента

от «\_11\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_12\_\_\_\_\_\_ 2015

**Фонд оценочных средств**

**для текущего контроля и промежуточной аттестации**

**при изучении учебной дисциплины**

Биржевое дело

наименование дисциплины

38.03.06 Торговое дело

код и наименование направления подготовки

Профиль "Коммерция"

наименование профиля подготовки

бакалавр

уровень высшего образования

Муром, 2015

**Паспорт фонда оценочных средств**

Фонд оценочных средств (ФОС) для текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по дисциплине «Биржевое дело» разработан в соответствии с рабочей программой, входящей в ОПОП направления подготовки 38.03.06 Торговое дело.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| №№ п/п | Контролируемые разделы (темы) дисциплины | Код контролируемой компетенции (или ее части) | Наименование оценочного средства |
| 1 | Понятие биржи | ПК-7 | Тесты для текущего контроля знаний. Вопросы для защиты лабораторных работ.  |
| 2 | Организация биржевой торговли | ПК-6, ПК-3 | Тесты для текущего контроля знаний  |
| 3 | Управление биржей | ПК-7 | Тесты для текущего контроля знаний  |
| 4 | Технический и фундаментальный анализ на бирже | ПК-3 | Тесты для текущего контроля знаний. Вопросы для защиты лабораторных работ.  |

Комплект оценочных средств по дисциплине «Биржевое дело» предназначен для аттестации обучающихся на соответствие их персональных достижений поэтапным требованиям образовательной программы, в том числе рабочей программы дисциплины «Биржевое дело», для оценивания результатов обучения: знаний, умений, владений и уровня приобретенных компетенций.

Комплект оценочных средств по дисциплине «Биржевое дело» включает:

1. Оценочные средства для проведения текущего контроля успеваемости:

Тесты как система стандартизированных знаний, позволяющая провести процедуру измерения уровня знаний и умений обучающихся.

2. Оценочные средства для проведения промежуточной аттестации в форме:

Для промежуточной аттестации предусмотрен экзамен в форме итогового теста, включающего 15 заданий, в том числе: 8 заданий блока "знать", 4 задания блока "уметь" и 3 задания блока "владеть".

**Перечень компетенций, формируемых в процессе изучения дисциплины «Биржевое дело» при освоении образовательной программы по направлению подготовки 38.03.06 Торговое дело:**

|  |
| --- |
| ***ПК-3: готовность к выявлению и удовлетворению потребностей покупателей товаров, их формированию с помощью маркетинговых коммуникаций, способностью изучать и прогнозировать спрос потребителей, анализировать маркетинговую информацию, конъюнктуру товарного рынка*** |
| ***Знать*** | ***Уметь*** | ***Владеть*** |
| Знать механизм разработки биржевой стратегии  | Разрабатывать биржевую стратегию для различных инвесторов  | Методикой технического и фундаментального анализа биржевой информации с целью изучения конъюнктуры рынка  |
| ***ПК-6: способность выбирать деловых партнеров, проводить с ними деловые переговоры, заключать договора и контролировать их выполнение*** |
| ***Знать*** | ***Уметь*** | ***Владеть*** |
| Методику проведения биржевых торгов, заключения биржевых договоров  | - | - |
| ***ПК-7: способность организовывать и планировать материально-техническое обеспечение предприятий, закупку и продажу товаров*** |
| ***Знать*** | ***Уметь*** | ***Владеть*** |
| Механизм функционирования бирж и различных биржевых сделок  | - | - |

*В результате освоения дисциплины «Биржевое дело» формируется компетенция ПК-3: готовность к выявлению и удовлетворению потребностей покупателей товаров, их формированию с помощью маркетинговых коммуникаций, способностью изучать и прогнозировать спрос потребителей, анализировать маркетинговую информацию, конъюнктуру товарного рынка; формируется компетенция ПК-6: способность выбирать деловых партнеров, проводить с ними деловые переговоры, заключать договора и контролировать их выполнение; формируется компетенция ПК-7: способность организовывать и планировать материально-техническое обеспечение предприятий, закупку и продажу товаров.*

**Показатели, критерии и шкала оценивания компетенций текущего контроля знаний по учебной дисциплине «Биржевое дело»**

Текущий контроль знаний, согласно положению о проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся (далее Положение) в рамках изучения дисциплины «Биржевое дело» предполагает тестирование и выполнение заданий по лабораторным работам.

**Регламент проведения и оценивание тестирования студентов**

В целях закрепления практического материала и углубления теоретических знаний по разделам дисциплины «Биржевое дело» предполагается выполнение тестирования студентов, что позволяет углубить процесс познания, раскрыть понимание прикладной значимости осваиваемой дисциплины.

**Регламент проведения мероприятия**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| № | Вид работы | Продолжительность |
| 1. | Предел длительности прохождения тестов | 40 мин. |
|  | Итого (в расчете на тест) | 40 мин. |

**Критерии оценки тестирования студентов**

|  |  |
| --- | --- |
| **Оценка выполнения тестов** | **Критерии оценки** |
| *1 балл за правильный ответ на 1 вопрос* | *правильно выбранный вариант ответа (в случае закрытого теста), правильно вписанный ответ (в случае открытого теста)* |

**Оценочные средства для текущего контроля знаний по учебной дисциплине «Биржевое дело»**

ТЕСТЫ ПО КУРСУ «БИРЖЕВОЕ ДЕЛО»

БЛОК 1

1. Кто может быть дилером?
2. 1)физическое лицо зарегистрированное в качестве предпринимателя

 2)юридическое лицо

1. 3)коммерческая организация
2. 4)некоммерческая организация
3. В какой форме создается фондовая биржа?

1)закрытого акционерного общества

1. 2)открытого акционерного общества
2. 3)некоммерческого партнерства
3. 4)саморегулируемой организации
4. Можно ли совершать на бирже сделки с ценными бумагами, не включенными в список обращаемых на фондовой бирже ценных бумаг?

1)ситуация возможна

1. 2)ситуация невозможна
2. Кто разрешает споры, возникающие в связи с торговлей ценными бумагами на фондовой бирже?

1)Биржевой Совет

1. 2)Суд
2. 3)Арбитражный суд
3. 4)Третейский суд
4. 5)Министерство финансов РФ
5. Могут ли ценные бумаги, не прошедшие листинг, быть объектом сделок на фондовой бирже?

1)да, в любом случае

1. 2)да, в некоторых случаях
2. 3)нет
3. 4)иной вариант ответа
4. Допускается ли временное членство и сдача брокерских мест в аренду на российских биржах:

1)да

1. 2)нет
2. К кому относится следующее определение: «Они осуществляют сделки на рынке ценных бумаг в интересах другого лица в качестве посредника этого лица»

1)дилеры

1. 2)брокеры
2. 3)аукционисты
3. 4)маклеры
4. К кому относится следующее определение: «Они совершают сделки купли-продажи ценных бумаг на фондовом рынке от своего имени и за свой счет»

1)дилеры

1. 2)брокеры
2. 3)аукционисты
3. 4)маклеры
4. К чему относится следующее определение:

«система безналичных расчетов, основанная на зачете взаимных требований по оплате ценных бумаг»

 1)клиринг

1. 2)депозитарий
2. 3)фиксинг
3. До того, как клиент отдает приказ брокеру, он должен перевести определенный денежный депозит, известный как:

1)клиринговая маржа

1. 2)вариационная маржа
2. 3)первоначальная маржа
3. 4)поддерживающая маржа
4. Во фьючерсной торговле маржа используется для

1)обеспечения исполнения фьючерсных контрактов

1. 2)оплаты брокерских услуг
2. 3)ограничения числа разрешенных сделок
3. 4)гарантии честности всех трейдеров
4. Рыночный приказ включает:

1)лимит цены

1. 2)лимит времени
2. 3)отсутствие указаний о цене
3. 4)стоп-цену
4. Приказ, указывающий цену, по которой он должен быть немедленно исполнен или отменен, называется:

1)стоп-приказ

1. 2)выполнить
2. 3) лимитный приказ
3. 4)рыночный приказ
4. В быстро двигающемся рынке стоп-приказ может быть исполнен по цене, которая слегка выше или слегка ниже, чем указанная в приказе

1)верно

1. 2)неверно
2. Модель «голова и плечи» обычно указывает на:

1)рынок с незначительными колебаниями

1. 2)повышающийся рынок
2. 3)рынок со значительными колебаниями
3. 4)существенный поворот в направлении рынка
4. Продажа опциона привлекательна для инвестора, так как эта операция

 1)имеет неограниченную прибыль

 2)имеет низкий риск

 3)дает возможность авансового получения премии

 4)имеет высокий показатель левериджа

1. Второй стороной каждой сделки на бирже выступает:

 1)покупатель при продаже

 2)продавец при покупке

 3)спекулянт

 4)расчетная плата

1. Цены на бирже определяются

 1)методом открытого выкрика

 2)руководителями биржи

 3)расчетной палатой

 4)приказами клиентов

1. История появления фьючерсных рынков демонстрирует, что они явились в ответ на:

 1)необходимость ликвидных рынков для спекулянтов

 2)необходимость для производителей и потребителей товаров в защите цен

 3)государственное регулирование, запрещающее неорганизованную спекуляцию

 4)отказ банков в выдаче кредитов без обеспечения страхования цен

1. На бирже нужны спекулянты, поскольку они:

 1)увеличивают ликвидность рынков

 2)способствуют процессу выявления цен

 3)облегчают хеджирование

 4)все вышеуказанное вместе

БЛОК 2

1. Первоначальная маржа взимается с участников фьючерсной торговли для того, чтобы:

 1)осуществить частичный платеж по контракту

 2)компенсировать издержки биржи на совершение операции

 3)гарантировать исполнение сделки

 4)оплатить услуги брокера

1. В случае покупки опциона премия выплачивается покупателем продавцу:

 1)в момент заключения опциона

 2)в случае отказа покупателя от условий выполнения опциона

 3)правильного ответа нет

1. Выделите вариант ответа, где дано правильное название сделки с ценными бумагами, совершаемой на фондовой бирже и предусматривающей немедленную оплату и поставку ценных бумаг в тот же день:

 1)кассовая сделка

 2)сделка с опционом

 3)срочная сделка

1. В чем заключается смысл «игры на понижение» на рынке ценных бумаг?

 1)купить ценные бумаги за счет собственных средств по более высокой цене и продать по более низкой

 2)купить ценные бумаги за счет заемных средств по более высокой цене и продать по более низкой

 3)продать собственные ценные бумаги по более высокой цене и выкупить по более низкой

 4)продать ценные бумаги, владение которыми осуществляется на условиях займа, по более высокой цене и выкупить по более низкой

1. Какое влияние на надежность вложений инвестора оказывают операции с опционами?

 1)надежность увеличивается

 2)надежность понижается

 3)не оказывают никакого влияния

1. Первая фондовая биржа возникла:

 1)в XVI в

 2)в XVII в

 3)в XVIII в

 4)в XIX в

1. Назовите высший орган биржи

 1)правление

 2)собрание членов биржи

 3)биржевой совет

1. Сколько бирж действует в США?

 1)около 10

 2)около 200

 3)около 2000

 4)больше 2000

1. Как называют на фондовой бирже игроков, играющих на понижение?

1)быки

 2)медведи

3) зайцы

4) лошади

1. Фьючерс может перекупаться много раз в течение всего срока его действия?

 1)да

 2)нет

 3)зависит от решения биржевого совета

1. В какой стране впервые возникла фондовая биржа?

1)в Англии

 2)во Франции

 3)в Голландии

 4)в России

 5)в Германии

 6)в Японии

1. Хозяйствующий объект приобрел опцион с правом одновременно купить и продать товар

 1)да, это возможно

 2)ситуация не корректна

1. Как называют на фондовой бирже игроков, играющих на повышение?

 1)быки

 2)медведи

 3) зайцы

 4) лошади

1. Членом биржи можно стать:

 1)просто заплатив пай

 2)уплаты пая недостаточно

 3)только после решения биржевого совета

1. В чем заключаются функции котировального комитета на товарной бирже:

 1)составляет правила биржевой торговли, вносит в них изменения, готовит типовые контракты

 2)определяет средний уровень цен на биржевые товары, готовит для публикации данные о нижних и верхних значениях цен по результатам сделок

 2)занимается информационным сервисом

1. Что такое современная биржа?

 1)здание, расположенное в центре торга

 2)организация, учреждение

 3)место торга

 4)место торга и одновременно организация

1. В каком году была создана первая биржа в России?

 1)1653г.

 2)1608г.

 3)1703г.

 4)1394г.

 5)1531г.

1. Каковы функции комитета по правилам биржевой торговли на товарной бирже?

 1)вырабатывает биржевые стандарты, осуществляет экспертизу качества товаров, готовит акты экспертизы

 2)определяет средний уровень цен на биржевые товары, готовит данные о нижних и верхних значениях цен по результатам сделок

 3)готовит типовые контракты, составляет правила биржевой торговли, вносит в них изменения

1. Кто может осуществлять сделки купли-продажи на бирже?

 1)брокеры

 2)банкиры

 3)акционеры

 4)дилеры

 5)все желающие

БЛОК 3

1. Чтобы застраховать себя от потерь на бирже, при заключении сделок на реальный товар по ценам указанным в контракте с поставкой через какой-то период, вы заключите дополнительно:

 1)форвардную сделку

 2)фьючерсную сделку

 3) сделку на реальный товар с поставкой в будущем

1. Фьючерсная сделка это:

 1)сделка на реальный товар с немедленной поставкой

 2)сделка на реальный товар с поставкой в будущем

 3)сделка на срок

1. Представьте, что на фондовой бирже торговля ценными бумагами ведется по принципу организации «залпового рынка», т.е. путем единовременного сопоставления всех приказов на покупку и продажу одного вида ценных бумаг, поступивших на биржу в течение определенного периода времени.

Применительно к этой схеме организации торговли укажите, что представляет собой курс этой ценной бумаги, устанавливаемый биржей?

 1)цену, позволяющую максимизировать количество проданных и купленных ценных бумаг

 2)цену, позволяющую максимизировать количество проданных ценных бумаг

 3)цену, позволяющую удовлетворить наибольшее количество приказов по купле ценных бумаг по минимальной цене

 4)цену, позволяющую удовлетворить наибольшее количество приказов по продаже ценных бумаг по максимальной цене

1. Покупатель опциона в случае отказа от его исполнения:

 1)ничего не теряет

 2)теряет величину премии

 3)оплачивает полные возможные убытки партнера по сделки

1. Какова основная функция специалиста по фондовой бирже?

 1)посредничество в купле-продаже акций за счет и по поручению клиентов

 2)посредничество в размещении на рынке новых выпусков ценных бумаг

 3)выполнение поручений брокеров на покупку-продажу ценных бумаг определенного вида

 4)создание стабильного и справедливого определенного вида ценных бумаг путем их купли-продажи за свой счет

1. Кто может быть членом фондовой биржи?

 1)гражданин РФ

 2)товарная биржа

 3)государственный орган, в основные задачи которого входит осуществление операций с ЦБ

1. Допустим, торговля ЦБ на фондовой бирже ведется по принципу организации «Залпового рынка» (т.е. путем единовременного сопоставления всех приказов на покупку и на продажу одной ЦБ, поступивших на биржу в течение определенного периода времени). Что, применительно к этой схеме организации торговли, представляет собой курс ЦБ, фиксируемый биржей?

 1)цену, позволяющую реализовать наибольшее количество приказов относительно купли ЦБ по минимальной цене

 2)цену, позволяющую реализовать наибольшее число приказов касательно продажи ЦБ по максимальной цене

 3)цену, позволяющую максимизировать количество проданных и купленных ЦБ

 4)цену, позволяющую максимизировать число совершенных сделок

1. Сейчас март. Вы фермер и решили продать свой урожай на бирже. Какой вид сделки Вы выберете?

 1)фьючерсная сделка

 2)форвардная сделка

 3) сделка на реальный товар с немедленной поставкой

48.Колл-опцион предполагает, что

1) покупатель данного опциона имеет право, но не обязанность, купить фьючерсный контракт

2) покупатель данного опциона имеет право, но не обязанность, продать фьючерсный контракт

3) покупатель данного опциона обязан купить фьючерсный контракт при наступлении срока

4) покупатель данного опциона обязан продать фьючерсный контракт при наступлении срока

49.Европейский стиль опциона означает, что

1) опцион может быть использован только в фиксированную дату

2) опцион может быть использован в любой момент в пределах срока опциона

3)покупатель имеет право, но не обязанность покупать определенный фьючерсный контракт

 4)покупатель имеет право, но не обязанность продать фьючерсный контракт

50. Облигации с вариантами, дающие право на реинвестирование купонного дохода в новые облигации того же выпуска

 1)«ангелы»

 2)«кошки и собаки»

 3)«кроличьи»

 4)«бутерброд с маслом»

 5)«макулатура»

1. Подберите синонимы «внебиржевого рынка»

 1)«серый рынок»

 2)«третий рынок»

 3)«уличный рынок»

 4)«тигровый рынок»

1. Скальпирование – это операция с небольшой прибылью

 1)верно

 2)неверно

53.Сторонами фьючерсной сделки являются:

 1)обезличенные партнеры

 2)два конкретных контрагента

1. Сторонами форвардной сделки являются:

 1)обезличенные партнеры

 2)два конкретных контрагента

1. Право покупателя (но не обязанность) купить акции, валюту, другой актив по установленной в документе цене – данный документ называется:

 1)пут-опцион

 2)фьючерсный контракт

 3)колл-опцион

1. Право покупателя (но не обязанность) продать акции, валюту, другой актив по установленной в документе цене

 1)фьючерсный контракт

 2)двойной опцион

 3)форвардный контракт

 4)пут-опцион

1. Стринг – это:

 1)лоты

 2)курс акций

 3)партии лотов

 4)стиль опциона

1. Если пролонгацию сделки осуществляет покупатель, это называется операцией

 1)репорта

 2)хеджирования

 3)депорта

1. Длинную позицию на рынке занимают:

 1)быки

 2)медведи

1. Верно ли следующее утверждение?

«Медведи» объявляют о своем намерении скупить ценные бумаги, стремясь тем самым повысить их курс.

 1)да

 2)нет

1. Можно ли заключить договор комиссии с брокером бессрочно?

 1)да

 2)нет

1. Какой приказ ввиду наличия ограничений может быть выполнен с задержкой, либо не выполнен вообще?

 1)рыночный

 2)лимитированный

 3)стоп-приказ

1. Какая цена будет установлена в качестве официального курса при фиксинге

Спрос Предложение

40 по 352 16 по 350

6 по 351 36 по 351

18 по 350 5 по 352

 1). 350

 2).351

 3).352

 4).другой вариант

1. Из чего складываются доходы биржи?

1)продажа книг

2) продажа информации

3)продажа мест

4)вложение денег в недвижимость

65. Большинство первичных размещений осуществляется на:

 1)биржевом рынке

 2)прибиржевом рынке ценных бумаг

 3)внебиржевом рынке ценных бумаг

1. Как называется следующий индикатор

 *средняя доходность 10 облигаций рейтинга ААА*

 *средняя доходность 40 облигаций рейтинга ВВВ*

 1)норма продаж без покрытия

 2)изменение объема продаж

 3)предложение денег

 4)индекс доверия

67. Рост числа неполных лотов сигнализирует о том, что

 1)есть большая вероятность сохранения существующей динамики цен

 2)тенденция роста цен практически исчерпана

 3)предчувствие многими инвесторами низких цен

 4)предчувствие многими инвесторами высоких цен

1. Позиционные спекулянты держат свои позиции открытыми:

 1)в течении ряда дней

 2)в течении недель, месяцев

 3)в течении одного дня

1. Для периода «разгона» господствующей тенденцией характерен

 1)вырывающийся разрыв

 2)убегающий разрыв

 3)исчерпанный разрыв

1. Фьючерсные контракты заключаются с целью:
2. Страхования
3. Спекуляции
4. Хеджирования и спекуляции
5. хеджирования

**Регламент проведения и оценивание лабораторных работ**

В целях закрепления практического материала и углубления теоретических знаний по разделам дисциплины «Биржевое дело» предполагается выполнение лабораторных работ, что позволяет углубить процесс познания, раскрыть понимание прикладной значимости осваиваемой дисциплины.

**Регламент проведения мероприятия**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| № | Вид работы | Продолжительность |
| 1. | Предел длительности лабораторной работы | 170 мин. |
| 2. | Защита отчета | 10 мин. |
|  | Итого (в расчете на одну лабораторную работу) | 180 мин. |

**Критерии оценки лабораторных работ**

|  |  |
| --- | --- |
| **Оценка** | **Критерии оценивания** |
| **5 баллов** | Задание выполнено полностью, в представленном отчете обоснованно получено правильное выполненное задание. |
| **4 балла** | Задание выполнено полностью, но нет достаточного обоснования или при верном решении допущена незначительная ошибка, не влияющая на правильную последовательность рассуждений. |
| **3 балла** | Задания выполнены частично. |
| **2 балла** | Задание не выполнено. |

**Общее распределение баллов текущего контроля по видам учебных работ для студентов (в соответствии с Положением)**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Рейтинг-контроль 1 | Тестирование, выполнение практических заданий и лабораторных работ | 10 баллов |
| Рейтинг-контроль 2 | Тестирование, выполнение практических заданий и лабораторных работ | 10 баллов |
| Рейтинг-контроль 3 | Тестирование, выполнение практических заданий и лабораторных работ | 10 баллов |
| Посещение занятий студентом | Посещение лекционных, практических и лабораторных занятий | 20 баллов |
| Дополнительные баллы (бонусы) | Активность на практических занятиях и лабораторных работах | 5 баллов |
| Выполнение семестрового плана самостоятельной работы | Выполнение заданий, предусмотренных планом самостоятельной работы студентов | 5 баллов |

**Показатели, критерии и шкала оценивания компетенций промежуточной аттестации знаний по учебной дисциплине «Биржевое дело»**

На основе типовых заданий программным комплексом информационно-образовательного портала МИ ВлГУ формируются в автоматическом режиме тестовые задания для студентов. Программный комплекс формирует индивидуальные задания для каждого зарегистрированного в системе студента и устанавливает время прохождения тестирования. Результатом тестирования является количество набранных баллов. За правильное выполнение каждого тестового задания блока "знать" студент получает по 2 балла, за правильное выполнение каждого задания блока "уметь" - по 3 балла, за правильное выполнение каждого тестового задания блока "владеть" - по 4 балла.

Максимальное количество баллов, которое студент может получить на экзамене, в соответствии с Положением составляет 40 баллов.

|  |  |
| --- | --- |
| **Оценка в баллах** | **Критерии оценивания компетенций** |
| 30-40 баллов | Студент глубоко и прочно усвоил программный материал, исчерпывающе, последовательно, четко и логически стройно его излагает, умеет тесно увязывать теорию с практикой, свободно справляется с задачами, вопросами и другими видами применения знаний, причем не затрудняется с ответом при видоизменении заданий, использует в ответе материал монографической литературы, правильно обосновывает принятое решение, владеет разносторонними навыками и приемами выполнения практических задач, подтверждает полное освоение компетенций, предусмотренных программой экзамена. |
| 20-29 баллов | Студент твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос, правильно применяет теоретические положения при решении практических вопросов и задач, владеет необходимыми навыками и приемами их выполнения, допуская некоторые неточности; демонстрирует хороший уровень освоения материала, информационной и коммуникативной культуры и в целом подтверждает освоение компетенций, предусмотренных программой экзамена. |
| 10-19 баллов | Студент показывает знания только основного материала, но не усвоил его деталей, допускает неточности, недостаточно правильные формулировки, в целом, не препятствует усвоению последующего программного материала, нарушения логической последовательности в изложении программного материала, испытывает затруднения при выполнении практических работ, подтверждает освоение компетенций, предусмотренных программой экзамена на минимально допустимом уровне. |
| Менее 10 баллов | Студент не знает значительной части программного материала (менее 50% правильно выполненных заданий от общего объема работы), допускает существенные ошибки, неуверенно, с большими затруднениями выполняет практические работы, не подтверждает освоение компетенций, предусмотренных программой экзамена. |

**Оценочные средства для промежуточной аттестации по учебной дисциплине «Биржевое дело»**

 ТЕСТЫ ПО КУРСУ «БИРЖЕВОЕ ДЕЛО»

**ПК-3**

ПК-3 готовность к выявлению и удовлетворению потребностей покупателей товаров, их формированию с помощью маркетинговых коммуникаций, способностью изучать и прогнозировать спрос потребителей, анализировать маркетинговую информацию, конъюнктуру товарного рынка

**УМЕТЬ (ПК-3)**

**Разрабатывать биржевую стратегию для различных инвесторов**

1. В чем заключается смысл «игры на понижение» на рынке ценных бумаг?

 1)купить ценные бумаги за счет собственных средств по более высокой цене и продать по более низкой

 2)купить ценные бумаги за счет заемных средств по более высокой цене и продать по более низкой

 3)продать собственные ценные бумаги по более высокой цене и выкупить по более низкой

 4)продать ценные бумаги, владение которыми осуществляется на условиях займа, по более высокой цене и выкупить по более низкой

1. Какое влияние на надежность вложений инвестора оказывают операции с опционами?

 1)надежность увеличивается

 2)надежность понижается

 3)не оказывают никакого влияния

1. Сейчас март. Вы фермер и решили продать свой урожай на бирже. Какой вид сделки Вы выберете?

 1)фьючерсная сделка

 2)форвардная сделка

 3) сделка на реальный товар с немедленной поставкой

48.Колл-опцион предполагает, что

1) покупатель данного опциона имеет право, но не обязанность, купить фьючерсный контракт

2) покупатель данного опциона имеет право, но не обязанность, продать фьючерсный контракт

3) покупатель данного опциона обязан купить фьючерсный контракт при наступлении срока

4) покупатель данного опциона обязан продать фьючерсный контракт при наступлении срока

49.Европейский стиль опциона означает, что

1) опцион может быть использован только в фиксированную дату

2) опцион может быть использован в любой момент в пределах срока опциона

3)покупатель имеет право, но не обязанность покупать определенный фьючерсный контракт

 4)покупатель имеет право, но не обязанность продать фьючерсный контракт

1. Представьте, что на фондовой бирже торговля ценными бумагами ведется по принципу организации «залпового рынка», т.е. путем единовременного сопоставления всех приказов на покупку и продажу одного вида ценных бумаг, поступивших на биржу в течение определенного периода времени.

Применительно к этой схеме организации торговли укажите, что представляет собой курс этой ценной бумаги, устанавливаемый биржей?

 1)цену, позволяющую максимизировать количество проданных и купленных ценных бумаг

 2)цену, позволяющую максимизировать количество проданных ценных бумаг

 3)цену, позволяющую удовлетворить наибольшее количество приказов по купле ценных бумаг по минимальной цене

 4)цену, позволяющую удовлетворить наибольшее количество приказов по продаже ценных бумаг по максимальной цене

1. Допустим, торговля ЦБ на фондовой бирже ведется по принципу организации «Залпового рынка» (т.е. путем единовременного сопоставления всех приказов на покупку и на продажу одной ЦБ, поступивших на биржу в течение определенного периода времени). Что, применительно к этой схеме организации торговли, представляет собой курс ЦБ, фиксируемый биржей?

 1)цену, позволяющую реализовать наибольшее количество приказов относительно купли ЦБ по минимальной цене

 2)цену, позволяющую реализовать наибольшее число приказов касательно продажи ЦБ по максимальной цене

 3)цену, позволяющую максимизировать количество проданных и купленных ЦБ

 4)цену, позволяющую максимизировать число совершенных сделок

1. Какая цена будет установлена в качестве официального курса при фиксинге

Спрос Предложение

40 по 352 16 по 350

6 по 351 36 по 351

18 по 350 5 по 352

 1). 350

 2).351

 3).352

 4).другой вариант

1. Рыночный приказ включает:

1)лимит цены

1. 2)лимит времени
2. 3)отсутствие указаний о цене
3. 4)стоп-цену
4. Приказ, указывающий цену, по которой он должен быть немедленно исполнен или отменен, называется:

1)стоп-приказ

1. 2)выполнить
2. 3) лимитный приказ
3. 4)рыночный приказ
4. В быстро двигающемся рынке стоп-приказ может быть исполнен по цене, которая слегка выше или слегка ниже, чем указанная в приказе

1)верно

1. 2)неверно
2. Продажа опциона привлекательна для инвестора, так как эта операция

 1)имеет неограниченную прибыль

 2)имеет низкий риск

 3)дает возможность авансового получения премии

 4)имеет высокий показатель левериджа

1. История появления фьючерсных рынков демонстрирует, что они явились в ответ на:

 1)необходимость ликвидных рынков для спекулянтов

 2)необходимость для производителей и потребителей товаров в защите цен

 3)государственное регулирование, запрещающее неорганизованную спекуляцию

 4)отказ банков в выдаче кредитов без обеспечения страхования цен

1. На бирже нужны спекулянты, поскольку они:

 1)увеличивают ликвидность рынков

 2)способствуют процессу выявления цен

 3)облегчают хеджирование

 4)все вышеуказанное вместе

1. Фьючерс может перекупаться много раз в течение всего срока его действия?

 1)да

 2)нет

 3)зависит от решения биржевого совета

1. Как называют на фондовой бирже игроков, играющих на повышение?

 1)быки

 2)медведи

 3) зайцы

 4) лошади

1. Чтобы застраховать себя от потерь на бирже, при заключении сделок на реальный товар по ценам указанным в контракте с поставкой через какой-то период, вы заключите дополнительно:

 1)форвардную сделку

 2)фьючерсную сделку

 3) сделку на реальный товар с поставкой в будущем

1. Хозяйствующий объект приобрел опцион с правом одновременно купить и продать товар

 1)да, это возможно

 2)ситуация не корректна

50. Облигации с вариантами, дающие право на реинвестирование купонного дохода в новые облигации того же выпуска

 1)«ангелы»

 2)«кошки и собаки»

 3)«кроличьи»

 4)«бутерброд с маслом»

 5)«макулатура»

1. Скальпирование – это операция с небольшой прибылью

 1)верно

 2)неверно

1. Длинную позицию на рынке занимают:

 1)быки

 2)медведи

1. Верно ли следующее утверждение?

«Медведи» объявляют о своем намерении скупить ценные бумаги, стремясь тем самым повысить их курс.

 1)да

 2)нет

1. Какой приказ ввиду наличия ограничений может быть выполнен с задержкой, либо не выполнен вообще?

 1)рыночный

 2)лимитированный

 3)стоп-приказ

1. Позиционные спекулянты держат свои позиции открытыми:

 1)в течении ряда дней

 2)в течении недель, месяцев

 3)в течении одного дня

1. Фьючерсные контракты заключаются с целью:
2. Страхования
3. Спекуляции
4. Хеджирования и спекуляции
5. хеджирования

**ВЛАДЕТЬ (ПК-3)**

**методикой технического и фундаментального анализа биржевой информации с целью изучения конъюнктуры рынка**

1. Как называется следующий индикатор

 *средняя доходность 10 облигаций рейтинга ААА*

 *средняя доходность 40 облигаций рейтинга ВВВ*

 1)норма продаж без покрытия

 2)изменение объема продаж

 3)предложение денег

 4)индекс доверия

67. Рост числа неполных лотов сигнализирует о том, что

 1)есть большая вероятность сохранения существующей динамики цен

 2)тенденция роста цен практически исчерпана

 3)предчувствие многими инвесторами низких цен

 4)предчувствие многими инвесторами высоких цен

1. Модель «голова и плечи» обычно указывает на:

1)рынок с незначительными колебаниями

1. 2)повышающийся рынок
2. 3)рынок со значительными колебаниями
3. 4)существенный поворот в направлении рынка
4. Для периода «разгона» господствующей тенденцией характерен

 1)вырывающийся разрыв

 2)убегающий разрыв

 3)исчерпанный разрыв

**ПК-6**

ПК-6 способность выбирать деловых партнеров, проводить с ними деловые переговоры, заключать договора и контролировать их выполнение

**ЗНАТЬ (ПК-6)**

**методику проведения биржевых торгов, заключения биржевых договоров, специалистов биржи**

1. Можно ли совершать на бирже сделки с ценными бумагами, не включенными в список обращаемых на фондовой бирже ценных бумаг?

1)ситуация возможна

1. 2)ситуация невозможна
2. Могут ли ценные бумаги, не прошедшие листинг, быть объектом сделок на фондовой бирже?

1)да, в любом случае

1. 2)да, в некоторых случаях
2. 3)нет
3. 4)иной вариант ответа
4. К кому относится следующее определение: «Они осуществляют сделки на рынке ценных бумаг в интересах другого лица в качестве посредника этого лица»

1)дилеры

1. 2)брокеры
2. 3)аукционисты
3. 4)маклеры
4. К кому относится следующее определение: «Они совершают сделки купли-продажи ценных бумаг на фондовом рынке от своего имени и за свой счет»

1)дилеры

1. 2)брокеры
2. 3)аукционисты
3. 4)маклеры
4. До того, как клиент отдает приказ брокеру, он должен перевести определенный денежный депозит, известный как:

1)клиринговая маржа

1. 2)вариационная маржа
2. 3)первоначальная маржа
3. 4)поддерживающая маржа
4. Во фьючерсной торговле маржа используется для

1)обеспечения исполнения фьючерсных контрактов

1. 2)оплаты брокерских услуг
2. 3)ограничения числа разрешенных сделок
3. 4)гарантии честности всех трейдеров
4. Первоначальная маржа взимается с участников фьючерсной торговли для того, чтобы:

 1)осуществить частичный платеж по контракту

 2)компенсировать издержки биржи на совершение операции

 3)гарантировать исполнение сделки

 4)оплатить услуги брокера

1. Как называют на фондовой бирже игроков, играющих на понижение?

1)быки

 2)медведи

3) зайцы

4) лошади

1. Кто может осуществлять сделки купли-продажи на бирже?

 1)брокеры

 2)банкиры

 3)акционеры

 4)дилеры

 5)все желающие

1. Какова основная функция специалиста по фондовой бирже?

 1)посредничество в купле-продаже акций за счет и по поручению клиентов

 2)посредничество в размещении на рынке новых выпусков ценных бумаг

 3)выполнение поручений брокеров на покупку-продажу ценных бумаг определенного вида

 4)создание стабильного и справедливого определенного вида ценных бумаг путем их купли-продажи за свой счет

1. Можно ли заключить договор комиссии с брокером бессрочно?

 1)да

 2)нет

**ПК-7**

ПК-7 способность организовывать и планировать материально-техническое обеспечение предприятий, закупку и продажу товаров

**ЗНАТЬ (ПК-7)**

**механизм организации и функционирования бирж и заключения различных биржевых сделок**

1. Кто может быть дилером?
2. 1)физическое лицо зарегистрированное в качестве предпринимателя

 2)юридическое лицо

1. 3)коммерческая организация
2. 4)некоммерческая организация
3. В какой форме создается фондовая биржа?

1)закрытого акционерного общества

1. 2)открытого акционерного общества
2. 3)некоммерческого партнерства
3. 4)саморегулируемой организации
4. Кто разрешает споры, возникающие в связи с торговлей ценными бумагами на фондовой бирже?

1)Биржевой Совет

1. 2)Суд
2. 3)Арбитражный суд
3. 4)Третейский суд
4. 5)Министерство финансов РФ
5. Допускается ли временное членство и сдача брокерских мест в аренду на российских биржах:

1)да

1. 2)нет
2. К чему относится следующее определение:

«система безналичных расчетов, основанная на зачете взаимных требований по оплате ценных бумаг»

 1)клиринг

1. 2)депозитарий
2. 3)фиксинг
3. Второй стороной каждой сделки на бирже выступает:

 1)покупатель при продаже

 2)продавец при покупке

 3)спекулянт

 4)расчетная плата

1. Цены на бирже определяются

 1)методом открытого выкрика

 2)руководителями биржи

 3)расчетной палатой

 4)приказами клиентов

1. В случае покупки опциона премия выплачивается покупателем продавцу:

 1)в момент заключения опциона

 2)в случае отказа покупателя от условий выполнения опциона

 3)правильного ответа нет

1. Выделите вариант ответа, где дано правильное название сделки с ценными бумагами, совершаемой на фондовой бирже и предусматривающей немедленную оплату и поставку ценных бумаг в тот же день:

 1)кассовая сделка

 2)сделка с опционом

 3)срочная сделка

1. Первая фондовая биржа возникла:

 1)в XVI в

 2)в XVII в

 3)в XVIII в

 4)в XIX в

1. Назовите высший орган биржи

 1)правление

 2)собрание членов биржи

 3)биржевой совет

1. Сколько бирж действует в США?

 1)около 10

 2)около 200

 3)около 2000

 4)больше 2000

1. В какой стране впервые возникла фондовая биржа?

1)в Англии

 2)во Франции

 3)в Голландии

 4)в России

 5)в Германии

 6)в Японии

1. Членом биржи можно стать:

 1)просто заплатив пай

 2)уплаты пая недостаточно

 3)только после решения биржевого совета

1. В чем заключаются функции котировального комитета на товарной бирже:

 1)составляет правила биржевой торговли, вносит в них изменения, готовит типовые контракты

 2)определяет средний уровень цен на биржевые товары, готовит для публикации данные о нижних и верхних значениях цен по результатам сделок

 2)занимается информационным сервисом

1. Что такое современная биржа?

 1)здание, расположенное в центре торга

 2)организация, учреждение

 3)место торга

 4)место торга и одновременно организация

1. В каком году была создана первая биржа в России?

 1)1653г.

 2)1608г.

 3)1703г.

 4)1394г.

 5)1531г.

1. Каковы функции комитета по правилам биржевой торговли на товарной бирже?

 1)вырабатывает биржевые стандарты, осуществляет экспертизу качества товаров, готовит акты экспертизы

 2)определяет средний уровень цен на биржевые товары, готовит данные о нижних и верхних значениях цен по результатам сделок

 3)готовит типовые контракты, составляет правила биржевой торговли, вносит в них изменения

1. Фьючерсная сделка это:

 1)сделка на реальный товар с немедленной поставкой

 2)сделка на реальный товар с поставкой в будущем

 3)сделка на срок

1. Покупатель опциона в случае отказа от его исполнения:

 1)ничего не теряет

 2)теряет величину премии

 3)оплачивает полные возможные убытки партнера по сделки

1. Кто может быть членом фондовой биржи?

 1)гражданин РФ

 2)товарная биржа

 3)государственный орган, в основные задачи которого входит осуществление операций с ЦБ

1. Подберите синонимы «внебиржевого рынка»

 1)«серый рынок»

 2)«третий рынок»

 3)«уличный рынок»

 4)«тигровый рынок»

53.Сторонами фьючерсной сделки являются:

 1)обезличенные партнеры

 2)два конкретных контрагента

1. Сторонами форвардной сделки являются:

 1)обезличенные партнеры

 2)два конкретных контрагента

1. Право покупателя (но не обязанность) купить акции, валюту, другой актив по установленной в документе цене – данный документ называется:

 1)пут-опцион

 2)фьючерсный контракт

 3)колл-опцион

1. Право покупателя (но не обязанность) продать акции, валюту, другой актив по установленной в документе цене

 1)фьючерсный контракт

 2)двойной опцион

 3)форвардный контракт

 4)пут-опцион

1. Стринг – это:

 1)лоты

 2)курс акций

 3)партии лотов

 4)стиль опциона

1. Если пролонгацию сделки осуществляет покупатель, это называется операцией

 1)репорта

 2)хеджирования

 3)депорта

1. Из чего складываются доходы биржи?

1)продажа книг

2) продажа информации

3)продажа мест

4)вложение денег в недвижимость

65. Большинство первичных размещений осуществляется на:

 1)биржевом рынке

 2)прибиржевом рынке ценных бумаг

 3)внебиржевом рынке ценных бумаг

Максимальная сумма баллов, набираемая студентом по дисциплине «Биржевое дело» равна 100.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Оценка в баллах | Оценка по шкале | Обоснование | Уровень сформированности компетенций |
| Более 80 | «Отлично» | Содержание курса освоено полностью, без пробелов, необходимые практические навыки работы с освоенным материалом сформированы, все предусмотренные программой обучения учебные задания выполнены, качество их выполнения оценено числом баллов, близким к максимальному | ***Высокий уровень*** |
| 66-80 | «Хорошо» | Содержание курса освоено полностью, без пробелов, некоторые практические навыки работы с освоенным материалом сформированы недостаточно, все предусмотренные программой обучения учебные задания выполнены, качество выполнения ни одного из них не оценено минимальным числом баллов, некоторые виды заданий выполнены с ошибками | ***Продвинутый уровень*** |
| 50-65 | «Удовлетворительно» | Содержание курса освоено частично, но пробелы не носят существенного характера, необходимые практические навыки работы с освоенным материалом в основном сформированы, большинство предусмотренных программой обучения учебных заданий выполнено, некоторые из выполненных заданий, возможно, содержат ошибки | ***Пороговый уровень*** |
| Менее 50 | «Неудовлетворительно» | Содержание курса не освоено, необходимые практические навыки работы не сформированы, выполненные учебные задания содержат грубые ошибки | Компетенции не сформированы |