

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.

«28» февраля 2025 года

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

по учебной дисциплине

Операции банков на рынке ценных бумаг

(наименование учебной дисциплины, практики)

38.04.08 «Финансы и кредит»

(код и наименование направления подготовки (специальности))

«Банки и банковская деятельность»

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

Разработчик:
доцент


(подпись)

Попов М.И.

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

Заведующий кафедрой
финансов и кредита


(подпись)

Салита С.В.

Луганск 2025 г.

**Комплект оценочных материалов по дисциплине
«Операции банков на рынке ценных бумаг»**

Задания закрытого типа

Задания закрытого типа на выбор правильного ответа

1. *Выберите один правильный ответ.*

Рынок ценных бумаг является частью рынка

- А) финансового
- Б) денежного
- В) капиталов
- Г) реальных активов
- Д) банковских кредитов

Правильный ответ: А.

Компетенции (индикаторы): ПК-3 (ПК-3.3)

2. *Выберите один правильный ответ.*

Без лицензии банки могут проводить следующие операции:

- А) осуществлять хранение ценных бумаг
- Б) выпускать ценные бумаги
- В) покупать ценные бумаги
- Г) производить учёт ценных бумаг
- Д) осуществлять доверительное управление ценными бумагами по договору с физическими и юридическими лицами

Правильный ответ: Д.

Компетенции (индикаторы): ПК-3 (ПК-3.3)

3. *Выберите два правильных ответа.*

Все операции банков с ценными бумагами делятся на виды:

- А) выпуск собственных ценных бумаг
- Б) покупка ценных бумаг
- В) доверительное управление ценными бумагами по договору с физическими и юридическими лицами
- Г) операции с ценными бумагами других эмитентов

Правильный ответ: А, Г.

Компетенции (индикаторы): ПК-3 (ПК-3.3)

Задания закрытого типа на установление соответствия

1. *Установите правильное соответствие между видами сделок с ценными бумагами и участниками рынка. Каждому элементу левого столбца соответствует только один элемент правого столбца.*

Вид сделки

Участник рынка

- | | |
|---------------------|---------------------------------------|
| 1) Банк-инвестор | А) Сделки купли-продажи акций |
| 2) Центральный банк | Б) Андеррайтинг эмиссии облигаций |
| 3) Эмитент | В) Репо-сделка |
| 4) Инвестор | Г) Операции доверительного управления |

Правильный ответ: 1-Г; 2-В, 3-Б, 4-А

Компетенции (индикаторы): ПК-3 (ПК-3.3)

2. Установите правильное соответствие между видом ценной бумаги и её функцией на финансовом рынке. Каждому элементу левого столбца соответствует только один элемент правого столбца.

- | Ценная бумага | Функция |
|---|---------------------------------------|
| 1) Международное инвестирование | А) Акции |
| 2) Хеджирование рисков | Б) Облигации |
| 3) Привлечение капитала | В) Депозитарные расписки |
| 4) Управление долговыми обязательствами | Г) Производные финансовые инструменты |

Правильный ответ: 1-В; 2-Г, 3-А, 4-Б

Компетенции (индикаторы): ПК-3 (ПК-3.3)

3. Установите правильное соответствие между конкретным видом банковской деятельности и ее названием. Каждому элементу левого столбца соответствует только один элемент правого столбца.

- | Вид банковской деятельности | Ее названием |
|------------------------------------|--|
| 1) Эмиссионные операции | А) Банки выступают эмитентами ценных бумаг, выпуская акции, векселя, облигации, сберегательные и депозитные сертификаты |
| 2) Проспект ценных бумаг | Б) Банки инвестируют в ценные бумаги, чтобы получить прибыль с помощью привлечённых или собственных средств. Обычно банковскими инвестициями считаются ценные бумаги, срок погашения которых составляет не более одного года |
| 3) Инвестиционные операции | В) Документ, который подготавливает банк-эмитент и утверждает совет директоров, содержит данные о банке-эмитенте и его ценных бумагах |
| 4) Брокерские и дилерские операции | Г) Банк осуществляет посредническую деятельность в области продажи и покупки ценных бумаг по поручению и за счёт клиента, а также за свой счёт и от своего имени |

Правильные ответы: 1-А; 2-В, 3-Б, 4-Г

Компетенции (индикаторы): ПК-3 (ПК-3.3)

Задания закрытого типа на установление правильной последовательности

1. *Установите правильную последовательность. Запишите правильную последовательность букв слева направо.*

Установить правильную последовательность процесса покупки ценных бумаг для инвестиционного портфеля банка.

А) постановка конкретной цели инвестирования и её срока

Б) формирование инвестиционного портфеля

В) выбор подходящей инвестиционной стратегии

Г) анализ бюджета и выделение суммы для инвестиций

Правильный ответ: Г, А, В, Б

Компетенции (индикаторы): ПК-3 (ПК-3.3)

2. *Установите правильную последовательность. Запишите правильную последовательность букв слева направо.*

Установить правильную последовательность действий банка, предоставляющего брокерские услуги клиенту.

А) подача клиентом и приём поручения на совершения сделок

Б) проверка достаточности денежных средств и ценных бумаг

В) урегулирование сделки и проведение расчётов по сделке

Г) заключение банком сделки (сделок)

Правильный ответ: А, Б, Г, В

Компетенции (индикаторы): ПК-3 (ПК-3.3)

3. *Установите правильную последовательность. Запишите правильную последовательность букв слева направо.*

1. Установить правильную последовательность действий банка при активном управлении портфелем ценных бумаг.

А) сопоставление характеристик

Б) составление прогноза состояния рынка

В) проведение самостоятельного анализа

Г) выбор ценных бумаг

Правильный ответ: В, Б, Г, А

Компетенции (индикаторы): ПК-3 (ПК-3.3)

Задания открытого типа

Задания открытого типа на дополнение

1. *Напишите пропущенное слово.*

Оказание услуг по хранению сертификатов ценных бумаг и/или учёту и переходу прав на ценные бумаги - это деятельность _____ типа.

Правильный ответ: депозитарного
Компетенции (индикаторы): ПК-3 (ПК-3.3)

2. *Напишите пропущенное слово.*

Совершение сделок купли-продажи ценных бумаг от своего имени и за свой счёт путём публичного объявления цен покупки и/или продажи определённых ценных бумаг с обязательством покупки и/или продажи этих ценных бумаг по объявленным лицом, осуществляющим такую деятельность, ценам называется _____ деятельность.

Правильный ответ: дилерская
Компетенции (индикаторы): ПК-3 (ПК-3.3)

3. *Напишите пропущенное слово.*

Деятельность по исполнению поручения клиента на совершение гражданско-правовых сделок с ценными бумагами и (или) на заключение договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, осуществляемая на основании возмездных договоров с клиентом называется _____.

Правильный ответ: брокерской.
Компетенции (индикаторы): ПК-3 (ПК-3.3)

Задания открытого типа с кратким свободным ответом

1. *Напишите пропущенное словосочетание.*

К дилерам относятся банки и _____, которые занимаются торговлей ценными бумагами.

Правильный ответ: инвестиционные компании.
Компетенции (индикаторы): ПК-3 (ПК-3.3)

2. *Напишите пропущенное словосочетание.*

Брокеры - _____, которое имеет право совершать операции с ценными бумагами по поручению клиента и за его счёт.

Правильный ответ: юридическое лицо.
Компетенции (индикаторы): ПК-3 (ПК-3.3)

3. *Напишите пропущенное словосочетание.*

Деятельность на фондовой бирже могут осуществлять только её члены, которые проходят _____.

Правильный ответ: соответствующую сертификацию.
Компетенции (индикаторы): ПК-3 (ПК-3.3)

Задания открытого типа с развёрнутым ответом

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

Рыночный курс акций компании «В» составляет 500 долл. Инвестор приобретает опцион на покупку акций 100 шт. по курсу 60 долл. Премия по опциону

составляет 500 долл. Срок действия опциона – 3 месяца. Какова будет прибыль на опцион, если к концу действия опциона рыночная цена акций составит 80 долл.? Каков будет убыток инвестора, если курсовая цена акции на рынке будет равна 50 долл.?

Решение: доход по опциону составит: $80 \times 100 - (60 \times 100 + 500) = 1500$ долл.

Правильный ответ: 1500 долл.

Компетенции (индикаторы): ПК-3 (ПК-3.3)

2. Решите задачу. Приведите полное решение задачи.

Акции с дивидендной ставкой 20% при номинальной стоимости 2000 руб. проданы через год по рыночной стоимости 3000 руб. Определить совокупный доход акции и доходности акции в процентах.

Решение: 1) $D_{год} = (2000 \times 20\%) / 100\% = 400$ руб.

2) $D_{доп} = 3000 - 2000 = 1000$ руб.

2) $D_{совок.} = 1000 + 400 = 1400$ руб.

2) Доходность акции = $(1400 / 2000) \times 100\% = 70\%$

Правильный ответ: 70%

Компетенции (индикаторы): ПК-3 (ПК-3.3)

3. Решите задачу. Приведите полное решение задачи.

Рассчитайте налог на прибыль, если известно, что облигация федерального займа с переменным купоном была приобретена юридическим лицом по цене 103% (с учетом накопленного купонного дохода) от номинала. Срок последнего купонного периода составляет 94 дня. Купонная ставка — 24% годовых. Налог на процентный доход при погашении составил 7 руб.

Решение: определим цену облигации к моменту погашения по формуле простых процентов:

$$PK = N \cdot (1 + t \times R / 365),$$

Где t – длительность купона, R – размер купона, N – номинальная цена облигации.

Тогда процентный доход составит:

$$NPV = PK - N = N \times t \times R / 365 = 100 \times 94 \times 0,24 / 365 = 6,18$$

Тогда ставка налога на процентный доход составит:

$q = 7 / (6,18 + 3) = 0,76$ рублей с 1% процента купонного дохода. Предположим, что ставка налога на прибыль такая же, как и налога на купонный доход, тогда величина налога на прибыль:

$$NPV \times q = 6,18 \times 0,76 = 4,7 \text{ руб.}$$

Правильный ответ: 4,7 руб.

Компетенции (индикаторы): ПК-3 (ПК-3.3)

Экспертное заключение

Представленный фонд оценочных средств (далее – ФОС) по дисциплине «Операции банков на рынке 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 38.04.08 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.

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)