

Федеральное государственное образовательное бюджетное
учреждение высшего образования
«Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации»
Уфимский филиал Финуниверситета

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

по дисциплине «Математическое обеспечение финансовых решений»

Разработчик: кафедра «Математика и информатика»

Направление подготовки: 38.04.01 Экономика

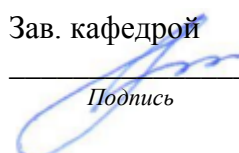
Образовательная программа: все направления подготовки магистратуры

РАССМОТРЕН
На заседании кафедры
«Математика и информатика»

Разработан основе

Протокол № 11
от « 31 » июня 2022 г.

Зав. кафедрой

 /С.А. Фархиева

Подпись

Оценочные средства для оценки сформированности компетенций

Вопрос 1. (ПКН-3) Сложные проценты являются более выгодными для заемщиков, чем простые проценты.

- (1) Верно
- (2) Неверно
- (3) Зависит от условий договора
- (4) С точки зрения заемщика нет разницы между простыми и сложными процентами

Вопрос 2. (ПКН-3) Если применяется простая процентная ставка, то сумма начисленных процентов уменьшается каждый год.

- (1) Верно
- (2) Неверно
- (3) Зависит от условий договора
- (4) Никогда не происходит

Вопрос 3. (ПКН-4) Вексель может быть использован:

- (1) Только для внутренних расчетов
- (2) Только для международных расчетов
- (3) Для внутренних и международных расчетов
- (4) Только в наличной форме

Вопрос 4. (ПКН-4) Депозитный сертификат может быть обменен на:

- (1) Акции компании
- (2) Банковские бонусы
- (3) Наличные деньги
- (4) Вексель

Вопрос 5. (УК-7) Может ли эквивалентность потоков платежей нарушаться при изменении срока выплат?

- (1) Может
- (2) Не может
- (3) Зависит от суммы выплат
- (4) Зависит от валюты выплат

Вопрос 6. (УК-7) Какой фактор не влияет на эквивалентность потока платежей?

- (1) Суммарный размер платежей
- (2) Валюта платежей
- (3) Регулярность выплат
- (4) Дата выплат

Вопрос 7. (УК-7) Как определяется купонный доход по облигации?

- (1) Разность между номинальной стоимостью и ценой продажи облигации
- (2) Периодически начисляемый доход в процентах от номинальной стоимости облигации
- (3) Количество облигаций в портфеле инвестора

(4) Количество сделок с облигациями на рынке

Вопрос 8. (УК-7) Каковы основные преимущества инвестирования в купонные облигации?

- (1) Стабильный доход, низкий уровень риска, возможность диверсификации инвестиционного портфеля
- (2) Высокий доход, большой потенциал роста цены, защита от инфляции
- (3) Высокая ликвидность, низкий уровень корреляции с другими активами, управляемость рисками
- (4) Возможность быстрой реализации, высокая доходность, возможность получения премии в случае преждевременного выкупа облигации

Вопрос 9. (ПКН-5) Что такое рыночная цена облигации?

- (1) Цена, по которой облигация продается на вторичном рынке
- (2) Цена, по которой облигация была размещена на первичном рынке
- (3) Цена, по которой облигация будет погашена
- (4) Цена, которую инвестор должен заплатить за покупку облигации

Вопрос 10. (ПКН-3) Дюрация - это мера чувствительности цены облигации к изменению процентных ставок.

- (1) Верно
- (2) Неверно
- (3) Зависит от других факторов
- (4) Это не имеет значения

Вопрос 11. (ПКН-5) Дюрация является полной мерой риска портфеля облигаций.

- (1) Верно
- (2) Неверно
- (3) Зависит от других факторов
- (4) Это не имеет значения

Вопрос 12. (ПКН-4) Внутренняя норма доходности потока платежей - это:

- (1) такая норма доходности, которую желал бы получить инвестор;
- (2) такая ставка дисконтирования, при которой современная стоимость потока платежей равна нулю;
- (3) фактическая доходность, которую получит инвестор, рассчитанная с учетом инфляции и непредвиденных на этапе планирования издержек;
- (4) доходность финансовой операции до уплаты налогов.

Вопрос 13. (ПКН-5) Модель Блэка-Шоулза может использоваться для оценки стоимости:

- (1) золота
- (2) нефти
- (3) валюты
- (4) финансовых инструментов

Вопрос 14. (ПКН-4) Этот опцион дает владельцу опциона право на покупку актива по заранее оговоренной цене, но не обязывает его к покупке?

- (1) Колл-опцион
- (2) Пут-опцион
- (3) Европейский опцион
- (4) Американский опцион

Вопрос 15. (ПКН-3) Что такое "стратегия замещения" в контексте опционов?

- (1) Стратегия, позволяющая заменить один актив другим
- (2) Стратегия, позволяющая заменить покупку актива непосредственно на покупку опциона на этот актив
- (3) Стратегия, позволяющая заменить продажу актива непосредственно на продажу опциона на этот актив
- (4) Стратегия, при которой инвестор отказывается от опционов в пользу прямой покупки или продажи активов

Вопрос 16. (ПКН-3) Вид облигации, который не предусматривает выплату процентов, а выплачивает лишь номинальную стоимость в момент погашения, называется ... облигацией.

Вопрос 17. (ПКН-3) - это совокупность акций, облигаций, фондов, которые покупаются инвестором. Может состоять из различных видов ценных бумаг в зависимости от целей инвестора.

Вопрос 18. (ПКН-3) Риск, связанный с возможными изменениями цен активов на рынке, обусловленными изменением макроэкономических, политических, финансовых и других факторов, называется ... риском ценной бумаги.

Вопрос 19. (ПКН-3) Портфель ценных бумаг, который имеет максимально возможную доходность при определенном уровне риска, называется портфелем.

Вопрос 20. (ПКН-3) Риск, связанный с индивидуальными особенностями определенной ценной бумаги, такие как кредитоспособность эмитента, ожидаемый поток доходов, уровень дивидендов, называется ... риском ценной бумаги.

Критерии оценивания:

Оценкой «отлично» (зачет) оценивается полное освоение компетенции по данной дисциплине – 85 и выше баллов.

Оценкой «хорошо» (зачет) оценивается усвоение компетенции, однако в ответах допускаются неточности и незначительные ошибки – от 70 до 84 баллов.

Оценка «удовлетворительно» (зачет) свидетельствует о том, что студент освоил компетенции, допускает отдельные ошибки – от 50 до 69 баллов.

Оценка «неудовлетворительно» (незачет) выставляется в том случае, если студентом компетенции не освоены и ответы содержат существенные ошибки – менее 50 баллов.

Ключ к тесту

[illegible]