

**ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ
ПО ДИСЦИПЛИНЕ**

Управление активами и пассивами банка

Код модуля
1150886

Модуль
Современные перспективы развития банковского
сектора и инвестиций

Екатеринбург

Оценочные материалы составлены автором(ами):

| № п/п | Фамилия, имя, отчество | Ученая степень, ученое звание | Должность | Подразделение |
|--------------|-------------------------------|--|-----------------------|--|
| 1 | Попова Анастасия Васильевна | без ученой степени, без ученого звания | Старший преподаватель | "Банковский и инвестиционный менеджмент" |
| 2 | Ходоровский Михаил Яковлевич | Д.Э.Н., Профессор | Профессор | Банковский и инвестиционный менеджмент |

Согласовано:

Управление образовательных программ

И.Ю. Русакова

Авторы:

- Попова Анастасия Васильевна, Старший преподаватель, "Банковский и инвестиционный менеджмент"
- Ходоровский Михаил Яковлевич, Профессор, Банковский и инвестиционный менеджмент

1. СТРУКТУРА И ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ Управление активами и пассивами банка

| | | | |
|----|--------------------------------------|--|---|
| 1. | Объем дисциплины в зачетных единицах | 4 | |
| 2. | Виды аудиторных занятий | Лекции Практические/семинарские занятия | |
| 3. | Промежуточная аттестация | Экзамен | |
| 4. | Текущая аттестация | Контрольная работа | 1 |
| | | Домашняя работа | 1 |

2. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ (ИНДИКАТОРЫ) ПО ДИСЦИПЛИНЕ МОДУЛЯ Управление активами и пассивами банка

Индикатор – это признак / сигнал/ маркер, который показывает, на каком уровне обучающийся должен освоить результаты обучения и их предъявление должно подтвердить факт освоения предметного содержания данной дисциплины, указанного в табл. 1.3 РПМ-РПД.

Таблица 1

| Код и наименование компетенции | Планируемые результаты обучения (индикаторы) | Контрольно-оценочные средства для оценивания достижения результата обучения по дисциплине |
|--|---|---|
| 1 | 2 | 3 |
| ПК-2 -Способен проводить казначейские операции банка по управлению стоимостью ресурсов | З-1 - Знать широкий спектр финансовых услуг П-1 - Владеть навыками финансового консультирования для достижения поставленных профессиональных задач У-1 - Уметь проводить финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг | Домашняя работа Контрольная работа Лекции Экзамен |
| ПК-3 -Способен осуществлять планирование и прогнозирование структуры портфелей | З-1 - Знать структуру финансового плана для клиента и целевого инвестиционного портфеля | Домашняя работа Контрольная работа Практические/семинарские занятия Экзамен |

| | | |
|-----------------------------|--|--|
| в рамках казначейства банка | П-1 - Владеть методами финансового планирования и формирования целевого инвестиционного портфеля У-1 - Уметь проводить разработку финансового плана для клиента и целевого инвестиционного портфеля | |
|-----------------------------|--|--|

3. ПРОЦЕДУРЫ КОНТРОЛЯ И ОЦЕНИВАНИЯ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ В РАМКАХ ТЕКУЩЕЙ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ДИСЦИПЛИНЕ МОДУЛЯ В БАЛЬНО-РЕЙТИНГОВОЙ СИСТЕМЕ (ТЕХНОЛОГИЧЕСКАЯ КАРТА БРС)

3.1. Процедуры текущей и промежуточной аттестации по дисциплине

| | | |
|---|--|-------------------------------------|
| 1. Лекции: коэффициент значимости совокупных результатов лекционных занятий – 0.5 | | |
| Текущая аттестация на лекциях | Сроки – семестр, учебная неделя | Максимальная оценка в баллах |
| <i>работа на занятиях</i> | 1,18 | 100 |
| Весовой коэффициент значимости результатов текущей аттестации по лекциям – 0.5 | | |
| Промежуточная аттестация по лекциям – экзамен | | |
| Весовой коэффициент значимости результатов промежуточной аттестации по лекциям – 0.5 | | |
| 2. Практические/семинарские занятия: коэффициент значимости совокупных результатов практических/семинарских занятий – 0.5 | | |
| Текущая аттестация на практических/семинарских занятиях | Сроки – семестр, учебная неделя | Максимальная оценка в баллах |
| <i>контрольная работа</i> | 1,5 | 40 |
| <i>домашняя работа</i> | 1,8 | 30 |
| <i>работа на занятиях</i> | 1,18 | 30 |
| Весовой коэффициент значимости результатов текущей аттестации по практическим/семинарским занятиям– 1 | | |
| Промежуточная аттестация по практическим/семинарским занятиям–нет | | |
| Весовой коэффициент значимости результатов промежуточной аттестации по практическим/семинарским занятиям– не предусмотрено | | |
| 3. Лабораторные занятия: коэффициент значимости совокупных результатов лабораторных занятий –не предусмотрено | | |
| Текущая аттестация на лабораторных занятиях | Сроки – семестр, учебная неделя | Максимальная оценка в баллах |
| | | |
| Весовой коэффициент значимости результатов текущей аттестации по лабораторным занятиям -не предусмотрено | | |

Промежуточная аттестация по лабораторным занятиям –нет
Весовой коэффициент значимости результатов промежуточной аттестации по лабораторным занятиям – не предусмотрено

3.2. Процедуры текущей и промежуточной аттестации курсовой работы/проекта

| Текущая аттестация выполнения курсовой работы/проекта | Сроки – семестр, учебная неделя | Максимальная оценка в баллах |
|---|---------------------------------|------------------------------|
| | | |
| Весовой коэффициент текущей аттестации выполнения курсовой работы/проекта– не предусмотрено | | |
| Весовой коэффициент промежуточной аттестации выполнения курсовой работы/проекта– защиты – не предусмотрено | | |

4. КРИТЕРИИ И УРОВНИ ОЦЕНИВАНИЯ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ МОДУЛЯ

4.1. В рамках БРС применяются утвержденные на кафедре/институте критерии (признаки) оценивания достижений студентов по дисциплине модуля (табл. 4) в рамках контрольно-оценочных мероприятий на соответствие указанным в табл.1 результатам обучения (индикаторам).

Таблица 4

Критерии оценивания учебных достижений обучающихся

| Результаты обучения | Критерии оценивания учебных достижений, обучающихся на соответствие результатам обучения/индикаторам |
|---------------------|--|
| Знания | Студент демонстрирует знания и понимание в области изучения на уровне указанных индикаторов и необходимые для продолжения обучения и/или выполнения трудовых функций и действий, связанных с профессиональной деятельностью. |
| Умения | Студент может применять свои знания и понимание в контекстах, представленных в оценочных заданиях, демонстрирует освоение умений на уровне указанных индикаторов и необходимых для продолжения обучения и/или выполнения трудовых функций и действий, связанных с профессиональной деятельностью. |
| Опыт /владение | Студент демонстрирует опыт в области изучения на уровне указанных индикаторов. |
| Другие результаты | Студент демонстрирует ответственность в освоении результатов обучения на уровне запланированных индикаторов. Студент способен выносить суждения, делать оценки и формулировать выводы в области изучения. Студент может сообщать преподавателю и коллегам своего уровня собственное понимание и умения в области изучения. |

4.2 Для оценивания уровня выполнения критериев (уровня достижений обучающихся при проведении контрольно-оценочных мероприятий по дисциплине модуля) используется универсальная шкала (табл. 5).

Таблица 5

Шкала оценивания достижения результатов обучения (индикаторов) по уровням

| Характеристика уровней достижения результатов обучения (индикаторов) | | | | |
|---|--|---|------------|---|
| № п/п | Содержание уровня выполнения критерия оценивания результатов обучения (выполненное оценочное задание) | Шкала оценивания | | |
| | | Традиционная характеристика уровня | | Качественная характеристика уровня |
| 1. | Результаты обучения (индикаторы) достигнуты в полном объеме, замечаний нет | Отлично (80-100 баллов) | Зачтено | Высокий (В) |
| 2. | Результаты обучения (индикаторы) в целом достигнуты, имеются замечания, которые не требуют обязательного устранения | Хорошо (60-79 баллов) | | Средний (С) |
| 3. | Результаты обучения (индикаторы) достигнуты не в полной мере, есть замечания | Удовлетворительно (40-59 баллов) | | Пороговый (П) |
| 4. | Освоение результатов обучения не соответствует индикаторам, имеются существенные ошибки и замечания, требуется доработка | Неудовлетворительно (менее 40 баллов) | Не зачтено | Недостаточный (Н) |
| 5. | Результат обучения не достигнут, задание не выполнено | Недостаточно свидетельств для оценивания | | Нет результата |

5. СОДЕРЖАНИЕ КОНТРОЛЬНО-ОЦЕНОЧНЫХ МЕРОПРИЯТИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ МОДУЛЯ

5.1. Описание аудиторных контрольно-оценочных мероприятий по дисциплине модуля

5.1.1. Лекции

Самостоятельное изучение теоретического материала по темам/разделам лекций в соответствии с содержанием дисциплины (п. 1.2. РПД)

5.1.2. Практические/семинарские занятия

Примерный перечень тем

1. Определение проектного финансирования (ПФ) Ключевые характеристики
2. Основные сферы приложения Инвестиционные инструменты
3. Роль Международных финансовых институтов
4. Цели оценки эффективности Оптимизация издержек проекта Элементы

экономического анализа

5. Расчет прямых и косвенных доходов проекта

6. Основные типы рисков в ПФ-структурах Прицепы эффективного распределения рисками

LMS-платформа – не предусмотрена

5.2. Описание внеаудиторных контрольно-оценочных мероприятий и средств текущего контроля по дисциплине модуля

Разноуровневое (дифференцированное) обучение.

Базовый

5.2.1. Контрольная работа

Примерный перечень тем

1. Источники финансирования банка и их характеристики.
2. Проблемы управления активами и пассивами в современных экономических условиях.
3. Активная политика управления капиталом.
4. Методика расчета собственных средств (капитала) банка.
5. Источники основного капитала банк и их характеристики.
6. Источники дополнительного капитала банка и их характеристика.
7. Возможные схемы недобросовестного формирования собственных средств (капитала) банка.
8. Управление банком в кризисных ситуациях

Примерные задания

LMS-платформа – не предусмотрена

5.2.2. Домашняя работа

Примерный перечень тем

1. Методы оценки эффективности функционирования банка
2. Управление капиталом банка (задачи, система управления, организация управления капиталом).
3. Структура банковского капитала и относительная значимость его элементов
4. Анализ активов и пассивов банка (на примере любого банка).
5. Проблемы управления капиталом банка.
6. Определение темпа внутреннего капиталобразования
7. Внутренние источники привлечения капитала и их характеристика.

Примерные задания

LMS-платформа – не предусмотрена

5.3. Описание контрольно-оценочных мероприятий промежуточного контроля по дисциплине модуля

5.3.1. Экзамен

Список примерных вопросов

1. Чем определяется необходимость анализа устойчивости ресурсной базы банка при оценке его финансового состояния?
2. Что понимается под ресурсной базой банка?
3. Какие основные статьи составляют структуру привлеченных средств банка?
4. Каковы основные факторы, влияющие на устойчивость ресурсной базы банка?
5. Чем отличаются «летучие» депозиты от «сердцевинных»?
6. Как влияет степень концентрации ресурсов на устойчивость ресурсной базы банка?

7. Какие основные привлеченные средства банка являются наиболее неустойчивыми ресурсами?

8. В чем заключается цель анализа устойчивости ресурсной базы банка?

9. Что такое чистая ликвидная позиция банка? Как она рассчитывается?

10. Как рассчитываются средний срок хранения вкладного рубля и уровень оседания средств, поступивших во вклады?

LMS-платформа – не предусмотрена

5.4 Содержание контрольно-оценочных мероприятий по направлениям воспитательной деятельности

Направления воспитательной деятельности сопрягаются со всеми результатами обучения компетенций по образовательной программе, их освоение обеспечивается содержанием всех дисциплин модулей.