

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Ващенко Андрей Александрович

Должность: Ректор

Дата подписания: 30.05.2024 15:29:40

Уникальный программный ключ:

51187754f94e37d00c9236cc9eaf21a22f0a3b731acd32879ec947ce3c66589d

**Автономная некоммерческая организация высшего образования
«Волгоградский институт бизнеса»**

Утверждаю
Проректор по учебной работе
и управлению качеством
Л.В. Шамрай-Курбатова
«27» мая 2024 г.

Рабочая программа учебной дисциплины

Рынок ценных бумаг

(Наименование дисциплины)

38.03.01 Экономика, направленность (профиль) «Финансы и Кредит»

(Направление подготовки / Профиль)

Бакалавр

(Квалификация)

Кафедра разработчик

Финансово-экономических дисциплин

Год набора

2024

Вид учебной деятельности	Трудоемкость (объем) дисциплины					
	Очная форма	Очно-заочная форма		Заочная форма		
		д	в	св/ву	з	сз
Зачетные единицы	2	2	2	2	-	2
Общее количество часов	72	72	72	72	-	72
Аудиторные часы контактной работы обучающегося с преподавателями:	32	16	16	8	-	8
- Лекционные (Л)	16	8	8	6	-	6
- Практические (ПЗ)	16	8	8	2	-	2
- Лабораторные (ЛЗ)						
- Семинарские (СЗ)						
Самостоятельная работа обучающихся (СРО)	4	20	20	55	-	60
К (Р-Г) Р (П) (+;-)						
Тестирование (+;-)						
ДКР (+;-)						
Зачет (+;-)						
Зачет с оценкой (+;- (Кол-во часов))						
Экзамен (+;- (Кол-во часов))	+(36)	+(36)	+(36)	+(9)	-	+(4)

Волгоград 2024

Содержание

Раздел 1. Организационно-методический раздел	3
Раздел 2. Тематический план.....	7
Раздел 3. Содержание дисциплины.....	12
Раздел 4. Организация самостоятельной работы обучающихся.....	15
Раздел 5. Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации обучающихся.....	17
Раздел 6. Перечень учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины	23
Раздел 7. Материально-техническая база и информационные технологии.....	26
Раздел 8. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины	28

Раздел 1. Организационно-методический раздел

1.1. Цели освоения дисциплины

Дисциплина «Рынок ценных бумаг» входит в «Часть, формируемая участниками образовательных отношений» дисциплин подготовки обучающихся по направлению подготовки «38.03.01 Экономика», направленность (профиль) «Финансы и кредит».

Целью дисциплины является формирование **компетенций** (в соответствии с ФГОС ВО и требованиями к результатам освоения основной профессиональной образовательной программы (ОПОП ВО)):

УК-10 Способен принимать обоснованные экономические решения в различных областях жизнедеятельности;

ПК-1 Способен поводить фундаментальный анализ финансовых рынков, на основании которого дает рекомендации по совершению сделок с различными активами, финансовыми инструментами;

ПК-3 Способен осуществлять мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков.

Дескрипторы универсальных компетенций:

УК-10.2 Способен управлять личными финансами, провести финансовый анализ, имеет представление о финансовых продуктах

Дескрипторы профессиональных компетенций:

ПК-1.1 Способен осуществлять анализ состояния финансовых рынков и анализировать их динамику, включая рынки финансовых инструментов

ПК-3.1 Способен осуществлять мониторинг процесса ценообразования на банковские, страховые и инвестиционные продукты и услуги

ПК-3.2 Способен проводить исследование финансовых рынков, на основании которого давать рекомендации их по усовершенствованию

В результате освоения дисциплины у студентов должны быть сформированы индикаторы компетенций:

Обобщенная трудовая функция/ трудовая функция	Код и наименование дескриптора компетенций	Код и наименование индикатора достижения компетенций (из ПС)
<p>ПС 08.008 «Специалист по финансовому консультированию»</p> <p>А.</p> <p>Консультирование клиентов по использованию финансовых продуктов и услуг</p> <p>А/01.6 Мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков</p> <p>А/02.6 Подбор в интересах клиента поставщиков финансовых услуг и консультирование клиента по ограниченному кругу финансовых продуктов</p> <p>Трудовые функции ПС 08.015 «Специалист по</p>	<p>УК-10.2 Способен управлять личными финансами, провести финансовый анализ, имеет представление о финансовых продуктах</p>	<p>Знание:</p> <p>ПС-08.008 Специалист по финансовому консультированию</p> <p>ИД-4 УК-10.2 Основы гражданского, семейного и трудового права, регулирующие финансовые отношения домохозяйств и влияющие на сферу управления личными финансами(А/01.6)</p> <p>ИД-6 УК-10.2 Характеристики финансовых продуктов и услуг(А/01.6)</p> <p>ПС-08.015Специалист по корпоративному кредитованию</p> <p>ИД-10 УК-10.2 Основы финансового анализа(А/02.6)</p> <p>Умения:</p> <p>ПС 08.008 Специалист по финансовому консультированию</p> <p>ИД-11УК-10.2 Производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг(А/01.6)</p>

<p>корпоративному кредитованию» А. Обеспечение проведения сделок кредитования корпоративных заемщиков А/02.6 Оценка платежеспособности и кредитоспособности потенциального корпоративного заемщика</p>		<p><i>Навыки и (или)опыт деятельности:</i> ПС 08.008 Специалист по финансовому консультированию ИД-14УК-10.2 Составление подробных паспортов финансовых продуктов(А/01.6)</p>
<p>ПС 08.008 «Специалист по финансовому консультированию» А. Консультирование клиентов по использованию финансовых продуктов и услуг А/01.6 Мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков</p>	<p>ПК-1.1 Способен осуществлять анализ состояния финансовых рынков и анализировать их динамику, включая рынки финансовых инструментов</p>	<p><i>Знание:</i> ПС 08.008 Специалист по финансовому консультированию ИД-1ПК-1.1 Конъюнктура и механизмы функционирования финансовых рынков А/01.6 ИД-3 ПК-1.1 Характеристики финансовых продуктов и услуг А/01.6 ИД-6ПК-1.1 Нормативная база в области финансовой деятельности А/01.6 ИД-9ПК-1.1 Современная финансовая система и финансовый рынок, история развития финансовой системы и финансового рынка А/01.6 <i>Умения:</i> ПС 08.008 Специалист по финансовому консультированию ИД-14ПК-1.1 Производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг А/01.6 <i>Навыки и (или)опыт деятельности:</i> ПС 08.008 Специалист по финансовому консультированию ИД-16 ПК-1.1 Проведение исследования финансового рынка и изучение предложений финансовых услуг (в том числе действующих правил и условий, тарифной политики и действующих форм документации)А/01.6</p>
<p>ПС 08.008 «Специалист по финансовому консультированию»</p>	<p>ПК-3.1 Способен осуществлять мониторинг процесса ценообразования на банковские, страховые и инвестиционные продукты и услуги</p>	<p><i>Знание:</i> ПС 08.008 Специалист по финансовому консультированию ИД-2ПК-3.1 Базовые банковские, страховые и инвестиционные продукты и услугиА/01.6 ИД-9 ПК-3.1 Система розничных финансовых услуг, применяемых при</p>

<p>А. Консультирование клиентов по использованию финансовых продуктов и услуг А/01.6 Мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков</p>		<p>управлении личными финансами домохозяйств (инвестиционные, кредитные, страховые, пенсионные), их качественные, количественные характеристики А/01.6 <i>Навыки и (или)опыт деятельности:</i> ИД-14 ПК-3.1 Сбор информации по спросу на рынке финансовых услуг А/01.6 ИД-18 ПК-3.1 Анализ состояния и прогнозирование изменений инвестиционного и информационного рынков А/01.6</p>
<p>ПС 08.008 «Специалист по финансовому консультированию» А. Консультирование клиентов по использованию финансовых продуктов и услуг А/01.6 Мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков</p>	<p>ПК-3.2 Способен проводить исследование финансовых рынков, на основании которого давать рекомендации их по усовершенствованию</p>	<p><i>Знание:</i> ПС 08.008 Специалист по финансовому консультированию ИД-1ПК-3.2 Конъюнктура и механизмы функционирования финансовых рынков А/01.6 ИД-7 ПК-3.2 Современная финансовая система и финансовый рынок, история развития финансовой системы и финансового рынка А/01.6 <i>Умения:</i> ИД-12ПК-3.2 Производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услугА/01.6 <i>Навыки и (или)опыт деятельности:</i> ИД-13ПК-3.2 Проведение исследования финансового рынка и изучение предложений финансовых услуг (в том числе действующих правил и условий, тарифной политики и действующих форм документации)А/01.6</p>

**1.2. Место дисциплины в структуре ОПОП ВО
направления подготовки «38.03.01 Экономика», направленность (профиль) «Финансы и кредит»**

№	Предшествующие дисциплины (дисциплины, изучаемые параллельно)	Последующие дисциплины
1	2	3
1.	Финансы	Финансовый менеджмент
2.	Управление финансами и бюджетирование	Экономика предприятия (организации)
3.	Финансовая политика	Комплексный экономический анализ хозяйственной деятельности
4.	Государственные и муниципальные финансы	Финансовый контроль
5.		Международные стандарты финансовой отчетности

Последовательность формирования компетенций в указанных дисциплинах может быть изменена в зависимости от формы и срока обучения, а также преподавания с использованием дистанционных технологий обучения.

1.3. Нормативная документация

Рабочая программа учебной дисциплины составлена на основе:

- Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки **«38.03.01 Экономика»**;
- Учебного плана направления подготовки **«38.03.01 Экономика» направленность (профиль) «Финансы и кредит»** 2024 года набора;
- Образца рабочей программы учебной дисциплины (приказ № 113-О от 01.09.2021 г.).

Раздел 2. Тематический план

Очная форма обучения (полный срок)

№	Тема дисциплины	Трудоемкость				Код индикатора и дескриптора достижения компетенций
		Всего	Аудиторные занятия		СРО	
			Л	ПЗ (ЛЗ, СЗ)		
1	2	3	4	5	6	7
1	Тема 1. Сущность ценных бумаг. Реквизиты ценных бумаг	3	1	2		ИД-13 ПК-3.2, ИД-12 ПК-3.2
2	Тема 2. Основные виды ценных бумаг	2			2	ИД-14 УК-10.2
3	Тема 3. Акции: понятие, характеристика, стоимостная оценка	3	1	2		ИД-6 ПК-1.1, ИД-4 УК-10.2
4	Тема 4. Облигации: понятие, характеристика, стоимостная оценка.	4	2	2		ИД-16 ПК-1.1, ИД-18 ПК-3.1
5	Тема 5. Вексель: понятие, классификация. Другие основные ценные бумаги.	4	2	2		ИД-6 ПК-3.1, ИД-11 УК-10.2, ИД-1 ПК-3.2
6	Тема 6. Государственные ценные бумаги. Производные ценные бумаги.	4	2		2	ИД-4 ПК-1.1,
7	Тема 7. Понятие рынка ценных бумаг. Участники рынка ценных бумаг. Регулирование рынка ценных бумаг	4	2	2		ИД-10 УК-10.2, ИД-13 ПК-3.2
8	Тема 8. Характеристика первичного рынка ценных бумаг. Эмиссия ценных бумаг	4	2	2		ИД-6 УК-10.2, ИД-1 ПК-1.1, ИД-3 ПК-1.1, ИД-12 ПК-3.2
9	Тема 9. Вторичный рынок ценных бумаг. Понятие портфеля ценных бумаг	4	2	2		ИД-1 УК-10.1, ИД-14 ПК-1.1, ИД-14 ПК-3.1
10	Тема 10. Перспективы развития рынка ценных бумаг.	4	2	2		ИД-1 УК-10.1, ИД-14 ПК-1.1, ИД-14 ПК-3.1
Вид промежуточной аттестации(Экзамен)		36				
Итого		72	16	16	4	

Очно-заочная форма обучения (полный срок обучения)

№	Тема дисциплины	Трудоемкость				Код индикатора и дескриптора достижения компетенций
		Всего	Аудиторные занятия		СРО	
			Л	ПЗ (ЛЗ, СЗ)		
1	2	3	4	5	6	7

1	Тема 1. Сущность ценных бумаг. Реквизиты ценных бумаг	4	2		2	ИД-13 ПК-3.2, ИД-12 ПК-3.2
2	Тема 2. Основные виды ценных бумаг	2			2	ИД-14 УК-10.2
3	Тема 3. Акции: понятие, характеристика, стоимостная оценка	4	2		2	ИД-6 ПК-1.1, ИД-4 УК-10.2
4	Тема 4. Облигации: понятие, характеристика, стоимостная оценка.	4		2	2	ИД-16 ПК-1.1, ИД-18 ПК-3.1
5	Тема 5. Вексель: понятие, классификация. Другие основные ценные бумаги.	4		2	2	ИД-6 ПК-3.1, ИД-11 УК-10.2 ИД-1 ПК-3.2
6	Тема 6. Государственные ценные бумаги. Производные ценные бумаги.	2			2	ИД-4 ПК-1.1,
7	Тема 7. Понятие рынка ценных бумаг. Участники рынка ценных бумаг. Регулирование рынка ценных бумаг	4		2	2	ИД-10 УК-10.2, ИД-13 ПК-3.2
8	Тема 8. Характеристика первичного рынка ценных бумаг. Эмиссия ценных бумаг	6	2	2	2	ИД-6 УК-10.2, ИД-1 ПК-1.1, ИД-3 ПК-1.1, ИД-12 ПК-3.2
9	Тема 9. Вторичный рынок ценных бумаг. Понятие портфеля ценных бумаг	2			2	ИД-1 УК-10.1, ИД-14 ПК-1.1, ИД-14 ПК-3.1
10	Тема 10. Перспективы развития рынка ценных бумаг.	4	2		2	ИД-1 УК-10.1, ИД-14 ПК-1.1, ИД-14 ПК-3.1
Вид промежуточной аттестации (Экзамен)		36				
Итого		72	8	8	20	

Очно-заочная форма обучения (ускоренное обучение, полное ускоренное обучение)

№	Тема дисциплины	Трудоемкость			СРО	Код индикатора и дескриптора достижения компетенций
		Всего	Аудиторные занятия			
			Л	ПЗ (ЛЗ, СЗ)		
1	2	3	4	5	6	7
1	Тема 1. Сущность ценных бумаг. Реквизиты ценных бумаг	4	2		2	ИД-13 ПК-3.2, ИД-12 ПК-3.2
2	Тема 2. Основные виды ценных бумаг	2			2	ИД-14 УК-10.2
3	Тема 3. Акции: понятие, характеристика, стоимостная оценка	4	2		2	ИД-6 ПК-1.1, ИД-4 УК-10.2

4	Тема 4. Облигации: понятие, характеристика, стоимостная оценка.	4		2	2	ИД-16 ПК-1.1, ИД-18 ПК-3.1
5	Тема 5. Вексель: понятие, классификация. Другие основные ценные бумаги.	4		2	2	ИД-6 ПК-3.1, ИД-11 УК-10.2 ИД-1 ПК-3.2
6	Тема 6. Государственные ценные бумаги. Производные ценные бумаги.	2			2	ИД-4 ПК-1.1,
7	Тема 7. Понятие рынка ценных бумаг. Участники рынка ценных бумаг. Регулирование рынка ценных бумаг	4		2	2	ИД-10 УК-10.2, ИД-13 ПК-3.2
8	Тема 8. Характеристика первичного рынка ценных бумаг. Эмиссия ценных бумаг	6	2	2	2	ИД-6 УК-10.2, ИД-1 ПК-1.1, ИД-3 ПК-1.1, ИД-12 ПК-3.2
9	Тема 9. Вторичный рынок ценных бумаг. Понятие портфеля ценных бумаг	2			2	ИД-1 УК-10.1, ИД-14 ПК-1.1, ИД-14 ПК-3.1
10	Тема 10. Перспективы развития рынка ценных бумаг.	4	2		2	ИД-1 УК-10.1, ИД-14 ПК-1.1, ИД-14 ПК-3.1
Вид промежуточной аттестации (Экзамен)		36				
Итого		72	8	8	20	

Заочная форма обучения (полный срок обучения)

№	Тема дисциплины	Трудоемкость				Код индикатора и дескриптора достижения компетенций
		Всего	Аудиторные занятия		СРО	
			Л	ПЗ (ЛЗ, СЗ)		
1	2	3	4	5	6	7
1	Тема 1. Сущность ценных бумаг. Реквизиты ценных бумаг	5			5	ИД-13 ПК-3.2, ИД-12 ПК-3.2
2	Тема 2. Основные виды ценных бумаг	5			5	ИД-14 УК-10.2
3	Тема 3. Акции: понятие, характеристика, стоимостная оценка	7	2		5	ИД-6 ПК-1.1, ИД-4 УК-10.2
4	Тема 4. Облигации: понятие, характеристика, стоимостная оценка.	7	2		5	ИД-16 ПК-1.1, ИД-18 ПК-3.1
5	Тема 5. Вексель: понятие, классификация. Другие основные ценные бумаги.	5			5	ИД-6 ПК-3.1, ИД-11 УК-10.2 ИД-1 ПК-3.2

6	Тема 6. Государственные ценные бумаги. Производные ценные бумаги.	6			6	ИД-4 ПК-1.1,
7	Тема 7. Понятие рынка ценных бумаг. Участники рынка ценных бумаг. Регулирование рынка ценных бумаг	6			6	ИД-10 УК-10.2, ИД-13 ПК-3.2
8	Тема 8. Характеристика первичного рынка ценных бумаг. Эмиссия ценных бумаг	10	2	2	6	ИД-6 УК-10.2, ИД-1 ПК-1.1, ИД-3 ПК-1.1, ИД-12 ПК-3.2
9	Тема 9. Вторичный рынок ценных бумаг. Понятие портфеля ценных бумаг	6			6	ИД-1 УК-10.1, ИД-14 ПК-1.1, ИД-14 ПК-3.1
10	Тема 10. Перспективы развития рынка ценных бумаг.	6			6	ИД-1 УК-10.1, ИД-14 ПК-1.1, ИД-14 ПК-3.1
Вид промежуточной аттестации (Экзамен)		9				
Итого		72	6	2	55	

Заочная форма обучения (ускоренный срок обучения, полное ускоренное обучение)

№	Тема дисциплины	Трудоемкость				Код индикатора и дескриптора достижения компетенций
		Всего	Аудиторные занятия		СРО	
			Л	ПЗ (ЛЗ, СЗ)		
1	2	3	4	5	6	7
1	Тема 1. Сущность ценных бумаг. Реквизиты ценных бумаг	6			6	ИД-13 ПК-3.2, ИД-12 ПК-3.2
2	Тема 2. Основные виды ценных бумаг	6			6	ИД-14 УК-10.2
3	Тема 3. Акции: понятие, характеристика, стоимостная оценка	8	2		6	ИД-6 ПК-1.1, ИД-4 УК-10.2
4	Тема 4. Облигации: понятие, характеристика, стоимостная оценка.	8	2		6	ИД-16 ПК-1.1, ИД-18 ПК-3.1
5	Тема 5. Вексель: понятие, классификация. Другие основные ценные бумаги.	6			6	ИД-6 ПК-3.1, ИД-11 УК-10.2 ИД-1 ПК-3.2
6	Тема 6. Государственные ценные бумаги. Производные ценные бумаги.	6			6	ИД-4 ПК-1.1,
7	Тема 7. Понятие рынка ценных бумаг. Участники рынка ценных бумаг. Регулирование рынка ценных бумаг	6			6	ИД-10 УК-10.2, ИД-13 ПК-3.2

8	Тема 8. Характеристика первичного рынка ценных бумаг. Эмиссия ценных бумаг	10	2	2	6	ИД-6 УК-10.2, ИД-1 ПК-1.1, ИД-3 ПК-1.1, ИД-12 ПК-3.2
9	Тема 9. Вторичный рынок ценных бумаг. Понятие портфеля ценных бумаг	6			6	ИД-1 УК-10.1, ИД-14 ПК-1.1, ИД-14 ПК-3.1
10	Тема 10. Перспективы развития рынка ценных бумаг.	6			6	ИД-1 УК-10.1, ИД-14 ПК-1.1, ИД-14 ПК-3.1
Вид промежуточной аттестации (Экзамен)		4				
Итого		72	6	2	60	

Раздел 3. Содержание дисциплины

3.1. Содержание дисциплины

Тема 1. Сущность ценных бумаг. Реквизиты ценных бумаг

Понятие ценных бумаг. Функции ценных бумаг. Характеристики ценных бумаг: временные, пространственные, рыночные. Классификация ценных бумаг: основные (первичные и вторичные); вторичные, производные ценные бумаги (фьючерсы, опционы). Понятие основных ценных бумаг: акция, облигации, вексель, чек, коносамент, варрант.

Понятие и виды экономических реквизитов. Форма существования ценных бумаг. Сроки существования ценных бумаг. Виды цены у ценной бумаги. Ценная бумага как совокупность прав.

Тема 2. Основные виды ценных бумаг.

Юридическое и экономическое понятие ценных бумаг. Основные виды ценных бумаг. Основные и производные ценных бумаг. Понятие первичных и вторичных ценных бумаг. Классификация ценных бумаг.

Тема 3. Акции: понятие, характеристика, стоимостная оценка

Сущность акции и права, которые она предоставляет. Виды акций. Стоимостная оценка акций. Номинальная, эмиссионная, рыночная (курсовая), книжная (балансовая) стоимость. Курс акций. Доходность акций. Факторы, определяющие доходность акций. Дивиденд. Ставка дивиденда. Дивидендный доход

Тема 4. Облигации: понятие, характеристика, стоимостная оценка.

Понятие облигации. Классификация облигаций. Стоимостная оценка облигаций: номинальная цена. Курс облигаций. Факторы, определяющие доходность облигаций. Купон. Доходность ценных бумаг.

Тема 5. Вексель: понятие, классификация. Другие основные ценные бумаги.

История возникновения. Вексель, понятие векселя, виды векселей. Расчет доходности банковских векселей. Банковский сертификат, чек, коносамент, складское свидетельство, закладная. Понятие ценных бумаг, классификации, реквизиты.

Тема 6. Государственные ценные бумаги. Производные ценные бумаги.

Задачи государственных ценных бумаг (ГЦБ). Виды ГЦБ. Доходность государственных краткосрочных бескупонных облигаций (по методике ЦБ РФ). Понятие и основные виды производных инструментов. Фьючерсные контракты: понятие, виды. Опционные контракты: понятие, классификация. Свопы

Тема 7. Понятие рынка ценных бумаг. Участники рынка ценных бумаг. Регулирование рынка ценных бумаг

Определение рынка ценных бумаг, его место в рыночном хозяйстве мира. Функции рынка ценных бумаг, его составные части. Фондовые брокеры и дилеры. Управляющие компании и их деятельность. Регистраторы. Депозитарии. Расчетно-клиринговые палаты. Коммерческие банки на рынке ценных бумаг.

Понятие и цели регулирования. Принципы регулирования. Государственное регулирование российского рынка ценных бумаг. Саморегулируемые организации рынка ценных бумаг.

Тема 8. Характеристика первичного рынка ценных бумаг. Эмиссия ценных бумаг

Первичный рынок ценных бумаг: задачи, субъекты, операции. Формы размещения ценных бумаг на первичном рынке (андеррайтинг). Понятие об эмиссии. Классификация эмиссии. Организация и порядок эмиссии ценных бумаг. Процедура эмиссии.

Тема 9. Вторичный рынок ценных бумаг. Понятие портфеля ценных бумаг

Вторичный рынок: цели, задачи, особенности вторичного российского рынка. Основные участники, операции вторичного рынка. Законодательные основы организации деятельности вторичного рынка. Проблемы развития вторичного рынка ценных бумаг в России. Траст и клиринг. Портфель ценных бумаг: виды, цели формирования, характер. Механизм формирования портфеля ценных бумаг. Стратегия управления портфелем ценных бумаг. Методы управления: диверсификация, индексный метод, сохранение портфеля.

Тема 10. Перспективы развития рынка ценных бумаг.

Российский рынок ценных бумаг. Фондовые биржи России. Тенденции развития современного мирового рынка ценных бумаг.

3.2. Содержание практического блока дисциплины

Очная форма обучения (полный срок)

№	Тема практического (семинарского, лабораторного) занятия
<i>1</i>	<i>2</i>
ПЗ 1	Тема 1. Сущность ценных бумаг. Реквизиты ценных бумаг
ПЗ 2	Тема 3. Акции: понятие, характеристика, стоимостная оценка
ПЗ 3	Тема 4. Облигации: понятие, характеристика, стоимостная оценка.
ПЗ 4	Тема 5. Вексель: понятие, классификация. Другие основные ценные бумаги.
ПЗ 5	Тема 7. Понятие рынка ценных бумаг. Участники рынка ценных бумаг. Регулирование рынка ценных бумаг
ПЗ 6	Тема 8. Характеристика первичного рынка ценных бумаг. Эмиссия ценных бумаг
ПЗ 7	Тема 9. Вторичный рынок ценных бумаг. Понятие портфеля ценных бумаг
ПЗ 8	Тема 10. Перспективы развития рынка ценных бумаг.

Очно-заочная форма обучения (полный срок, ускоренное обучение, полное ускоренное обучение)

№	Тема практического (семинарского, лабораторного) занятия
<i>1</i>	<i>2</i>
ПЗ 1	Тема 4. Облигации: понятие, характеристика, стоимостная оценка.
ПЗ 2	Тема 5. Вексель: понятие, классификация. Другие основные ценные бумаги.
ПЗ 3	Тема 7. Понятие рынка ценных бумаг. Участники рынка ценных бумаг. Регулирование рынка ценных бумаг
ПЗ 4	Тема 8. Характеристика первичного рынка ценных бумаг. Эмиссия ценных бумаг

Заочная форма обучения (полный срок, ускоренное обучения, полное ускоренное обучение)

№	Тема практического (семинарского, лабораторного) занятия
<i>1</i>	<i>2</i>
ПЗ 1	Тема 8. Характеристика первичного рынка ценных бумаг. Эмиссия ценных бумаг

3.3. Образовательные технологии

Очная форма обучения (полный срок)

№	Тема занятия	Вид учебного занятия	Форма / Методы интерактивного обучения	% учебного времени
<i>1</i>	<i>2</i>	<i>3</i>	<i>4</i>	<i>5</i>
1	Тема 1. Сущность ценных бумаг. Реквизиты ценных бумаг	Л	Лекция-дискуссия	100
2	Тема 3. Акции: понятие, характеристика, стоимостная оценка	Л	Лекция-дискуссия	100
3	Тема 4. Облигации: понятие, характеристика, стоимостная оценка.	Л	Лекция-дискуссия	100
4	Тема 5. Вексель: понятие, классификация. Другие основные ценные бумаги.	Л	Лекция-дискуссия	100
5	Тема 7. Понятие рынка ценных бумаг. Участники рынка ценных бумаг. Регулирование рынка ценных бумаг	Л	Лекция-дискуссия	100
Итого %				31,25%

Очно-заочная форма обучения (полный срок, ускоренное обучение, полное ускоренное обучение)

№	Тема занятия	Вид учебного занятия	Форма / Методы интерактивного обучения	% учебного времени
<i>1</i>	<i>2</i>	<i>3</i>	<i>4</i>	<i>5</i>
1	Тема 1. Сущность ценных бумаг. Реквизиты ценных бумаг	Л	Лекция-дискуссия	100
2	Тема 3. Акции: понятие, характеристика, стоимостная оценка	Л	Лекция-дискуссия	100
3	Тема 4. Облигации: понятие, характеристика, стоимостная оценка.	Л	Лекция-дискуссия	100
Итого				30%

Заочная форма обучения (полный срок, ускоренное обучение, полное ускоренное обучение)

№	Тема занятия	Вид учебного занятия	Форма / Методы интерактивного обучения	% учебного времени
<i>1</i>	<i>2</i>	<i>3</i>	<i>4</i>	<i>5</i>
1	Тема 3. Акции: понятие, характеристика, стоимостная оценка	Л	Лекция-дискуссия	100
2	Тема 4. Облигации: понятие, характеристика, стоимостная оценка.	Л	Лекция-дискуссия	100
Итого				28,27%

Раздел 4. Организация самостоятельной работы обучающихся

4.1. Организация самостоятельной работы обучающихся

№	Тема дисциплины	№ вопросов	№ рекомендуемой литературы
1	2	3	4
1	Тема 1. Сущность ценных бумаг. Реквизиты ценных бумаг	1-2	1-5
2	Тема 2. Основные виды ценных бумаг	3-4	1-5
3	Тема 3. Акции: понятие, характеристика, стоимостная оценка	5-7	1-5
4	Тема 4. Облигации: понятие, характеристика, стоимостная оценка.	8-9	1-5
5	Тема 5. Вексель: понятие, классификация. Другие основные ценные бумаги.	10-11	1-5
6	Тема 6. Государственные ценные бумаги. Производные ценные бумаги.	12-14	1-5
7	Тема 7. Понятие рынка ценных бумаг. Участники рынка ценных бумаг. Регулирование рынка ценных бумаг	15-16	1-5
8	Тема 8. Характеристика первичного рынка ценных бумаг. Эмиссия ценных бумаг	17-19	1-5
9	Тема 9. Вторичный рынок ценных бумаг. Понятие портфеля ценных бумаг	20-25	1-5
10	Тема 10. Перспективы развития рынка ценных бумаг.	26-31	1-5

Перечень вопросов, выносимых на самостоятельную работу обучающихся

1. Какие отношения охватывает рынок ценных бумаг?
2. Какие функции выполняет рынок ценных бумаг в рыночной экономике?
3. Что представляет собой инфраструктура рынка ценных бумаг?
4. Какие виды ценных бумаг представлены на российском фондовом рынке в настоящее время?
5. Какие секторы рынка ценных бумаг развиваются в России особенно динамично?
6. Назовите признаки ценных бумаг.
7. Назовите параметры ценных бумаг как специфического товара.
8. Какие виды ценных бумаг вы знаете?
9. Что включает в себя понятие эмиссионной ценной бумаги?
10. Определите сущность бездокументарной ценной бумаги.
11. Что такое первичный рынок ценных бумаг?
12. Каких участников первичного рынка ценных бумаг вы знаете?
13. Назовите особенности размещения ценных бумаг на первичном рынке ценных бумаг?
14. Каковы функции первичного рынка ценных бумаг?
15. История возникновения фондового рынка
16. История и необходимость создания ценных бумаг в России
17. Место рынка ценных бумаг в структуре финансового рынка
18. Основные направления развития отечественного рынка ценных бумаг

19. Особенности участников фондового рынка
20. Финансовые риски на рынке ценных бумаг
21. Уровень и перспективы развития рынка ценных бумаг в РФ
22. Макро- и микроэкономическая роль рынка ценных бумаг
23. Сущность и инвестиционные качества ценных бумаг
24. Схемы вексельного обращения и виды векселей
25. Чеки. Общие черты и отличия векселя от чека.
26. Ипотечные облигации: порядок эмиссии, обращения, передачи и погашения
27. Операции с ценными бумагами на внутреннем рынке
28. Процедура эмиссии ценных бумаг
29. Венчурные и хедж-фонды на рынке ценных бумаг
30. Условия допуска иностранных инвесторов на российский рынок ценных бумаг
31. Паевые инвестиционные фонды на рынке ценных бумаг

4.2. Перечень учебно-методического обеспечения самостоятельной работы обучающихся

Самостоятельная работа обучающихся обеспечивается следующими учебно-методическими материалами:

1. Указаниями в рабочей программе по дисциплине (п.4.1.)
2. Лекционные материалы в составе УМК по дисциплине
3. Заданиями и методическими рекомендациями по организации самостоятельной работы обучающихся в составе УМК по дисциплине.
4. Методическими рекомендациями по выполнению курсовой (расчетно-графической) работы (проекта) в составе учебно-методического комплекса по дисциплине.
5. Глоссарием по дисциплине в составе УМК.

Раздел 5. Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации обучающихся

Фонд оценочных средств по дисциплине представляет собой совокупность контролирующих материалов предназначенных для измерения уровня достижения обучающимися установленных результатов образовательной программы. ФОС по дисциплине используется при проведении оперативного контроля и промежуточной аттестации обучающихся. Требования к структуре и содержанию ФОС дисциплины регламентируются Положением о фонде оценочных материалов по программам высшего образования – программам бакалавриата, магистратуры.

5.1. Паспорт фонда оценочных средств

Очная форма обучения (полный срок)

№	Контролируемые разделы (темы) дисциплины	Оценочные средства			Код индикатора и дескриптора достижения компетенций
		Л	ПЗ (ЛЗ, СЗ)	СРО	
1	2	3	4	5	6
1	Тема 1. Сущность ценных бумаг. Реквизиты ценных бумаг	УО	АКС	ПРВ	ИД-13 ПК-3.2, ИД-12 ПК-3.2
2	Тема 2. Основные виды ценных бумаг			ПРВ	ИД-14 УК-10.2
3	Тема 3. Акции: понятие, характеристика, стоимостная оценка	ЛД	АКС	ПРВ	ИД-6 ПК-1.1, ИД-4 УК-10.2
4	Тема 4. Облигации: понятие, характеристика, стоимостная оценка.	ЛД	АКС	ПРВ	ИД-16 ПК-1.1, ИД-18 ПК-3.1
5	Тема 5. Вексель: понятие, классификация. Другие основные ценные бумаги.	ЛД	АКС	ПРВ	ИД-6 ПК-3.1, ИД-11 УК-10.2, ИД-1 ПК-3.2
6	Тема 6. Государственные ценные бумаги. Производные ценные бумаги.	УО	АКС	ПРВ	ИД-4 ПК-1.1,
7	Тема 7. Понятие рынка ценных бумаг. Участники рынка ценных бумаг. Регулирование рынка ценных бумаг	ЛД	АКС	ПРВ	ИД-10 УК-10.2, ИД-13 ПК-3.2
8	Тема 8. Характеристика первичного рынка ценных бумаг. Эмиссия ценных бумаг	ЛД	АКС	ПРВ	ИД-6 УК-10.2, ИД-1 ПК-1.1, ИД-3 ПК-1.1, ИД-12 ПК-3.2
9	Тема 9. Вторичный рынок ценных бумаг. Понятие портфеля ценных бумаг	УО	АКС	ПРВ	ИД-1 УК-10.1, ИД-14 ПК-1.1, ИД-14 ПК-3.1
10	Тема 10. Перспективы развития рынка ценных бумаг.	ЛД	АКС	ПРВ	ИД-1 УК-10.1, ИД-14 ПК-1.1, ИД-14 ПК-3.1

Очно-заочная форма обучения (полный срок, ускоренное обучение, полное ускоренное обучение)

№	Контролируемые разделы (темы) дисциплины	Оценочные средства			Код индикатора и дескриптора достижения компетенций
		Л	ПЗ (ЛЗ, СЗ)	СРО	

1	2	3	4	5	6
1	Тема 1. Сущность ценных бумаг. Реквизиты ценных бумаг	УО		ПРВ	ИД-13 ПК-3.2, ИД-12 ПК-3.2
2	Тема 2. Основные виды ценных бумаг			ПРВ	ИД-14 УК-10.2
3	Тема 3. Акции: понятие, характеристика, стоимостная оценка			ПРВ	ИД-6 ПК-1.1, ИД-4 УК-10.2
4	Тема 4. Облигации: понятие, характеристика, стоимостная оценка.		АКС	ПРВ	ИД-16 ПК-1.1, ИД-18 ПК-3.1
5	Тема 5. Вексель: понятие, классификация. Другие основные ценные бумаги.		АКС	ПРВ	ИД-6 ПК-3.1, ИД-11 УК-10.2 ИД-1 ПК-3.2
6	Тема 6. Государственные ценные бумаги. Производные ценные бумаги.			ПРВ	ИД-4 ПК-1.1,
7	Тема 7. Понятие рынка ценных бумаг. Участники рынка ценных бумаг. Регулирование рынка ценных бумаг		АКС	ПРВ	ИД-10 УК-10.2, ИД-13 ПК-3.2
8	Тема 8. Характеристика первичного рынка ценных бумаг. Эмиссия ценных бумаг	ЛД	АКС	ПРВ	ИД-6 УК-10.2, ИД-1 ПК-1.1, ИД-3 ПК-1.1, ИД-12 ПК-3.2
9	Тема 9. Вторичный рынок ценных бумаг. Понятие портфеля ценных бумаг			ПРВ	ИД-1 УК-10.1, ИД-14 ПК-1.1, ИД-14 ПК-3.1
10	Тема 10. Перспективы развития рынка ценных бумаг.	ЛД		ПРВ	ИД-1 УК-10.1, ИД-14 ПК-1.1, ИД-14 ПК-3.1

Заочная форма обучения (полный срок, ускоренное обучение, полное ускоренное обучение)

№	Контролируемые разделы (темы) дисциплины	Оценочные средства			Код индикатора и дескриптора достижения компетенций
		Л	ПЗ (ЛЗ, СЗ)	СРО	
1	2	3	4	5	6
1	Тема 1. Сущность ценных бумаг. Реквизиты ценных бумаг			ПРВ	ИД-13 ПК-3.2, ИД-12 ПК-3.2
2	Тема 2. Основные виды ценных бумаг			ПРВ	ИД-14 УК-10.2
3	Тема 3. Акции: понятие, характеристика, стоимостная оценка	ЛД		ПРВ	ИД-6 ПК-1.1, ИД-4 УК-10.2
4	Тема 4. Облигации: понятие, характеристика, стоимостная оценка.	ЛД		ПРВ	ИД-16 ПК-1.1, ИД-18 ПК-3.1
5	Тема 5. Вексель: понятие, классификация. Другие основные ценные бумаги.			ПРВ	ИД-6 ПК-3.1, ИД-11 УК-10.2 ИД-1 ПК-3.2
6	Тема 6. Государственные ценные бумаги. Производные ценные бумаги.			ПРВ	ИД-4 ПК-1.1,

7	Тема 7. Понятие рынка ценных бумаг. Участники рынка ценных бумаг. Регулирование рынка ценных бумаг			ПРВ	ИД-10 УК-10.2, ИД-13 ПК-3.2
8	Тема 8. Характеристика первичного рынка ценных бумаг. Эмиссия ценных бумаг	ЛД	АКС	ПРВ	ИД-6 УК-10.2, ИД-1 ПК-1.1, ИД-3 ПК-1.1, ИД-12 ПК-3.2
9	Тема 9. Вторичный рынок ценных бумаг. Понятие портфеля ценных бумаг			ПРВ	ИД-1 УК-10.1, ИД-14 ПК-1.1, ИД-14 ПК-3.1
10	Тема 10. Перспективы развития рынка ценных бумаг.			ПРВ	ИД-1 УК-10.1, ИД-14 ПК-1.1, ИД-14 ПК-3.1

Условные обозначения оценочных средств (Столбцы 3, 4, 5):

УО – Устный (фронтальный, индивидуальный, комбинированный) опрос;

ПРВ – Проверка рефератов, отчетов, рецензий, аннотаций, конспектов, графического материала, эссе, переводов, решений заданий, выполненных заданий в электронном виде и т.д.;

ЛД – Лекция-дискуссия;

АКС – Анализ конкретных ситуаций.

5.2. Оценочные средства текущего контроля Перечень практических (семинарских) заданий

Тема № 4: «Облигации: понятие, характеристика, стоимостная оценка»

Задание: Решить представленные ситуационные задачи

1. В данный момент текущая стоимость бескупонной облигации составляет 31250 руб. Облигация будет погашена через год. Годовая ставка дисконта составляет 12 %. Необходимо определить номинальную стоимость облигации.
2. У инвестора есть два варианта вложения свободных денежных средств:
Первый: купить 01.03.2021 года бескупонные облигации по цене 1900 руб. с номиналом 2000 руб. и датой погашения 01.09.2021 года.
Второй: вложить денежные средства на тот же период на банковский депозит под 10% годовых.
Необходимо определить, какой из вариантов вложения временно свободных денежных средств более выгоден для инвестора?
3. На рынке бескупонная облигация продается по цене 80%, до даты погашения 182 дня. Найти доходность к погашению.
4. Облигация номиналом 1000 руб. выпущена на 20 лет, купонная ставка 5%, выплачивается раз в год. Банковская % ставка 7%. Определить текущую стоимость.
5. Облигация номиналом 1000 руб. с купонной ставкой 10% приобретена в 60й день купонного периода, до срока погашения оставалось 2 года 305 дней. Определить текущую стоимость.

Тема № 5: «Вексель: понятие, классификация. Другие основные ценные бумаги»

Задание: Аргументированно ответить на вопросы

1. Дайте определение простого и переводного векселя.
2. Какие обязательные реквизиты должен содержать вексель, отсутствие каких из них не лишает его силы векселя?
3. Каким способом может быть задан срок оплаты векселя?
4. Что такое акцепт, к каким векселям применяется эта процедура?
5. Назовите виды индоссаментов, чем отличается поручительный индоссамент?
6. Что такое аваль и за кого он может быть дан?
7. Что нужно делать держателю векселя в случае отказа плательщика от оплаты?
8. Чем может быть оплачен вексель? Варианты ответов:
 1. Товарами.
 2. Деньгами.
 3. Услугами.
 4. Ценными бумагами.

Задание: Решить ситуационные задачи

9. Инвестор приобрел простой вексель за 90000 руб., а при его погашении получил 110000 руб. Необходимо определить относительную величину прибыли инвестора.
10. Вексель номинальной стоимостью 100.000 руб. обращается с начислением 30% на сумму долга. Условия выпуска предусматривают, что он будет погашен через 120 дней. Векселедержатель предъявил вексель для учета через 75 дней. Какую сумму получит векселедержатель, если учетная ставка банка 40%?
11. Вексель выписан на сумму 2000 руб. со сроком платежа 300 дней. Учетная ставка банка 14%. Какова цена размещения таких дисконтных векселей?
12. На какой срок может быть выдан переводной вексель, чтобы быть действительным?
 1. По предъявлении.
 2. Во столько-то времени от предъявления.
 3. Во столько-то времени от составления.
 4. На определенный день.
 5. На определенный месяц.

13. Вправе ли плательщик, производя акцепт, вносить изменения в содержание переводного векселя?

1. Плательщик вправе ограничить акцепт частью вексельной суммы, не внося других изменений в содержание векселя.

2. Плательщик может внести изменения в содержание векселя, не меняя суммы платежа.

3. Плательщик может ограничить акцепт частью вексельной суммы, а также вносить любые другие изменения в содержание векселя.

14. Организации предъявлено к оплате три простых векселя и один переводной. В первом, в графе "срок платежа" указано: к оплате 12.12.2019 г., во втором - по предъявлении, в третьем - в течение 10 дней от даты предъявления, в четвертом (переводном) срок оплаты не указан.

Во всех векселях содержится условие о начислении на вексельную сумму процентов по ставке 25% годовых. По какому векселю организация обязана выплатить проценты на вексельную сумму?

1. По первому векселю.

2. По второму векселю.

3. По третьему векселю.

4. По четвертому векселю.

5. По всем векселям.

15. На лицевой стороне переводного векселя имеется подпись плательщика. Основываясь на этом факте, держатель векселя настаивает на его оплате, однако плательщик отказывается оплатить вексель. Кто из них прав?

1. Прав плательщик.

2. Прав держатель векселя.

3. Оба не правы.

16. Какому из вариантов ответов соответствует термин "аллонж"?

1. Вексельное поручительство.

2. Выплата вексельной суммы через равные промежутки времени.

3. Специальный лист, являющийся дополнением к векселю.

Тема № 7: «Понятие рынка ценных бумаг. Участники рынка ценных бумаг. Регулирование рынка ценных бумаг»

Задание: Аргументированно ответить на вопросы

1. В чем заключается специфика ценной бумаги как объекта права?

2. Дайте определение ценной бумаги в соответствии с ГК РФ.

3. Какие виды ценных бумаг описаны в ГК РФ?

4. Какие характеристики ценных бумаг положены в основу их классификации?

5. Назовите способы передачи прав по именной и ордерной ценным бумагам, охарактеризуйте различия между ними.

6. Какие последствия влечет за собой несоблюдение установленной формы ценной бумаги?

7. Опишите основные различия между долговыми и долевыми ценными бумагами.

8. Кто является эмитентом ценных бумаг? Варианты ответов:

1. Кто работает с ценными бумагами.

2. Кто покупает ценные бумаги.

3. Кто выпускает ценные бумаги.

4. Кто ведет учет ценных бумаг.

9. Расположите ценные бумаги по степени риска, которые они несут для инвестора, от наименее рискованной к наиболее рискованной:

1. Акция.

2. Фьючерс.

3. Государственная облигация.

4. Корпоративная облигация.

5. Банковский сертификат.

10. Расположите ценные бумаги в порядке очередности выплат доходов по ним:

1. Привилегированная акция.
2. Облигация.
3. Обыкновенная акция.

11. *Каким образом осуществляется передача прав по ценной бумаге:*

- а) на предъявителя,
- б) именной,
- в) ордерной?

1. С помощью индоссамента.
2. Вручением.
3. Путем цессии.
4. Оформлением нотариально заверенного договора купли-продажи.
5. Вопрос поставлен некорректно.

12. *Инвестор (физическое лицо) заключил с коммерческим банком договор банковского вклада и при этом ему был выдан документ, являющийся ценной бумагой. Какую ценную бумагу получил клиент банка?*

1. Сберегательный сертификат.
2. Депозитный сертификат.
3. Именная сберегательная книжка.
4. Сберегательная книжка на предъявителя.
5. Кредитный договор.

13. *Какие из перечисленных ценных бумаг могут существовать в бездокументарной форме?*

1. Облигация.
2. Государственная облигация.
3. Вексель.
4. Акция.
5. Сертификат банка.

14. *К каким документам относится инвестиционный пай?*

1. К долговым обязательствам.
2. К корпоративным ценным бумагам.
3. К именованным ценным бумагам.
4. К документарным ценным бумагам.
5. К государственным ценным бумагам.

15. *Когда к приобретателю переходит право на именованную бездокументарную ценную бумагу:*

- а) в случае учета прав на ценные бумаги в депозитарии,
 - б) в случае учета прав на ценные бумаги в системе ведения реестра?
1. В момент передачи сертификата приобретателю.
 2. В момент осуществления приходной записи по счету депо приобретателя.
 3. С момента внесения приходной записи по лицевому счету приобретателя.
 4. С момента передачи приобретателю выписки из реестра владельцев ценных бумаг.

Тема № 8: «Характеристика первичного рынка ценных бумаг. Эмиссия ценных бумаг»

Задание: Решить ситуационные задачи

1. ПАО «Метелица» обещает выплачивать дивиденды (D) в размере 200 рублей на акцию в течение неопределенного периода при требуемой (желаемой инвестором) ставке $i = 10\%$. Текущий курс акции равен 1 750 (P) рублей. Есть ли смысл покупать акции фирмы (используйте формулу чистой приведенной стоимости в модели нулевого роста)?

2. ПАО «Метелица» обещает выплачивать дивиденды (D) в размере 200 рублей на акцию в течение неопределенного периода. Текущий курс акции равен 1 750 (P) рублей. Желаемая ставка доходности – 10%. Есть ли смысл покупать акции фирмы (используйте формулу внутренней ставки доходности в модели нулевого роста)?

3. ПАО «Калинушка» выплатила дивиденды в размере 200 рублей на одну акцию. Прогнозируется, что дивиденды по акциям фирмы будут расти на 5% каждый год. Желаемая ставка

доходности равна 10%. Текущий курс акции – 1 750 рублей. Требуется найти истинную стоимость акции и принять решение о покупке или продаже имеющихся акций.

4. Найти внутреннюю доходность акции ПАО «Калинушка» при условии, что выплата дивидендов составила 200 рублей на одну акцию. Прогнозируемый рост дивидендов по акциям фирмы составит ежегодно 5%. Желаемая ставка доходности равна 10%. Текущий курс акции – 1 750 рублей.

5. Номинальная стоимость бескупонной облигации $N_b = 1\,000$ рублей. Текущая рыночная стоимость – 695 рублей. Срок погашения – 4 года. Ставка депозита – 12%. Определите целесообразность приобретения облигации.

5.3. Тематика письменных работ обучающихся

Тематика рефератов, докладов, эссе:

6. Этапы развития ценных бумаг в России.
7. Классификация ценных бумаг.
8. Структура фондового рынка.
9. Виды профессиональной деятельности на фондовом рынке.
10. Функционирование фондовой биржи.
11. Выпуск ценных бумаг коммерческими банками.
12. Государственная концепция развития ценных бумаг в России.
13. Применение долговых ценных бумаг в системе расчетов предприятий.
14. Факторы макро и микро уровней влияющие на формирование цен на ценные бумаги
15. Залоговые аукционы в РФ в 90-е годы
16. Расчеты и характеристики стоимостных показателей векселей
17. Национальные особенности первичных рынков ценных бумаг развитых стран (США, Западная Европа, Япония)
18. Самофинансирование предприятий и рынок ценных бумаг: структура источников и количественные соотношения
19. Биржевые фондовые индексы: виды, характеристики, методика расчетов
20. Основы фундаментального и технического анализа на рынке ценных бумаг
21. Налоговое регулирование рынка ценных бумаг
22. Государственное регулирование и самоуправление рынка ценных бумаг в развитых странах (США, Западная Европа, Япония)

5.4. Перечень вопросов промежуточной аттестации по дисциплине

Вопросы к экзамену:

1. Рынок ценных бумаг, как альтернативный источник финансирования экономики.
2. Понятие ценной бумаги, этапы развития ЦБ в России.
3. Классические виды государственных ценных бумаг и их характеристика (акции, облигации, векселя, сертификаты).
4. Основные виды государственных ценных бумаг.
5. Производные ценные бумаги и их характеристика.
6. Международные ценные бумаги (евроноты, еврооблигации, евроакции).
7. Рынок ценных бумаг, его структура (западная модель).
8. Первичный рынок ЦБ. Его характеристика. 9. Методы размещения ценных бумаг.
10. Участники рынка ценных бумаг.
11. Виды профессиональной деятельности на РЦБ.
12. Профессиональные участники РЦБ.
13. Вторичный рынок ценных бумаг.
14. Экономическое назначение и функции биржи.
15. Организация, структура и функции фондовой биржи.

16. Основные операции и сделки на бирже.
17. Биржевая информация (биржевые индексы и их характеристика).
18. Этика на фондовой бирже.
19. Дайте определение листинга как важного мероприятия деятельности фондовой биржи.
20. «Уличный» рынок ценных бумаг и характеристика его деятельности.
21. Фьючерсные операции на бирже.
22. Участники вторичного рынка.
23. Опцион. Типы опционов. Стили опционов.
24. Брокерские компании.
25. Брокер. Дилер. Инвестиционный консультант.
26. Эмиссия ценных бумаг.
27. Депозитарно-регистрационный механизм РЦБ.
28. Система госрегулирования РЦБ, органы госнадзора, законодательно-правовая база регулирования РЦБ.
29. Акции. Виды акций. Свойства акций.
30. Облигации. Характеристика, свойства, отличия от акций.
31. Вексель. Классификация векселей.
32. Инвестиционная деятельность кредитно-финансовых институтов на РЦБ – банков, страховых компаний, фондов и пр.
33. Опционы и фьючеры как производные ценных бумаг.
34. Система управления рынком ценных бумаг.
35. Система налогообложения различных видов ценных бумаг и доходов по ним.
36. Законодательно-правовая база регулирования ценных бумаг.
37. Процедура размещения ценных бумаг (Андеррайтинг).
38. Анализ доходности различных операций на фондовом рынке: процентный и дисконтный доход.
39. Доходность с учетом налогообложения.
40. Понятие инвестиционного риска. Виды рисков.
41. Виды и методики прогнозирования развития фондового рынка.
42. Международный рынок ценных бумаг: Еврорынок.
43. Эффективная доходность. Формула сложных процентов.
44. Формула сложных процентов для определения будущих доходов от вклада внутри года.
45. Формула сравнительного анализа эффективности различных финансовых инструментов.
46. Механизм принятия решений на РЦБ (Фундаментальный и технический анализ).
47. Порядок эмиссии ценных бумаг в РФ
48. Структура современного рынка ценных бумаг (западная и российская практика)
49. Особенности развития рынка ценных бумаг в РФ в 90-е годы. Дефолт 1998г.
50. Кризис фондовых рынков 2007-2008-2009гг.
51. Рынок облигаций (западная и российская практика)
52. Интернет-трейдинг: понятие, порядок осуществления
53. Сущность и развитие IPO в РФ
54. Вторичный рынок ценных бумаг (фондовая биржа) – структура и операции (западная модель)
55. Расчеты и характеристики стоимостных показателей облигаций
56. Инвестиционная политика банков на рынке ценных бумаг
57. Финансовые инструменты на рынке ценных бумаг: виды, особенности, операции

Раздел 6. Перечень учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

6.1. Основная литература

1. Коришева, О. В. Рынок ценных бумаг : учебно-методическое пособие / О. В. Коришева. — Москва : Российский университет транспорта (МИИТ), 2020. — 95 с. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/115890.html>
2. Газалиев, М. М. Рынок ценных бумаг : учебное пособие для бакалавров / М. М. Газалиев, В. А. Осипов. — 2-е изд. — Москва : Дашков и К, 2020. — 160 с. — ISBN 978-5-394-03548-7. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/110961.html>
3. Николаева, И. П. Рынок ценных бумаг : учебник для бакалавров / И. П. Николаева. — 2-е изд. — Москва : Дашков и К, 2020. — 255 с. — ISBN 978-5-394-03586-9. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/110960.html>

6.2. Дополнительная литература

4. Дж., Фабоцци Рынок облигаций: анализ и стратегии / Фрэнк Фабоцци Дж. ; перевод А. Левинзон ; под редакцией А. Дзюра, Е. Дроновой. — 2-е изд. — Москва : Альпина Паблишер, 2020. — 949 с. — ISBN 5-9614-0468-4. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/93059.html>
5. Елфимова, И. Ф. Рынок ценных бумаг : лабораторный практикум / И. Ф. Елфимова, Э. Б. Лубянская. — Воронеж : Воронежский государственный технический университет, ЭБС АСВ, 2020. — 117 с. — ISBN 978-5-7731-0903-7. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/111486.html>

6.3. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

1. <http://www.economy.gov.ru> – Министерство экономического развития Российской Федерации.
2. <http://www.csr.ru>– Центр стратегических разработок.
3. <http://www.hse.ru>– Национальный исследовательский университет Высшая школа экономики.
4. <http://gallery.economicus.ru>– Галерея экономистов.
5. <http://www.ecsocman.edu.ru>– Федеральный образовательный портал – ЭКОНОМИКА, СОЦИОЛОГИЯ, МЕНЕДЖМЕНТ – учебные материалы.
6. <http://gks.ru>– Федеральная служба государственной статистики.
7. Справочно-правовая система «Консультант Плюс»
8. Справочно-правовая система «Гарант»
9. ПО для организации конференций

Раздел 7. Материально-техническая база и информационные технологии

Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине:

Материально-техническое обеспечение дисциплины «Рынок ценных бумаг» включает в себя учебные аудитории для проведения занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, самостоятельной работы обучающихся.

Учебные аудитории укомплектованы специализированной мебелью и техническими средствами обучения. Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети Интернет.

Дисциплина может реализовываться с применением дистанционных технологий обучения. Специфика реализации дисциплины с применением дистанционных технологий обучения устанавливается дополнением к рабочей программе. В части не противоречащей специфике, изложенной в дополнении к программе, применяется настоящая рабочая программа.

Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине с применением дистанционных образовательных технологий включает в себя:

Компьютерная техника, расположенная в учебном корпусе Института (ул.Качинцев, 63, кабинет Центра дистанционного обучения):

1. Intel i 3 3.4Ghz\ОЗУ 4Gb\500GB\RadeonHD5450
2. Intel PENTIUM 2.9GHz\ОЗУ 4GB\500GB

Зличные электронные устройства (компьютеры, ноутбуки, планшеты и иное), а также средства связи преподавателей и студентов.

Информационные технологии, необходимые для осуществления образовательного процесса по дисциплине с применением дистанционных образовательных технологий включают в себя:

- система дистанционного обучения (СДО) (Learning Management System) (LMS) Moodle (Modular Object-Oriented Dynamic Learning Environment);
- электронная почта;
- система компьютерного тестирования;
- Цифровой образовательный ресурс IPR SMART;
- система интернет-связи skype;
- телефонная связь;
- программное обеспечение для организации конференции.

Обучение обучающихся инвалидов и обучающихся с ограниченными возможностями здоровья осуществляется посредством применения специальных технических средств в зависимости от вида нозологии.

При проведении учебных занятий по дисциплине используются мультимедийные комплексы, электронные учебники и учебные пособия, адаптированные к ограничениям здоровья обучающихся.

Лекционные аудитории оборудованы мультимедийными кафедрами, подключенными к звуковым колонкам, позволяющими усилить звук для категории слабослышащих обучающихся, а также проекционными экранами которые увеличивают изображение в несколько раз и позволяют воспринимать учебную информацию обучающимся с нарушениями зрения.

При обучении лиц с нарушениями слуха используется усилитель слуха для слабослышащих людей CyberEar модель NAP-40, помогающий обучаемым лучше воспринимать учебную информацию.

Обучающиеся с ограниченными возможностями здоровья, обеспечены печатными и электронными образовательными ресурсами (программы, учебники, учебные пособия, материалы для самостоятельной работы и т.д.) в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

для лиц с нарушениями зрения:

- в форме электронного документа;
- в форме аудиофайла;

для лиц с нарушениями слуха:

- в печатной форме;
 - в форме электронного документа;
- для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:**
- в печатной форме;
 - в форме электронного документа;
 - в форме аудиофайла.

Раздел 8. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Для успешного усвоения лекционного материала обучающийся должен просмотреть учебную литературу по теме лекции с тем, чтобы иметь хотя бы представление о проблемах, которые будут разбираться в лекции. Он должен также мысленно припомнить то, что уже знает, когда-то читал, изучал по другим предметам применительно к данной теме. Главное в проделанной работе к лекции – формирование субъективного настроения на характер информации, которую он получит в лекции по соответствующей теме. Иногда для этого бывает достаточно ознакомиться с типовой рабочей программой или учебным руководством.

Проблемная лекция не только раскрывает пункты, проблемы, темы, которые находятся в программе, но и заставляет обучающего мыслить экономически грамотно, искать новые пути и средства решения наиболее сложных проблем. Она обладает большой информационной емкостью, и за короткое время преподаватель успевает изложить так много проблем, мыслей, идей, что надо не потеряться в этой информации. Обучающийся должен помнить, что никакой учебник, никакая монография или статья не могут заменить учебную лекцию. В свою очередь, работа на лекции – это сложный вид познавательной, интеллектуальной работы, требующей напряжения, внимания, воли, затрат нервной и физической энергии. Весь проблемный материал, сообщаемый преподавателем, должен не просто прослушиваться. Он должен быть активно воспринят, т.е. услышан, осмыслен, понят, зафиксирован на бумаге и закреплен в памяти. Приступая к слушанию нового материала, полезно мысленно установить его связь с ранее изученным, уяснить, на что опирается изложенная тема. Следя за техникой чтения лекции (акцент на существенном повышении тона, изменения ритма, пауза и т.п.), обучающийся должен вслед за преподавателем уметь выделять основные категории, законы и их содержание, проблемы и их возможные решения, доказательства и выводы. Осуществляя такую работу, обучающийся значительно облегчает себе глубокое понимание материала, его конспектирование и дальнейшее изучение.

Запись лекции является важнейшим элементом работы обучающегося на лекции. Конспект позволяет ему обработать, систематизировать и лучше сохранить полученную информацию с тем, чтобы в будущем он смог восстановить в памяти основные содержательные моменты лекции.

Типичная ошибка обучающихся – дословное конспектирование. Как правило, при записи слово в слово не остается времени на обдумывание, анализ и синтез информации. Искусство конспектирования сводится к навыкам свертывания информации, т.е. записи ее своими словами, частично словосочетаниями лектора, определенными и просто необходимыми сокращениями и иными приемами, но так, чтобы суметь вновь развернуть информацию без существенной потери. Отбирая нужную информацию, главные мысли, проблемы, решения и выводы, обучающейся сокращает текст и строит свой, в котором он сможет разобраться.

При ведении конспекта лекций есть материал, который записывается дословно, например, формулировки нормативных актов, определения основных криминологических категорий и законов. При этом обучающийся должен для себя в конспекте выделить главную мысль, идею в определении того или иного понятия, его сущность, не стараясь сразу понять его в деталях. Это позволит изначально усвоить экономические понятия, опираясь на главную идею, уяснить сущность.

В конспекте лекций обязательно записываются: название темы лекции, основные вопросы плана, рекомендуемая литература. Текст лекции должен быть разделен в соответствии с планом.

С окончанием лекции работа над конспектом может считаться завершенной. Нужно еще восстановить отдельные места, проверить, все ли понятно, уточнить что-то на консультации, предпринять иные меры с тем, чтобы конспект мог быть использован в процессе подготовки к семинарам, экзамену, для дальнейшего изучения темы, на практике. Конспект лекций – незаменимый учебный документ, необходимый для самостоятельной работы.

Тематическим планом изучения дисциплины предусмотрены практические занятия. Подготовка к практическому занятию предполагает два этапа работы обучающихся.

Первый этап – усвоение теоретического материала. На первом этапе обучающийся должен отработать и усвоить учебно-программный вузовский материал, используя методические рекомендации по подготовке к семинару.

Второй этап предполагает выполнение практического задания. Конкретно такое задание дается обучающемуся преподавателем в конце занятия, предшествующего практическому. Это может быть подготовка конспекта, план работы по той или иной ситуации, план беседы и т.п.

Задания должны быть выполнены письменно. Кроме того, по теоретическим вопросам обучающийся должен подготовить рабочие планы своих ответов на них.

Домашнее задание обучающийся готовит самостоятельно, уделяя на подготовку не менее трех часов. При выполнении домашнего задания он может пользоваться техническими средствами, учебной литературой, конспектами лекций и др. Рекомендуется чаще обращаться за консультациями и оказанием необходимой помощи к преподавателям кафедры.

Учебно-методическое издание

Рабочая программа учебной дисциплины

Рынок ценных бумаг

*(Наименование дисциплины в соответствии с учебным
планом)*

Чернявская Екатерина Юрьевна

(Фамилия, Имя, Отчество составителя)