

год начала подготовки 2017

АНО ВО «Российский новый университет»

**Елецкий филиал Автономной некоммерческой организации высшего
образования «Российский новый университет»
(Елецкий филиал АНО ВО «Российский новый университет»)**

кафедра информационных технологий в экономике и бизнесе

Рабочая программа учебной дисциплины (модуля)

Рынок ценных бумаг

(наименование учебной дисциплины (модуля))

38.03.01 Экономика

(код и направление подготовки/специальности)

Финансы и кредит

(код и направление подготовки/специальности, в случаях, если программа разработана для разных направлений подготовки/специальностей)

Рабочая программа учебной дисциплины (модуля) рассмотрена и утверждена на заседании кафедры «25» января 2017, протокол № 5.

Заведующий кафедрой Прикладной экономики и сферы обслуживания
(название кафедры)

к.п.н., доцент Гнездилова О.Н.

(ученая степень, ученое звание, фамилия и инициалы, подпись заведующего кафедрой)

Елец
2017 год

1. НАИМЕНОВАНИЕ И ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Целями освоения дисциплины «Рынок ценных бумаг» является:

Образовательные цели освоения дисциплины:

Обеспечение профессионального образования, способствующего социальной, академической мобильности, востребованности на рынке труда, успешной карьере, сотрудуничеству.

Профессиональные цели освоения дисциплины:

Формирование у студентов систематизированных профессионально значимых знаний по организации и структуре рынка ценных бумаг, классификации ценных бумаг и механизма их функционирования и профессиональных умений и навыков, необходимых экономисту.

Задачи дисциплины

Сформировать у студентов комплекс современных знаний в области теории управления ценными бумагами, финансами, управления активами, информационного обеспечения и применение практики управления ценными бумагами в современных рыночных условиях, а также профессиональную ориентацию студентов при выборе специализации.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОП БАКАЛАВРИАТА

Учебная дисциплина «Рынок ценных бумаг» относится к базовой (вариативной) части учебного плана (Б1.В.07).

Содержание учебной дисциплины тесно связано с логикой и содержанием других изучаемых дисциплин:

Учебная дисциплина содержательно и логически связана с другими учебными дисциплинами, изучаемыми студентами:

- предшествует освоению данной дисциплины: Финансовые рынки и институты
- после изучения данной дисциплины изучается: Финансовая политика компании.

Дисциплина изучается на заочной форме обучения на 4 курсе в 7,8 семестре.

3. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ, СООТНЕСЕННЫЕ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОП

В результате освоения дисциплины обучающийся должен овладеть следующими компетенциями:

ПК-21 – Способность составлять финансовые планы организации, обеспечивать осуществление финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления

Планируемые результаты освоения компетенций

| Компетенция | Показатели (планируемые) результаты обучения |
|---|--|
| ПК-21 Способность составлять финансовые планы организации, обеспечивать осуществление финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления | Владеть: - методами и средствами самостоятельного, методически обоснованного составления финансового плана организации В1(ПК-21) - навыками обеспечения финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления В2(ПК-21) - навыками выбора наиболее удобных в конкретной хозяйственной ситуации форм заимствования и оценивания кредитных рисков при осуществлении финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления В3(ПК-21) -основными законодательными и нормативными актами в области |

| | |
|--|--|
| | <p>ценообразования при осуществлении финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления В4(ПК-21)</p> <p>-подходами к проектированию организации с учетом складывающихся условий финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления В5(ПК-21)</p> <p>-навыками самостоятельного овладения новыми знаниями по проблемам экономической истории России В6(ПК-21)</p> <p>- навыками соблюдения этических норм при составлении финансовых планов организации, обеспечении осуществления финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления; В7(ПК-21)</p> <p>- навыками оценки производственного и финансового риска при составлении финансовых планов организации, обеспечении осуществления финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления В8(ПК-21)</p> |
| | <p style="text-align: center;">Уметь:</p> <p>- использовать средства финансового планирования при составлении финансовых планов организации У1(ПК-21)</p> <p>- применять систему категорий и методов, направленных на формирование работы по финансовому планированию организации при обеспечении взаимоотношений с органами местного самоуправления У2(ПК-21)</p> <p>-понимать закономерности финансового планирования организации У3(ПК-21)</p> <p>-понимать структуру государственной власти и органов местного самоуправления У4(ПК-21)</p> <p>- понимать сущность финансовых взаимоотношений организаций, органов местного самоуправления и государственной власти У5(ПК-21)</p> <p>-понимать структуру финансовых планов организации У6(ПК-21)</p> <p>- применять принципы соблюдения этических норм при составлении финансовых планов организации, обеспечении осуществления финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления; У7(ПК-21)</p> <p>- использовать основы оценки производственного и финансового риска при составлении финансовых планов организации, обеспечении осуществления финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления У8(ПК-21)</p> |
| | <p style="text-align: center;">Знать:</p> <p>- виды, пути и средства финансового планирования организации З1(ПК-21)</p> <p>- систему категорий и методов, направленных на формирование работы по финансовому планированию организации при обеспечении взаимоотношений с органами местного самоуправления З2(ПК-21)</p> <p>-закономерности финансового планирования организации З3(ПК-21)</p> <p>-структуру государственной власти и органов местного самоуправления З4(ПК-21)</p> <p>- сущность финансовых взаимоотношений органов местного самоуправления и государственной власти З5(ПК-21)</p> <p>-структуру финансовых планов организации З6(ПК-21)</p> <p>- принципы соблюдения этических норм при составлении финансовых планов организации, обеспечении осуществления финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления; З7(ПК-21)</p> <p>- основы оценки производственного и финансового риска при составлении финансовых планов организации, обеспечении осуществления финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления З8(ПК-21)</p> |

| | |
|--|--|
| | |
|--|--|

**4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) В ЗАЧЕТНЫХ ЕДИНИЦАХ С
УКАЗАНИЕМ КОЛИЧЕСТВА АКАДЕМИЧЕСКИХ ЧАСОВ, ВЫДЕЛЕННЫХ НА
КОНТАКТНУЮ РАБОТУ ОБУЧАЮЩИХСЯ С ПРЕПОДАВАТЕЛЕМ (ПО ВИДАМ
УЧЕБНЫХ ЗАНЯТИЙ) И НА САМОСТОЯТЕЛЬНУЮ РАБОТУ ОБУЧАЮЩИХСЯ**

Дисциплина предполагает изучение 3 раздела, 10 тем. Общая трудоемкость дисциплины составляет 5 зачетных единиц (180 часов).

Общий объем учебной дисциплины

| № | Форма обучения | Семестр/ сессия, курс | Общая трудоемкость | | в том числе контактная работа с преподавателем | | | | | | СР | Контроль | |
|---------------|----------------|-----------------------------|--------------------|------------|--|----------|----------|------------|-------|----------|------------|--------------|------------|
| | | | в з.е. | в часах | Всего | Л | ПР | КоР | зачет | Конс | | | экзамен |
| | Заочная | 2 сессия, 3 курс | 1 | 36 | 4 | 4 | | | | | | 32 | |
| | | 1 сессия, 4 курс | 3 | 144 | 12 | | 8 | 1,6 | | 2 | 0,4 | 125,4 | 6,6 |
| Итого: | | | 4 | 180 | 16 | 4 | 8 | 1,6 | | 2 | 0,4 | 157,4 | 6,6 |

**Распределение учебного времени по темам и видам учебных занятий
заочная форма**

| № | Наименование разделов, тем учебных занятий | Все го часов | Контактная работа с преподавателем | | | | | | СР | Конт роль | Результаты обучения | |
|--|--|--------------|------------------------------------|---|----|-----|--------|------|----|-----------|---------------------|-------------------------------------|
| | | | Все го | Л | ПР | КоР | зач ет | Конс | | | | экза мен |
| Раздел 1. Фондовый рынок | | | | | | | | | | | | |
| 1 | Организация рынка ценных бумаг. | 17 | 2 | 1 | 1 | | | | | 15 | | B1(ПК-21) У1(ПК-21) 31(ПК-21) |
| 2 | Структура рынка ценных бумаг. | 17 | 2 | 1 | 1 | | | | | 15 | | B2(ПК-21) У2(ПК-21) 32(ПК-21) |
| Раздел 2. Участники фондового рынка | | | | | | | | | | | | |
| 3 | Профессиональные участники рынка ценных бумаг. | 17 | 2 | 1 | 1 | | | | | 15 | | B3(ПК-21) У3(ПК-21) 33(ПК-21) |
| 4 | Виды и классификация ценных бумаг. | 17 | 2 | 1 | 1 | | | | | 15 | | B4(ПК-21) У4(ПК-21) 34(ПК-21) |
| Раздел 3. Виды ценных бумаг | | | | | | | | | | | | |
| 5 | Облигации. | 16 | 1 | | 1 | | | | | 15 | | B5(ПК-21) У5(ПК-21) 35(ПК-21) |
| 6 | Акции | 16 | 1 | | 1 | | | | | 15 | | B1(ПК-21) У1(ПК-21) |

| | | | | | | | | | | | | |
|----|---|------|----|---|---|-----|--|---|-----|-------|-----|-------------------------------------|
| | | | | | | | | | | | | 31(ПК-21) |
| 7 | Конвертируемые ценные бумаги. | 16 | 1 | | 1 | | | | | 15 | | B2(ПК-21) У2(ПК-21) 32(ПК-21) |
| 8 | Права, варранты, депозитарные расписки. | 16 | 1 | | 1 | | | | | 15 | | B3(ПК-21) У3(ПК-21) 33(ПК-21) |
| 9 | Государственные ценные бумаги. | 15 | | | | | | | | 15 | | B4(ПК-21) У4(ПК-21) 34(ПК-21) |
| 10 | Муниципальные ценные бумаги. | 22,4 | | | | | | | | 22,4 | | B5(ПК-21) У5(ПК-21) 35(ПК-21) |
| 11 | Промежуточная аттестация (экзамен) | 10,6 | 4 | | | 1,6 | | 2 | 0,4 | | 6,6 | |
| | ИТОГО | 180 | 16 | 4 | 8 | 1,6 | | 2 | 0,4 | 157,4 | 6,6 | |

5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ, СТРУКТУРИРОВАННОЕ ПО ТЕМАМ

| № п/п | Наименование раздела, темы учебной дисциплины | Содержание раздела, темы |
|-------|--|---|
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | Организация рынка ценных бумаг. | <p>Рынок ценных бумаг как альтернативный источник финансирования экономики. Понятие ценной бумаги. История появления ценных бумаг. Понятие финансового и фондового рынков. Секьюритизация и глобализация финансовых рынков. Финансовые потоки в экономике. Классификация финансовых рынков. Влияние азиатского кризиса и дефолта на российский рынок ценных бумаг.</p> <p>Литература: Обязательная: 1-7. Дополнительная: 1-2.</p> |
| 2 | Структура рынка ценных бумаг. | <p>Структура рынка ценных бумаг и его основные тенденции развития. Профессиональные участники рынка. Основные операции на рынке. Эмиссия ценных бумаг. Депозитарно - регистрационный механизм рынка ценных бумаг. Система государственного регулирования рынка ценных бумаг: органы государственного надзора, законодательно-правовая база регулирования, национальные особенности регулирования рынка.</p> <p>Литература: Обязательная: 1-7. Дополнительная: 1-2.</p> |
| 3 | Профессиональные участники рынка ценных бумаг. | <p>Организационная структура и функции фондовой биржи. Профессиональные участники биржи. Основные операции и сделки на бирже. Биржевая информация (биржевые индексы и их характеристика). Этика на фондовой бирже. Биржевые крахи и потрясения. «Уличный» рынок ценных бумаг и характеристика его деятельности. Участники вторичного рынка. Брокерские компании (организация, функции, механизм операций). Торговая регистрация, сопоставление и расчетный процесс. Механизм принятия решений на рынке ценных бумаг (фундаментальный и технический анализ).</p> <p>Литература:</p> |

| | | |
|---|---|---|
| | | Обязательная: 1-7. Дополнительная: 1-2. |
| 4 | Виды и классификация ценных бумаг. | Понятие и фундаментальные свойства ценных бумаг. Классификация ценных бумаг по видам, эмитентам, форме выпуска, способу получения дохода, сроку обращения и т.д. Классические виды ценных бумаг и их характеристика (акции, частные облигации, государственные ценные бумаги). Производные ценные бумаги и их характеристика (конвертируемые акции и облигации, варранты, опционы и фьючерсы). Финансовые инструменты на рынке ценных бумаг (векселя, депозитные, сберегательные, инвестиционные сертификаты, секьюритизация частных долгов). Международные ценные бумаги (евроноты, еврооблигации, евроакции). Литература: Обязательная: 1-7. Дополнительная: 1-2. |
| 5 | Облигации. | Понятие облигации и её основные характеристики. Классификация облигаций: обеспеченные и не обеспеченные, купонные и дисконтные, обычные и конвертируемые. Индексируемые облигации. Рынок еврооблигаций. Модель ценообразования облигаций. Факторы, влияющие на цену облигации. Досрочное погашение облигаций. Риск процентных ставок. Рейтинг облигаций Литература: Обязательная: 1-7. Дополнительная: 1-2. |
| 6 | Акции | Акция как долевая ценная бумага, ее свойства. Виды и классификация акций. Объявленные и размещенные акции. Акционерный капитал. Дробление и консолидация акций. Порядок выпуска и обращения акций в закрытом и открытом АО. Привилегированные акции, их виды и разновидности. Кумулятивные привилегированные акции. Права владельцев привилегированных акций, условия их участия в собрании акционеров. Конвертация и выкуп привилегированных акций. Обыкновенные акции, их свойства. Права владельцев обыкновенных акций. Приобретение и выкуп акций. Оценка акций. Доходность акций Литература: Обязательная: 1-7. Дополнительная: 1-2. |
| 7 | Конвертируемые ценные бумаги. | Сущность конвертируемых облигаций, их преимущества и достоинства. Модель конвертации облигаций. Особенности ценообразования конвертируемых облигаций. Цена конвертации и конвертационная стоимость. Методы стимулирования более ранней конвертации. Последствия конвертации для инвесторов и эмитентов Литература: Обязательная: 1-7. Дополнительная: 1-2. |
| 8 | Права, варранты, депозитарные расписки. | Преимущественные права. Порядок реализации прав владельцами обыкновенных акций. Модель ценообразования на преимущественные права. Варранты. Выпуск и обращение варрантов. Операции с варрантами. Депозитарные расписки ADR и GDR. Виды ADR. Организация выпуска депозитарных расписок. Обращение депозитарных расписок на фондовых рынках Литература: Обязательная: 1-7. Дополнительная: 1-2. |
| 9 | Государственные ценные бумаги. | Цели и задачи эмиссии государственных ценных бумаг (ГЦБ). Российские ГЦБ. Государственные бескупонные облигации (ГКО): порядок выпуска и обращения. Проведение аукционов по размещению ГКО, конкурентное и неконкурентное предложение. Цена отсечения и средневзвешенная цена. Определение доходности по ГКО. Облигации федерального и |

| | | |
|----|------------------------------|--|
| | | <p>сберегательного займов (ОФЗ и ОСЗ). Цели их выпуска. Порядок расчета купонного дохода. Облигации внутреннего государственного валютного займа, порядок выпуска и обращения.</p> <p>Литература: Обязательная: 1-7. Дополнительная: 1-2.</p> |
| 10 | Муниципальные ценные бумаги. | <p>Облигации субъектов Российской Федерации: способы заимствований местных и региональных администраций. Бюджеты регионов и объемы эмиссии региональных бумаг. Размещение региональных облигаций на фондовом рынке. Место долговых обязательств субъектов РФ на российском рынке ценных бумаг. Рейтинг регионов: параметры оценки инвестиционной привлекательности регионов.</p> <p>Литература: Обязательная: 1-7. Дополнительная: 1-2.</p> |

Планы практических занятий

Тема 1. Организация рынка ценных бумаг.

1. Понятие финансового и фондового рынков.
2. Классификация финансовых рынков.
3. Развитие фондового рынка в России.

Тема 2. Структура рынка ценных бумаг.

Фондовые биржи: цели, задачи и механизм функционирования.
Финансовые риски

Тема 3. Профессиональные участники рынка ценных бумаг.

1. Понятие профессиональных участников.
2. Организация деятельности брокерских и дилерских компаний в России.
3. ММВБ (история создания, торговые площадки, расчеты, получение листинга, индексы)

Тема 4. Виды и классификация ценных бумаг.

1. Понятие и фундаментальные свойства ценных бумаг.
2. Классификация ценных бумаг по видам, эмитентам, форме выпуска, способу получения дохода, сроку обращения.
3. Порядок размещения ценных бумаг.

Тема 5. Облигации.

1. Правовой статус облигаций и их характеристика.
2. Классификация облигаций, критерии выбора типа облигаций для их размещения.
3. Ценообразование облигаций, оценка и анализ факторов, определяющих цену облигаций. Рейтинг облигаций.

Тема 6. Акции.

1. Правовой статус акций, их выпуск и обращение.
2. Принципы формирования портфеля акций.
3. Модели ценообразования акций.

Тема 7. Конвертируемые ценные бумаги.

1. Конвертируемые облигации, их преимущества и достоинства.
2. Модель конвертации облигаций.
3. Особенности ценообразования конвертируемых облигаций.

Тема 8. Права, варранты, депозитарные расписки.

1. Варранты. Выпуск и обращение варрантов.
2. Депозитарные расписки ADR и GDR.
3. Организация выпуска депозитарных расписок и порядок их обращения на фондовых рынках

Тема 9. Государственные ценные бумаги.

1. Российские государственные ценные бумаги
2. Государственные бескупонные облигации (ГКО): порядок их выпуска и обращения.
3. Облигации федерального и сберегательного займов (ОФЗ и ОСЗ).

Тема 10. Муниципальные ценные бумаги.

1. Облигации субъектов Российской Федерации.
2. Бюджеты регионов и объемы эмиссии региональных ценных бумаг.

Планы лабораторных занятий

Лабораторные занятия по данной учебной дисциплине предусмотрено в количестве 4 ч.

Тема 1. Облигации.

1. Анализ облигаций.
2. Структура государственных и корпоративных облигаций

Тема 2. Акции.

1. Анализ акций.
2. Оценка рисков по акциям

**6. ПЕРЕЧЕНЬ УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ
ДЛЯ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ**

Контроль самостоятельной работы студента осуществляется в форме:

изучения:

- первоисточников,
- терминологии.

ответов:

- на вопросы для самопроверки,

подготовки:

- сообщений,
- рефератов,
- презентаций.

решений:

- заданий,
- тестов.

6.1. Задания для приобретения, закрепления и углубления знаний.

6.1.1 Основные категории учебной дисциплины для самостоятельного изучения:

| № п/п | Категория | Содержание |
|-------|--|--|
| 1 | Акция | Эмиссионная ценная бумага, закрепляющая права ее владельца (акционера) на получение части прибыли акционерного общества в виде дивидендов, на участие в управлении акционерным обществом и на часть имущества, остающегося после его ликвидации. Акция является именной ценной бумагой |
| 2 | Бездокументарная форма эмиссионных ценных бумаг | форма эмиссионных ценных бумаг, при которой владелец устанавливается на основании записи в системе ведения реестра владельцев ценных бумаг или, в случае депонирования ценных бумаг, на основании записи по счету депо |

| | | |
|----|---|--|
| 3 | Вексель | основанное на соглашении, удостоверяющее ничем не обусловленное обязательство векселедателя (простой вексель) либо иного, указанного в векселе плательщика (переводной вексель) выплатить по наступлении предусмотренного векселем срока полученные займы денежные суммы |
| 4 | Вещные правоотношения | правоотношения, в которые интерес управомоченного лица удовлетворяется за счет полезных свойств вещей путем его непосредственного взаимодействия с вещью |
| 5 | Выпуск эмиссионных ценных бумаг | совокупность всех ценных бумаг одного эмитента, предоставляющих одинаковый объем прав их владельцам и имеющих одинаковую номинальную стоимость в случаях, если наличие номинальной стоимости предусмотрено законодательством Российской Федерации |
| 6 | Делистинг ценных бумаг | исключение фондовой биржей ценных бумаг из котировального списка |
| 7 | Документарная форма эмиссионных ценных бумаг | форма эмиссионных ценных бумаг, при которой владелец устанавливается на основании предъявления оформленного надлежащим образом сертификата ценной бумаги или, в случае депонирования такового, на основании записи по счету депо |
| 8 | Дополнительный выпуск эмиссионных ценных бумаг | совокупность ценных бумаг, размещаемых дополнительно к ранее размещенным ценным бумагам того же выпуска эмиссионных ценных бумаг. Ценные бумаги дополнительного выпуска размещаются на одинаковых условиях |
| 9 | Именные эмиссионные ценные бумаги | ценные бумаги, информация о владельцах которых должна быть доступна эмитенту в форме реестра владельцев ценных бумаг, переход прав на которые и осуществление закрепленных ими прав требуют обязательной идентификации владельца |
| 10 | Коносаменты | товарораспорядительные документы, которыми оформляются морские перевозки грузов |
| 11 | Листинг ценных бумаг | включение фондовой биржей ценных бумаг в котировальный список |
| 12 | Облигация | эмиссионная ценная бумага, закрепляющая право ее держателя на получение от эмитента облигаций ее номинальной стоимости и зафиксированного в ней процента от этой стоимости или иного имущественного эквивалента в предусмотренный ею срок |
| 13 | Обращение ценных бумаг | заключение гражданско-правовых сделок, влекущих переход прав собственности на ценные бумаги |
| 14 | Опцион эмитента | эмиссионная ценная бумага, закрепляющая право ее владельца на покупку в предусмотренный в ней срок и/или при наступлении указанных в ней обстоятельств определенного количества акций эмитента такого опциона по цене, определенной в опционе эмитента. Опцион эмитента является именной ценной бумагой |
| 15 | Предъявительскими бумагами могут быть | векселя, облигации, акции, чеки, банковские сертификаты, коносаменты (документы, удостоверяющие прием груза к морской перевозке). В ряде случаев к предъявительским ценным бумагам относят также деньги в виде банкнот |
| 16 | Производными ценными бумагами являются | депозитарные расписки, удостоверяющие право их держателей на конвертацию этих бумаг в установленный срок в ценные бумаги другого вида, и фондовые варранты (называемые у нас опционными свидетельствами), удостоверяющие право на покупку или продажу определенного количества ценных бумаг (акций или облигаций) в установленный срок по заранее оговоренной цене |
| 17 | Размещение | отчуждение эмиссионных ценных бумаг эмитентом первым |

| | | |
|----|--|--|
| | эмиссионных ценных бумаг | владельцам путем заключения гражданско-правовых сделок |
| 18 | Расчеты по аккредитиву | банк, действующий по поручению плательщика об открытии аккредитива и в соответствии с его указанием (банк-эмитент), обязуется произвести платежи получателю средств или оплатить, акцептовать или учесть переводной вексель, либо дать полномочия другому банку (исполняющему банку) произвести платежи получателю средств или оплатить, акцептовать или учесть переводной вексель |
| 19 | Решение о выпуске ценных бумаг | документ, содержащий данные, достаточные для установления объема прав, закрепленных ценной бумагой |
| 20 | Сертификат эмиссионной ценной бумаги | документ, выпускаемый эмитентом и удостоверяющий совокупность прав на указанное в сертификате количество ценных бумаг |
| 21 | Чек | ценная бумага, содержащая ничем не обусловленное письменное распоряжение чекодателя банку уплатить держателю чека указанную в нем сумму |
| 22 | Ценная бумага | под ценной бумагой понимается выраженное в документальной или бездокументарной форме, право требования имущественного и (или) неимущественного характера, осуществление которого возможно лишь при предъявлении с соблюдением установленной формы и в установленном законом порядке ценной бумаги или документа, подтверждающего право на нее |
| 23 | Фьючерсы | договора на право покупки или продажи доходных ценных бумаг, в том числе в будущем и на определенных условиях |
| 24 | Эмиссионные ценные бумаги на предъявителя | ценные бумаги, переход прав на которые и осуществление закрепленных ими прав не требуют идентификации владельца |
| 25 | Эмитент | юридическое лицо или органы исполнительной власти либо органы местного самоуправления, несущие от своего имени обязательства перед владельцами ценных бумаг по осуществлению прав, закрепленных ими |
| 26 | Эмиссионная ценная бумага | любая ценная бумага, в том числе бездокументарная, которая характеризуется одновременно следующими признаками: закрепляет совокупность имущественных и неимущественных прав, подлежащих удостоверению, уступке и безусловному осуществлению |

6.2. Задания для повторения и углубления приобретаемых знаний.

Задание 6.2.1. 33 (ПК-21) Организация рынка ценных бумаг.

1. Какие существуют формы выпуска ценных бумаг?
2. Какова ставка налога на доход, полученный по государственным ценным бумагам Российской Федерации?
3. Составьте схему организации рынка ценных бумаг.

Задание 6.2.2 34 (ПК-21) Структура рынка ценных бумаг.

1. Назовите крупнейшие в мире фондовые биржи.
2. Составьте схему структуры управления рынка ценных бумаг.
3. Назовите основные функции ЦБ РФ как регулятора фондового рынка России

Задание 6.2.3 31 (ПК-21) Профессиональные участники рынка ценных бумаг.

1. Дайте определение понятию «брокер»
2. Перечислите виды брокерских договоров
3. Составьте схему участников рынка ценных бумаг.

Задание 6.2.4 35 (ПК-21) Виды и классификация ценных бумаг.

год начала подготовки 2017

1. Перечислите основные виды ценных бумаг
2. Назовите известные вам виды акций
3. Какие виды доходов по облигациям вы знаете?

Задание 6.2.5 34 (ПК-21) Облигации.

1. Проценты по облигациям будут выплачены, если акционерное общество имеет убыток?
2. Облигация – это разновидность долгового обязательства?
3. Что такое «купонный доход» по облигации?

Задание 6.2.6 33 (ПК-21) Акции

1. Что представляют собой акционерные общества? Приведите основные отличия ЗАО от ОАО.
2. Определите, что такое филиал, представительство, дочернее общество и зависимое общество. Чем они друг от друга отличаются?
3. Перечислите формы реорганизации АО, принятые в российском законодательстве.
4. Расскажите про формирование уставного капитала АО. Дайте определения следующим терминам: акция, размещенные акции, объявленные акции.
5. Рассчитайте дивидендную доходность акции номинальная стоимость которой 500 руб., которая торгуется на бирже по цене 1025,22 руб., если предполагаемый дивиденд составит 6%.
6. Что понимается под контрольным пакетом акций? Что такое блокирующий пакет акций?

Задание 6.2.7 34 (ПК-21) Конвертируемые ценные бумаги.

1. Какое влияние на надежность вложений инвестора оказывает возможность совершения операций с опционами?
2. Дайте определение понятию «фьючерс»
3. Перечислите основные особенности ценообразования конвертируемых облигаций.

Задание 6.2.8 33 (ПК-21) Права, warrants, депозитарные расписки.

1. Дайте определение понятию «warrant».
2. Охарактеризуйте сущность депозитарных расписок.
3. Поясните порядок обращения депозитарных расписок на фондовых рынках

Задание 6.2.9 35 (ПК-21) Государственные ценные бумаги.

1. В чём цели и задачи эмиссии государственных ценных бумаг?
2. Назовите цели выпуска облигаций федерального и сберегательного займов
3. В чём состоит порядок расчета купонного дохода.

Задание 6.2.10 35 (ПК-21) Муниципальные ценные бумаги.

1. Дайте определение понятию «муниципальная ценная бумага».
2. Поясните процесс размещения региональных облигаций на фондовом рынке.
3. Составьте рейтинг регионов по оценке инвестиционной их привлекательности.

6.3. Задания, направленные на формирование профессиональных умений:

Задание 6.3.1. У1(ПК-21)

Подготовьте реферат на тему «История развития фондового рынка России».

Задание 6.3.2. У2(ПК-21)

Составьте презентацию «Фондовые риски»

Задание 6.3.3. У 2 (ПК-21)

Подготовьте доклад на тему «Инвестиционная деятельность на рынке ценных бумаг».

Задание 6.3.4. У4(ПК-21)

Проанализируйте стратегии работы на рынке ценных бумаг и представьте их классификацию в виде таблицы с помощью текстового редактора Microsoft Word.

Задание 6.3.5. У5(ПК-21)

Составьте презентацию «Облигации: типы и виды».

6.4. Задания, направленные на формирование профессиональных навыков, владений

Задание 6.4.1. В1(ПК-21)

Составьте словарь терминов по теме «Виды ценных бумаг» с помощью табличного процессора Microsoft Excel.

Задание 6.4.2. В2(ПК-21)

Откройте поисковую систему (Yandex или Google) и воспользуйтесь инструментами расширенного поиска. Помните, что информация должна быть достоверной (известен автор, издатель, авторитетный сайт) и актуальной (примерно за последние 3 года).

Представьте список из 3 источников, которые бы вы использовали при написании сообщения на тему «Паевые инвестиционные фонды».

Задание 6.4.3 В3(ПК-21)

Перейти по ссылке www.cbr.ru – банк России и ознакомьтесь с основными положениями политики банка России на фондовом рынке

Задание 6.4.4. В4(ПК-21)

Составьте список государственных облигаций РФ.

Задание 6.4.5. В5(ПК-21)

Составьте план мероприятий по формированию инвестиционного портфеля на фондовом рынке.

Соотношение заданий с формируемыми показателями обучения

| Формируемая компетенция | Показатели сформированности компетенции | Задания, направленные на: - приобретение новых знаний, углубления и закрепления ранее приобретенных знаний; - формирование профессиональных умений и навыков |
|---|--|--|
| <p>ПК-21 способность составлять финансовые планы организации, обеспечивать осуществление финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления</p> | <p>Владеть: - методами и средствами самостоятельного, методически обоснованного составления финансового плана организации В1(ПК-21) - навыками обеспечения финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления В2(ПК-21) - навыками выбора наиболее удобных в конкретной хозяйственной ситуации форм заимствования и оценивания кредитных рисков при осуществлении финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления В3(ПК-21) - основными законодательными и нормативными актами в области ценообразования при осуществлении финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления В4(ПК-21) - подходами к проектированию организации с учетом складывающихся условий финансовых</p> | <p>Задание 6.4.1. В1(ПК-21) Задание 6.4.2. В2(ПК-21) Задание 6.4.3. В3(ПК-21) Задание 6.4.4 В4(ПК-21) Задание 6.4.5 В5(ПК-21)</p> |

| | | |
|--|--|--|
| | <p>взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления В5(ПК-21)</p> <p>-навыками самостоятельного овладения новыми знаниями по проблемам экономической истории России В6(ПК-21)</p> <p>- навыками соблюдения этических норм при составлении финансовых планов организации, обеспечении осуществления финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления; В7(ПК-21)</p> <p>- навыками оценки производственного и финансового риска при составлении финансовых планов организации, обеспечении осуществления финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления В8(ПК-21)</p> | |
| | <p>Уметь:</p> <p>- использовать средства финансового планирования при составлении финансовых планов организации У1(ПК-21)</p> <p>- применять систему категорий и методов, направленных на формирование работы по финансовому планированию организации при обеспечении взаимоотношений с органами местного самоуправления У2(ПК-21)</p> <p>-понимать закономерности финансового планирования организации У3(ПК-21)</p> <p>-понимать структуру государственной власти и органов местного самоуправления У4(ПК-21)</p> <p>- понимать сущность финансовых взаимоотношений организаций, органов местного самоуправления и государственной власти У5(ПК-21)</p> <p>-понимать структуру финансовых планов организации У6(ПК-21)</p> <p>- применять принципы соблюдения этических норм при составлении финансовых планов организации, обеспечении осуществления финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления; У7(ПК-21)</p> <p>- использовать основы оценки производственного и финансового риска при составлении финансовых планов организации, обеспечении осуществления финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления У8(ПК-21)</p> | <p>Задание 6.3.1. У1(ПК-21)</p> <p>Задание 6.3.2. У2(ПК-21)</p> <p>Задание 6.3.3. У3(ПК-21)</p> <p>Задание 6.3.4. У4(ПК-21)</p> <p>Задание 6.3.5. У5(ПК-21)</p> |
| | <p>Знать:</p> <p>- виды, пути и средства финансового планирования организации 31(ПК-21)</p> <p>- систему категорий и методов, направленных на формирование работы по финансовому планированию организации при обеспечении взаимоотношений с органами местного самоуправления 32(ПК-21)</p> <p>-закономерности финансового планирования организации 33(ПК-21)</p> <p>-структуру государственной власти и органов местного самоуправления 34(ПК-21)</p> <p>- сущность финансовых взаимоотношений органов местного самоуправления и государственной власти</p> | <p>Задание 6.2.1. 31(ПК-21)</p> <p>Задание 6.2.2 32(ПК-21)</p> <p>Задание 6.2.3 33(ПК-21)</p> <p>Задание 6.2.4 34(ПК-21)</p> <p>Задание 6.2.5 35(ПК-21)</p> |

| | | |
|--|---|--|
| | <p>35(ПК-21) -структуру финансовых планов организации 36(ПК-21) - принципы соблюдения этических норм при составлении финансовых планов организации, обеспечении осуществления финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления; 37(ПК-21) - основы оценки производственного и финансового риска при составлении финансовых планов организации, обеспечении осуществления финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления 38(ПК-21)</p> | |
|--|---|--|

7. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

7.1. Средства оценивания в ходе текущего контроля:

7.1.1 Задания для оценки знаний

7.1.1.1 Тестовые задания

1. Рынок ценных бумаг:

- а) включает финансовый рынок;
- б) включает в себя денежный рынок;
- в) является составной частью финансового рынка;
- г) включает в себя кредитный рынок.

2. К общерыночным функциям РЦБ относят:

- а) пере распределительная, финансирование дефицита бюджета;
- б) коммерческая, регулирующая, ценовая;
- в) страхование ценовых и финансовых рисков, ценовая.
- г) перераспределительная, информационная.

3. Определите неправильное утверждение:

акции могут быть:

- а) простыми и привилегированными;
- б) простыми и переводными;
- в) размещёнными и объявленными;
- г) конвертируемыми и кумулятивными.

4. Кумулятивные акции, дают право на:

- а) первоочередное получение дивидендов;
- б) право голоса на собрании акционеров;
- в) на получение не выплачиваемого дивиденда, который накапливается и выплачивается позже;
- г) обмен на акции других типов и облигаций.

5. Привилегированные акции, дают право на:

- а) право голоса на собрании акционеров;
- б) первоочередное получение дивидендов;
- в) на получение не выплачиваемого дивиденда, который накапливается и выплачивается позже;

год начала подготовки 2017

г) обмен на акции других типов и облигаций.

6. Конвертируемые акции, дают право на:

а) первоочередное получение дивидендов;

б) право голоса на собрании акционеров;

в) на получение не выплачиваемого дивиденда, который накапливается и выплачивается позже;

г) обмен на акции других типов и облигаций.

7. Отличительной особенностью варранта, характеризующей его обращение на рынке ценных бумаг, является право:

а) купить определенное число акций по фиксированной цене

б) продать определенное число акций по фиксированной цене;

в) купить определенное число акций по номинальной цене;

г) купить определенное число акций по номинальной цене до их выпуска в обращение.

8. Сертификатом ценной бумаги является:

а) документ, выпускаемый эмитентом и удостоверяющий совокупность прав на указанное в сертификате количество ценных бумаг;

б) ценная бумага как свидетельство о владении лица, указанного в ней, определенным количеством ценных бумаг;

в) справка как документ, свидетельствующий о владении указанного в ней лица определенным количеством ценных бумаг;

г) расписка эмитента в получении денег за проданные ценные бумаги.

9. Включение имени (наименования) владельца ценной бумаги в реквизиты сертификата:

а) обязательно если она является ценной бумагой на предъявителя;

б) не обязательно, если оно является эмиссионной ценной бумагой;

в) не обязательно, если оно является именной эмиссионной ценной бумагой;

г) обязательно, если она является именной эмиссионной ценной бумагой.

10. Клиринговые центры по работе со основными видами ценных бумаг называются:

а) специализированные;

б) общего типа;

в) фондовые;

г) расширенного типа.

11. Клиринговые центры по работе со сложными видами ценных бумаг называются:

а) общего типа;

б) унифицированные;

в) специальные;

г) фондовые.

12. Взаимоотношения участников фондовых операций и клиринговой организации регулируются:

а) распиской;

б) договором;

в) приказом;

г) сертификатом.

13. Осуществление частного клиринга требует наличия:

а) специальной лицензии;

год начала подготовки 2017

- б) сертификата;
- в) лицензии на осуществление основного вида деятельности;
- г) трастового договора.

14. Назовите тип портфеля, когда его владелец не имеет четких инвестиционных целей:

- а) консервативный;
- б) дохода;
- в) бессистемный;
- г) роста.

15. В инвестиционном портфеле ценные бумаги распределяются таким образом: акции – 60%, облигации – 30, сертификаты банков – 10%. Как можно назвать такого инвестора?

- а) агрессивный;
- б) консервативный;
- в) уравновешенный;
- г) бессистемный.

16. Прибыль акционерного общества распределяется в следующем порядке:

- а) выплаты: процентов по облигациям; дивидендов по привилегированным акциям; дивидендов по обыкновенным акциям;
- б) выплаты: дивидендов по привилегированным акциям; процентов по облигациям; дивидендов по обыкновенным акциям;
- в) выплаты: дивидендов по привилегированным акциям; дивидендов по обыкновенным акциям; процентов по облигациям;
- г) выплаты: задолженности в бюджет; дивидендов по обыкновенным акциям; процентов по облигациям.

17. Какова максимальная сумма, на которую АО может выпускать облигации?

- а) Не превышает уставной капитал.
- б) Превышает уставной капитал на 20%.
- в) Равна величине обеспечения, предоставленного обществу.
- г) Ограничения отсутствуют.

18. Возможна ли ситуация, когда акционер – владелец привилегированных акций может участвовать в общем собрании акционеров с правом голоса?

- а) Да.
- б) Нет.
- в) Вопрос поставлен некорректно.
- г) Только имея не менее 10% акций.

19. Профессиональный участник рынка ценных бумаг «юридическое лицо» собирает, фиксирует, обрабатывает, хранит и представляет данные, систематизирует экономическую информацию, выполняет сделки с ценными бумагами, зарегистрированными в реестре владельцев именных ценных бумаг эмитента, принимая на себя функции посредника. Правомерны ли действия профессионального участника рынка ценных бумаг?

- а) Правомерны, поскольку осуществляется брокерская деятельность.
- б) Правомерны, поскольку совмещаются функции реестродержателя, дилера и брокера.
- в) Неправомерны, поскольку совмещать можно только деятельность дилера и брокера.
- г) Вопрос поставлен некорректно.

год начала подготовки 2017

20. Сочетание каких видов деятельности на рынке ценных бумаг возможно?

- а) Депозитария и брокера.
- б) Брокера и номинального держателя ценных бумаг.
- в) Депозитария и номинального держателя ценных бумаг.
- г) Номинального держателя ценных бумаг и клиринговой деятельности.

21. Инвестор заключил с коммерческим банком договор банковского вклада в форме публичного договора, и при этом ему был выдан документ, представляющий собой ценную бумагу. Какую ценную бумагу получил клиент банка?

- а) Сберегательный сертификат.
- б) Депозитный сертификат.
- в) Именную сберегательную книжку.
- г) Кредитный договор.

22. Привлечение денежных средств может осуществляться за счет:

- а) внутренних источников;
- б) внешних источников;
- в) внутренних и внешних источников.
- г) иной ответ.

23. Биржа, это:

- а) место сбора биржевиков;
- б) форма реализации рыночных отношений;
- в) рынок материальных ценностей – средств производства, ценных бумаг, рабочей силы.
- г) организатор торговли ц.б.

24. С какого времени начался исторический процесс развития рынка ценных бумаг в России?

- а) с конца XIX в.; б) с конца XVIII в.; в) с XVII – XVIII в.; г) с начала XX в.

25. Какими были первые ценные бумаги на фондовом рынке России?

- а) векселя;
- б) акции;
- в) государственные ценные бумаги;
- г) облигации предприятий.

Ответы к тестам

| Вопрос | Ответ |
|--------|-------|
| 1 | 3 |
| 2 | 2 |
| 3 | 2 |
| 4 | 3 |
| 5 | 2 |
| 6 | 4 |
| 7 | 2 |
| 8 | 1 |
| 9 | 4 |
| 10 | 2 |
| 11 | 3 |
| 12 | 2 |
| 13 | 3 |
| 14 | 3 |

| | |
|----|---|
| 15 | 1 |
| 16 | 1 |
| 17 | 2 |
| 18 | 1 |
| 19 | 3 |
| 20 | 3 |
| 21 | 2 |
| 22 | 3 |
| 23 | 4 |
| 24 | 3 |
| 25 | 3 |

| № | Показатели сформированности компетенции | ФОС текущего контроля (тестовые задания) |
|----|---|---|
| 1. | 31(ПК-21) | 1-25 |
| 2. | 32(ПК-21) | 1-25 |
| 3. | 33(ПК-21) | 1-25 |
| 4. | 34(ПК-21) | 1-15 |
| 5. | 35(ПК-21) | 16-25 |
| 6. | 36(ПК-21) | 1-25 |
| 7. | 37(ПК-21) | 1-25 |
| 8. | 38(ПК-21) | 1-25 |

7.1.2 Задания для оценки умений

7.1.2.1 Примерные темы сообщений (ПК-21)

Сообщения (устная форма) позволяет глубже ознакомиться с отдельными, наиболее важными и интересными процессами, осмыслить, увидеть их сложность и особенности.

1. Облигации федерального и сберегательного займов (ОФЗ и ОСЗ).
2. Инвестиционный пай (характеристика и обращение).
3. Вексельное обращение.
4. Чек и банковский сертификат как виды ценных бумаг.
5. Закладная и другие ипотечные ценные бумаги.
6. Понятие и формы выпуска депозитарных расписок.
7. Депозитарные расписки ADR и GDR.
8. Производные финансовые инструменты на ценные бумаги.
9. Организация процесса торговли ценными бумагами.
10. Облигации субъектов Российской Федерации: способы заимствований местных и региональных администраций

| № | Показатели сформированности компетенции | ФОС текущего контроля (тематика сообщений) |
|---|---|---|
| 1 | У1(ПК-21) | 1-10 |
| 2 | У2(ПК-21) | 3, 5, 6, 8 |
| 3 | У3(ПК-21) | 1-10 |
| 4 | У4(ПК-21) | 1-10 |
| 5 | У5(ПК-21) | 1-10 |

7.1.2.2 Темы рефератов (ПК-21)

1. Развитие фондового рынка в России.
2. Роль рынка ценных бумаг в экономическом развитии страны.
3. Профессиональные участники фондового рынка.

4. Порядок размещения ценных бумаг.
5. Правовой статус облигаций и их характеристика.
6. Классификация облигаций, критерии выбора типа облигаций для их размещения.
7. Ценообразование облигаций, оценка и анализ факторов, определяющих цену облигаций.
8. Модель конвертации облигаций.
9. Правовой статус акций, их выпуск и обращение.
10. Основы технического и фундаментального анализа ценных бумаг.
11. Привилегированные акции, их виды, особенности выпуска и обращения.
12. Принципы формирования портфеля акций.
13. Оценка рисков инвестирования в акции.
14. Анализ развития российского рынка акций.
15. Модели ценообразования акций.
16. Депозитарные расписки. Опыт выпуска депозитарных расписок российскими предприятиями.
17. Анализ рынка государственных ценных бумаг в России.
18. Фондовые биржи: цели, задачи и механизм функционирования.
19. Организация деятельности брокерских и дилерских компаний в России.
20. Фондовые индексы: методика расчета и механизм действия..

| № | Показатели сформированности компетенции | ФОС текущего контроля (тематика рефератов) |
|---|---|---|
| 1 | У1(ПК-21) | 1-20 |
| 2 | У2(ПК-21) | 1-20 |
| 3 | У3(ПК-21) | 1-20 |
| 4 | У4(ПК-21) | 1-15 |
| 5 | У5(ПК-21) | 16-20 |
| 6 | У6(ПК-21) | 1-10 |
| 7 | У7(ПК-21) | 1-15 |
| 8 | У8(ПК-21) | 10-20 |

7.1.2.3. Примерная тематика презентаций (ПК-21)

Презентация – набор слайдов в Power Point. Выступление по презентации не требуется и оценивается дополнительно.

Преподаватель каждый раз выбирает самостоятельно количество слайдов (в зависимости от количества учебных часов по дисциплине) от 10 слайдов и до 30 по одной проблематике.

Название документа – ФИО студента (Иванов И.П.ppt);

Первый слайд – тема презентации, далее – сам материал. План, актуальность темы, введение, заключение и список литературы не являются составной частью презентации и делаются студентом по собственному желанию.

Презентация в обязательном порядке включает следующие элементы:

- картинки и фото;
- графические элементы;
- классификации;
- таблицы;
- логические цепочки;
- схемы;
- выводы.

Ссылка при цитировании на источник в презентации обязательна. Все данные

должны быть сопровождаемы годами.

Тематика презентационного (тематического) проекта.

1. Организация рынка ценных бумаг.
2. Структура рынка ценных бумаг.
3. Классификация и виды ценных бумаг.
4. Профессиональные участники РЦБ (брокерская и дилерская деятельность)
5. Профессиональные участники РЦБ (клиринговая деятельность и доверительное управление).
6. Профессиональные участники РЦБ (депозитарии и деятельность по ведению реестра ценных бумаг).
7. Лицензирование профессиональной деятельности на РЦБ.
8. Эмиссия ценных бумаг и проспект эмитента.
9. Система регулирования рынка ценных бумаг.
10. Фондовая биржа как организатор рынка.
11. Облигация как вид ценной бумаги.
12. Вексель как вид ценной бумаги.
13. Акции (виды, свойства, права владельцев).
14. Привилегированные акции, их виды и разновидности.
15. Приобретение и выкуп акций, оценка и доходность акций.
16. Листинг акций.
17. Рейтинг облигаций.
18. Котировка ценных бумаг и фондовые индексы.
19. Фондовый варрант как вид ценной бумаги.
20. Государственные бескупонные облигации (ГКО): порядок выпуска и обращения.

| № | Показатели сформированности компетенции | ФОС текущего контроля (тематика презентаций) |
|---|---|--|
| 1 | У1(ПК-21) | 1-20 |
| 2 | У2(ПК-21) | 1-20 |
| 3 | У3(ПК-21) | 1-20 |
| 4 | У4(ПК-21) | 1-15 |
| 5 | У5(ПК-21) | 16-20 |
| 6 | У6(ПК-21) | 1-10 |
| 7 | У7(ПК-21) | 1-15 |
| 8 | У8(ПК-21) | 10-20 |

7.1.3 Задания для оценки навыков, владений, опыта деятельности

7.2.3.1 Задачи по дисциплине (ПК-21)

1. В контракте предусмотрено начисление а) простого, б) сложного процента в таком порядке: в первом полугодии по годовой процентной ставке 0,09, потом в следующем году ставка уменьшилась на 0,01, а в следующих двух полугодиях увеличилась на 0,005 в каждом из них. Найти величину наращенного вклада в конце срока, если величина первоначального вклада равна \$800.

Решение

$$S(0) = 800$$

$$n_1 = 0.5, i_1 = 0.09$$

$$n_2 = 1, i_2 = 0.09 - 0.01 = 0.08$$

$$n_3 = 0.5, i_3 = 0.08 + 0.005 = 0.085$$

год начала подготовки 2017

$$n_4 = 0.5, i_4 = 0.085 + 0.005 = 0.09$$

$$а) S(n) = 800 * (1 + 0.5 * 0.09 + 1 * 0.08 + 0.5 * 0.085 + 0.5 * 0.09) = 970$$

$$б) S(n) = 800 * (1 + 0.09)^{0.5} * (1 + 0.08)^1 * (1 + 0.085)^{0.5} * (1 + 0.09)^{0.5} = 980.97$$

2. Ссуда в размере 1 млн.рублей выдана 20 января до 5 октября включительно под 18% годовых. Какую сумму должен заплатить должник в конце срока при начислении простых процентов? Рассчитать в трех вариантах подсчета простых процентов.

Решение

Для начала определим число дней ссуды: 20 января это 20 день в году, 5 октября — 278 день в году. 278 — 20 = 258. При приближенном подсчете — 255. 30 января — 20 января = 10. 8 месяц умножить на 30 дней = 240. итого: 240 + 10 + 5 = 255.

1. Точные проценты с точным числом дней ссуды (365/365)

$$S = 1\,000\,000 * (1 + (258/365)*0.18) = 1\,127\,233 \text{ руб.}$$

2. Обыкновенные проценты с точным числом дней ссуды (360/365)

$$S = 1\,000\,000 * (1 + (258/360)*0.18) = 1\,129\,000 \text{ руб.}$$

3. Обыкновенные проценты с приближенным числом дней ссуды (360/360)

$$S = 1\,000\,000 (1 + (255/360)*0.18) = 1\,127\,500 \text{ руб.}$$

| № | Показатели сформированности компетенции | ФОС текущего контроля (задачи по дисциплине) |
|---|---|--|
| 1 | V1(ПК-21) | 1-2 |
| 2 | V2(ПК-21) | 1-2 |
| 3 | V3(ПК-21) | 1-2 |
| 4 | V4(ПК-21) | 1-2 |
| 5 | V5(ПК-21) | 1-2 |

7.2 ФОС для промежуточной аттестации

7.2.1 Задания для оценки знаний

Вопросы к экзамену (ПК-21)

1. Организация рынка ценных бумаг.
2. Структура рынка ценных бумаг.
3. Классификация и виды ценных бумаг.
4. Профессиональные участники РЦБ (брокерская и дилерская деятельность)
5. Профессиональные участники РЦБ (клиринговая деятельность и доверительное управление).
6. Профессиональные участники РЦБ (депозитарии и деятельность по ведению реестра ценных бумаг).
7. Лицензирование профессиональной деятельности на РЦБ.
8. Эмиссия ценных бумаг и проспект эмитента.
9. Система регулирования рынка ценных бумаг.
10. Фондовая биржа как организатор рынка.
11. Облигация как вид ценной бумаги.
12. Вексель как вид ценной бумаги.
13. Акции (виды, свойства, права владельцев).
14. Привилегированные акции, их виды и разновидности.
15. Приобретение и выкуп акций, оценка и доходность акций.
16. Листинг акций.
17. Рейтинг облигаций.

18. Котировка ценных бумаг и фондовые индексы.
19. Фондовый варрант как вид ценной бумаги.
20. Государственные бескупонные облигации (ГКО): порядок выпуска и обращения.
21. Облигации федерального и сберегательного займов (ОФЗ и ОСЗ).
22. Инвестиционный пай (характеристика и обращение).
23. Вексельное обращение.
24. Чек и банковский сертификат как виды ценных бумаг.
25. Закладная и другие ипотечные ценные бумаги.
26. Понятие и формы выпуска депозитарных расписок.
27. Депозитарные расписки ADR и GDR.
28. Производные финансовые инструменты на ценные бумаги.
29. Организация процесса торговли ценными бумагами.
30. Облигации субъектов Российской Федерации: способы заимствований местных и региональных администраций
- 31.

| № | Показатели сформированности компетенции | ФОС текущего контроля (вопросы к экзамену) |
|---|---|--|
| 1 | 31(ПК-21) | 1-10 |
| 2 | 32(ПК-21) | 1-15 |
| 3 | 33(ПК-21) | 1-20 |
| 4 | 34(ПК-21) | 21-30 |
| 5 | 35(ПК-21) | 1-30 |
| 6 | 36(ПК-21) | 1-30 |
| 7 | 37(ПК-21) | 1-30 |
| 8 | 38(ПК-21) | 1-30 |

Задания для оценки умений.

В качестве фондов оценочных средств для оценки умений обучающегося используются задания, рекомендованные для выполнения в часы самостоятельной работы (раздел 6.2)

Задания для оценки навыков, владений, опыта деятельности

В качестве фондов оценочных средств для оценки навыков, владений, опыта деятельности обучающегося используются задания, рекомендованные для выполнения в часы самостоятельной работы (раздел 6.3).

8. ПЕРЕЧЕНЬ ОСНОВНОЙ И ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ УЧЕБНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Литература

а) Основная

1. Галанов В.А. Рынок ценных бумаг: Учебное пособие. – М.: ИНФРА-М, 2006. (Гриф)
2. Галанов В.А. Рынок ценных бумаг: Учебник. – М.: ИНФРА-М, 2009. (Гриф)
3. Вершинина О.В. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Вершинина О.В.— Электрон. текстовые данные.— М.: Российский новый университет, 2013.— 128 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/21313>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю
4. Кузнецов Б.Т. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Кузнецов Б.Т.— Электрон. текстовые данные.— М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2011.— 288 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/8577>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю
5. Селищев А.С. Рынок ценных бумаг: учебник и практикум для академического бакалавриата/ А.С. Селищев, Г.А. Маховикова. – 3-е изд., перераб. и доп. – М.: Изд. Юрайт, 2015. – 483с. – Серия: Бакалавриат. Академический курс. (Гриф)

6. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс]: учебник для бакалавров/ В.А. Зверев [и др.].— Электрон. текстовые данные.— М.: Дашков и К, 2015.— 256 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/35305>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю
7. Николаева И.П. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс]: учебник для бакалавров/ Николаева И.П.— Электрон. текстовые данные.— М.: Дашков и К, 2015.— 256 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/35306>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю

б) Дополнительная

1. Алиев А.Р. Рынок ценных бумаг в России [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Алиев А.Р. - Электрон. текстовые данные.— М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2012. - 199 с. - Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/10508>. - ЭБС «IPRbooks», по паролю
2. Вершинина О.В. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс]: учебное по-собие/ Вершинина О.В. - Электрон. текстовые данные.— М.: Российский новый университет, 2013. - 128 с. - Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/21313>. - ЭБС «IPRbooks», по паролю

9. ПЕРЕЧЕНЬ РЕСУРСОВ ИНФОРМАЦИОННО-ТЕЛЕКОММУНИКАЦИОННОЙ СЕТИ «ИНТЕРНЕТ», НЕОБХОДИМЫХ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

1. ЭБС IPRbooks (АйПиАрбукс) <http://www.iprbookshop.ru>
2. Информационно-правовой портал «Гарант» www.garant.ru
3. Информационно-правовой портал «КонсультантПлюс» www.consultant.ru
4. Российская государственная публичная библиотека <http://elibrary.rsl.ru/>
5. Глобальная экономика [Электронный ресурс]: энциклопедия/ Т.Ф. Рябова [и др.].— Электрон. текстовые данные.— М.: Финансы и статистика, 2011.— 920 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/18798>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю

10. ОБУЧЕНИЕ ИНВАЛИДОВ И ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ

Изучение данной учебной дисциплины обучающимися с ограниченными возможностями здоровья осуществляется в соответствии с Приказом Министерства образования и науки РФ от 9 ноября 2015 г. № 1309 «Об утверждении Порядка обеспечения условий доступности для инвалидов объектов и предоставляемых услуг в сфере образования, а также оказания им при этом необходимой помощи», «Методическими рекомендациями по организации образовательного процесса для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья в образовательных организациях высшего образования, в том числе оснащённости образовательного процесса» Министерства образования и науки РФ от 08.04.2014г. № АК-44/05вн, «Положением о порядке обучения студентов – инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья», утвержденным приказом ректора от 6 ноября 2015 года №60/о, «Положением о службе инклюзивного образования и психологической помощи» АНО ВО «Российский новый университет» от 20 мая 2016 года № 187/о.

Предоставление специальных технических средств обучения коллективного и индивидуального пользования, подбор и разработка учебных материалов для обучающихся с ограниченными возможностями здоровья производится преподавателями с учетом их индивидуальных психофизиологических особенностей и специфики приема передачи учебной информации.

С обучающимися по индивидуальному плану и индивидуальному графику проводятся индивидуальные занятия и консультации

год начала подготовки 2017

Автор (составитель): доцент Д.В. Шукин



(подпись)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

«Рынок ценных бумаг»

Для подготовки бакалавров по направлению **38.03.01 «Экономика»(профиль «Финансы и кредит»)**
(Аннотация)

Цели освоения дисциплины

Цель изучения дисциплины заключается в формировании у будущих бакалавров целостного и адекватного представления о рынке ценных бумаг как неотъемлемой части современной финансовой системы.

Компетенции студента, формируемые в результате освоения дисциплины

В результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции: ПК-21.

Ожидаемые результаты

В результате изучения курса студент должен:

- *знать* базовые понятия и категории рынка ценных бумаг; фундаментальные свойства основных видов ценных бумаг; особенности

выпуска, эмиссии и обращения основных видов ценных бумаг;

- *уметь* выбирать инструментальные средства для обработки и систематизации финансовой информации о выпуске и обращении основных видов ценных бумаг; рассчитать текущую и будущую доходность ценных бумаг, находящихся в распоряжении хозяйствующего субъекта; провести анализ эффективности текущих и перспективных инвестиций в конкретные ценные бумаги;

- *владеть* навыками анализа перспектив использования отдельных сегментов рынка ценных бумаг в качестве альтернативного источника финансирования деятельности хозяйствующего субъекта; принятия финансовых решений на основе анализа специальных информационных источников; подготовки информационного обзора об уровне доходности ценных бумаг, обращающихся на региональном, национальном и международном рынках.

Содержание дисциплины:

Рынок ценных бумаг как альтернативный источник финансирования экономики. Понятие ценной бумаги. История появления ценных бумаг. Классические виды ценных бумаг и их характеристика (акции, частные облигации, государственные ценные бумаги). Производные ценные бумаги и их характеристика (конвертируемые акции и облигации, варранты, опционы и фьючерсы). Финансовые инструменты на рынке ценных бумаг (векселя, депозитные, сберегательные и инвестиционные сертификаты, секьюритизация частных долгов). Международные ценные бумаги (евроноты, еврооблигации, евроакции).

Рынок ценных бумаг и его структура (западная модель). Первичный рынок ценных бумаг и его характеристика. Методы размещения ценных бумаг. Участники первичного внебиржевого рынка ценных бумаг. Вторичный биржевой рынок (фондовая биржа). Организационная структура и функции фондовой биржи. Профессиональные участники биржи. Основные операции и сделки на бирже. Биржевая информация (биржевые индексы и их характеристика). Этика на фондовой бирже. Биржевые крахи и потрясения.

«Уличный» рынок ценных бумаг и характеристика его деятельности. Участники вторичного рынка.

Брокерские компании (организация, функции, механизм операций). Торговая регистрация, сопоставление и расчетный процесс. Механизм принятия решений на рынке ценных бумаг (фундаментальный и технический анализ). Эмиссия ценных бумаг. Депозитарно-регистрационный механизм рынка ценных бумаг. Система

год начала подготовки 2017

государственного регулирования рынка ценных бумаг: органы государственного надзора, законодательно-правовая база регулирования, национальные особенности регулирования рынка.

Инвестиционная деятельность кредитно-финансовых институтов на рынке ценных бумаг (западная и российская модели) – банков, страховых компаний, инвестиционных компаний, пенсионных фондов и прочих институтов. Рынок ценных бумаг России. История и необходимость создания

рынка. Виды ценных бумаг и финансовых инструментов. Структура рынка ценных бумаг и его основные тенденции развития. Участники рынка. Основные операции на рынке. Государственное регулирование рынка ценных бумаг в России.

**Лист внесения изменений в рабочую программу учебной дисциплины
«Рынок ценных бумаг»**

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на 2020/2021 учебный год.
Протокол № 1 заседания кафедры ПЭ от «03» сентября 2020 г.

1. Актуализация перечня основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины на 2020-2021 учебный год.

1.1. Пункт 8.1. Основная литература

1. Алиев А.Р. Рынок ценных бумаг в России [Электронный ресурс] : учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальности «Финансы и кредит» / А.Р. Алиев. — Электрон. текстовые данные. — М. : ЮНИТИ-ДАНА, 2017. — 199 с. — 978-5-238-01921-5. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/71224.html>
2. Кузнецов Б.Т. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс] : учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальности «Финансы и кредит» / Б.Т. Кузнецов. — Электрон. текстовые данные. — М. : ЮНИТИ-ДАНА, 2017. — 288 с. — 978-5-238-01945-1. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/71054.html>

1.2. Пункт 8.2. Дополнительная литература

1. Галанов В.А. Рынок ценных бумаг: Учебное пособие. – М.: ИНФРА-М, 2006. (Гриф)
2. Галанов В.А. Рынок ценных бумаг: Учебник. – М.: ИНФРА-М, 2009. (Гриф)
3. Курс по рынку ценных бумаг [Электронный ресурс] / . — Электрон. текстовые данные. — Новосибирск: Сибирское университетское издательство, Норматика, 2016. — 117 с. — 978-5-379-01616-6. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/65235.html>

Зав. кафедрой



_____/Преснякова Д.В./