

**Автономная некоммерческая образовательная организация
высшего образования
«КАЛИНИНГРАДСКИЙ ИНСТИТУТ УПРАВЛЕНИЯ»**

Утверждено
Научно-методическим советом Института
протокол заседания
№ 01/20 от 27 августа 2020 г.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ
(Б1.В.ОД.13)**

По направлению подготовки	38.03.01 Экономика
Направленность подготовки	Финансы и кредит
Квалификация (степень) выпускника (уровень направления подготовки)	бакалавр
Форма обучения	очная

Рабочий учебный план по
направлению подготовки (одобрен
Ученым советом Протокол № 05/19 от
29 октября 2019г.)

Калининград

Лист согласования рабочей программы дисциплины (модуля)

Рабочая программа дисциплины «Рынок ценных бумаг» разработана в соответствии с федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, утверждённым приказом Минобрнауки России от 12 ноября 2015 года № 1327

Составитель (автор)

канд. юр.наук В.А.Захарова

Рабочая программа дисциплины рассмотрена и одобрена на заседании Научно-методического совета института, протокол № 01/20 от 27 августа 2020г.

Регистрационный номер 20ВЭб/39

Содержание		Стр.
1.	Цели и задачи освоения дисциплины	4
2.	Место дисциплины в структуре ОПОП	4
3.	Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы	5
4.	Объем, структура и содержание дисциплины в зачетных единицах с указанием количества академических/астрономических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам занятий) и на самостоятельную работу обучающихся	5
5.	Перечень образовательных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень лицензионного программного обеспечения, современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем	10
6.	Оценочные средства для проведения входного, текущего, рубежного контроля и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине и методические материалы по ее освоению	10
7.	Основная и дополнительная учебная литература и электронные образовательные ресурсы, необходимые для освоения дисциплины	11
8.	Дополнительные ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» необходимые для освоения дисциплины	11
9.	Требования к минимальному материально-техническому обеспечению, необходимого для осуществления образовательного процесса по дисциплине	11
	Приложение 1. Оценочные средства для проведения входного, текущего, рубежного контроля и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине и методические материалы по ее освоению	13

1. Цели и задачи освоения дисциплины

Дисциплина «Рынок ценных бумаг» способствует формированию профессиональной компетенции продвинутого уровня ПК-6 (Способность анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей).

Дисциплина «Рынок ценных бумаг» является обязательной дисциплиной, формирующей у обучающихся готовность к усвоению дальнейшего материала по выбранной специальности.

Цель изучения дисциплины «Рынок ценных бумаг» состоит в формировании у будущих экономистов целостного представления о функционировании рынка ценных бумаг; видах первичных и вторичных ценных бумаги и производных финансовых инструментов; организации, проведении и оценке фондовых операций.

Программа составлена в соответствии с требованиями Федерального закона № 273-ФЗ «Об образовании в Российской Федерации», Приказа Минобрнауки РФ от 05.04.2017 г. № 301 «Об утверждении Порядка организации и осуществления образовательной деятельности по образовательным программам высшего образования - программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры», ФГОС ВО и учебным планом по направлению подготовки : 38.03.01 Экономика, направленность «Финансы и кредит» (Рабочий учебный план по направлению подготовки (одобрен Ученым советом Протокол № 05/19 от 29 октября 2019 г.).

2. Место дисциплины в структуре ОПОП

2.1. Указание места дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Дисциплина изучается на четвертом курсе в седьмом семестре.

Дисциплина «Рынок ценных бумаг» является вариативной дисциплиной, формирующей у обучающихся готовность к усвоению дальнейшего материала по выбранной специальности. Дисциплина «Рынок ценных бумаг» является базой для получения компетенций при изучении дисциплины Б1.В.ОД.16 «Финансовое консультирование», обеспечить способность использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности; способность на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты; способность использовать для решения аналитических и исследовательских задач современные технические средства и информационные технологии.

2.2. Календарный график формирования компетенции*

Таблица 1 - Календарный график формирования компетенции ПК-6

№ п/п	Наименование учебных дисциплин и практик, участвующих в формировании компетенции	Курсы			
		1	2	3	4
1	Введение в профессиональную деятельность	+			
2	Учебная практика по получению первичных профессиональных умений и навыков		+		
3	Производственная практика по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности		+	+	
4	Преддипломная практика для выполнения выпускной квалификационной работы				+

* В соответствии с матрицей компетенций

3. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

3.1. Базовые понятия, используемые в дисциплине

К базовым понятиям, используемым при изучении дисциплины, относятся: профессия, экономист, экономика, финансы, кредитные организации, эффективность, эмиссия, ценные бумаги, операции с ценными бумагами.

3.2. Планируемые результаты обучения

Планируемыми результатами обучения по дисциплине «Рынок ценных бумаг» являются знания и умения, осуществляющие формирование компетенции на продвинутом уровне способностью анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей (ПК-6);

Таблица 2 – Перечень результатов обучения, формируемых в ходе изучения дисциплины

Перечень контролируемой компетенции (или ее части)		Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине
код	Содержание компетенций	
ПК-6	Способность анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей	<p>Знать: 3.1 - основные этапы жизненного цикла продукции и услуг и их последовательность;</p> <p>Уметь: У-1 - выделять этапы жизненного цикла продукции и услуги для применения в системах менеджмента качества;</p> <p>Владеть: - В.1 - способностью применять знание этапов жизненного цикла продукции или услуги в практике управления.</p>

4. Объем, структура и содержание дисциплины в зачетных единицах с указанием количества академических/астрономических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам занятий) и на самостоятельную работу обучающихся

4.1 Объем дисциплины

Таблица 4 – Трудоемкость дисциплины

Объем дисциплины	Всего часов
Объем дисциплины	Всего акад./ астр часов
Всего зачетных единиц	4
Всего академических/астрономических часов учебных занятий	144/108
В том числе:	
контактная работа обучающихся с преподавателем	66

1. По видам учебных занятий:		
Теоретические занятия - занятия лекционного типа		34
Занятия семинарского типа		32
Лабораторные работы		-
2. Промежуточной аттестации обучающегося - экзамен		6
Самостоятельная работа обучающихся:		72
Подготовка к контрольным работам		
Выполнение творческих заданий		
Курсовое проектирование		-
Подготовка к экзамену		6

4.2. Структура дисциплины

Таблица 5 – Структура дисциплины

№ п/п	Раздел дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Всего	Виды учебной работы, включая самостоятельную работу обучающихся и трудоемкость (в часах ауд/астр)			Вид контроля*
					Лекции	Практ. зан.	СРС	
1	Тема 1. Выпуск банками эмиссионных ценных бумаг	7		34	8	8	18	Входной контроль Текущий контроль
2	Тема 2. Выпуск банками сберегательных (депозитных) сертификатов.	7		34	8	8	18	Рубежный контроль Текущий контроль
3	Тема 3. Формирование портфеля ценных бумаг.	7		34	8	8	18	Рубежный контроль Текущий контроль
4	Тема 4. Порядок проведения активных операций с ценными бумагами.	7		36	10	8	18	Рубежный контроль Текущий контроль
Экзамен							6	Промежуточная аттестация
Всего				144	34	32	72	

4.3. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам)

4.3.1. Теоретические занятия - занятия лекционного типа

Таблица 6 – Содержание лекционного курса

№ п/п	Наименование раздела (модуля) дисциплины, темы	Содержание	Кол-во часов	Виды занятий: по дидактическим задачам/ по способу изложения учебного материала	Оценочное средство*	Формируемый результат**
1.	Тема 1. Выпуск банками эмиссионных ценных бумаг	Ценные бумаги: классификация, цели выпуска, сравнительная характеристика процедуры выпуска. Нормативно-правовое регулирование деятельности организаций по выпуску эмиссионных ценных бумаг. Объявленные и размещённые акции. Права и обязанности акционеров. Этапы процедуры выпуска эмиссионных ценных бумаг. Виды решений о размещении эмиссионных ценных бумаг и их реквизиты. Содержание решения о выпуске ценных бумаг. Содержание проспекта ценных бумаг. Порядок регистрации выпуска ценных бумаг. Порядок расчёта суммы дивидендов по акциям. Размеры и порядок выплаты доходов по облигациям. Порядок обращения и погашения облигаций банка.	8	Тематическая лекция / лекция – дискуссия / лекция – визуализация	устный опрос	3.1 основные понятия, используемые в отечественной и зарубежной статистике; структуру социально-экономических показателей;
2	Тема 2. Выпуск банками сберегательных (деPOSITных) сертификатов.	Сберегательный (деPOSITный) сертификат: понятие, виды, сроки обращения. Требования к оформлению сертификата. Порядок оформления перехода прав (цессии) по сберегательным и депозитным сертификатам. Содержание и порядок регистрации условий выпуска и обращения сберегательных (деPOSITных) сертификатов	8	Тематическая лекция / лекция – дискуссия / лекция – визуализация	устный опрос	3.2- тенденции изменений, происходящие в системе социально-экономических показателей;
3	Тема 3. Формирование портфеля ценных бумаг.	Инвестиционные операции: понятие, назначение. Виды инвестиций. Типы инвестиционной политики. Прямые и портфельные инвестиции. Портфель ценных бумаг: понятие и типы. Факторы, определяющие структуру портфеля ценных бумаг (ликвидность, доходность,	8	Тематическая лекция / лекция – дискуссия / лекция – визуализация	устный опрос	3.3 - состав основных показателей отечественной и зарубежной

		рискованность, порядок налогообложения)				статистики.
4	Тема 4. Порядок проведения активных операций с ценными бумагами.	Порядок совершения операций по приобретению и реализации ценных бумаг на неорганизованном рынке ценных бумаг. Порядок совершения операций купли/продажи ценных бумаг на организованном рынке ценных бумаг через брокера.	10	Тематическая лекция / лекция – дискуссия / лекция – визуализация	устный опрос	3.3 - состав основных показателей отечественной и зарубежной статистики.
Всего			34			

4.3.2. Занятия семинарского типа (практические занятия)

Таблица 7 – Содержание практического (семинарского) курса

№ п/п	Темы практических занятий.	Кол-во часов	Форма проведения занятия	Оценочное средство*	Формируемый результат**
1	Ценные бумаги: классификация, цели выпуска, сравнительная характеристика процедуры выпуска. Нормативно-правовое регулирование деятельности организаций по выпуску эмиссионных ценных бумаг. Объявленные и размещённые акции. Права и обязанности акционеров. Этапы процедуры выпуска эмиссионных ценных бумаг. Виды решений о размещении эмиссионных ценных бумаг и их реквизиты. Содержание решения о выпуске ценных бумаг. Содержание проспекта ценных бумаг. Порядок регистрации выпуска ценных бумаг. Порядок расчёта суммы дивидендов по акциям. Размеры и порядок выплаты доходов по облигациям. Порядок обращения и погашения облигаций банка.	8	коллоквиум	Устный опрос	У.1 - корректно применять знания о статистике как о системе обобщающей различные формы социальной практики; формулировать и логично аргументировать исчисленные показатели статистики
2	Сберегательный (депозитный) сертификат: понятие, виды, сроки обращения. Требования к оформлению сертификата. Порядок оформления перехода прав (цессии) по сберегательным и депозитным сертификатам	8	коллоквиум	Устный опрос	У.1 - корректно применять знания о статистике как о системе обобщающей различные формы социальной практики;

					формулировать и логично аргументировать исчисленные показатели статистики;
3	Содержание и порядок регистрации условий выпуска и обращения сберегательных (деPOSITных) сертификатов	8	коллоквиум	Устный опрос	У.2 - самостоятельно анализировать различные статистические показатели, влияющие на социально-экономические процессы развития общества;
4	Инвестиционные операции: понятие, назначение. Виды инвестиций. Типы инвестиционной политики. Прямые и портфельные инвестиции. Портфель ценных бумаг: понятие и типы. Факторы, определяющие структуру портфеля ценных бумаг (ликвидность, доходность, рискованность, порядок налогообложения)	2		Устный опрос	У.3 - выявлять тенденции, связанные с изменениями социально-экономических показателей; формулировать основные тенденции социально-экономических показателей.
Всего		32			

4.3.3. Самостоятельная работа

Таблица 4 - Объем (трудоемкость освоения) и формы СРС

№	Вид (содержание) СРС	Количество часов	Форма контроля, аттестации
1.	Освоение теоретического учебного материала (в т.ч. подготовка к практическим занятиям)	72	Текущий контроль: • тесты * • контроль на ПЗ
2.	Подготовка к экзамену	6	Текущий контроль: Защита контрольной работы* Экзамен
Итого		78	

5. Перечень образовательных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости)

При реализации различных видов учебной работы по дисциплине «Рынок ценных бумаг» используются следующие образовательные технологии:

1) Технологии проблемного обучения: проблемная лекция, практическое занятие в форме практикума, практическое занятие на основе кейс-метода.

2) Интерактивные технологии: Лекция «обратной связи» (лекция – дискуссия)

3) Информационно-коммуникационные образовательные технологии: Лекция-визуализация

4) Инновационные методы, которые предполагают применение информационных образовательных технологий, а также учебно-методических материалов, соответствующих современному мировому уровню, в процессе преподавания дисциплины:

- использование медиаресурсов, энциклопедий, электронных библиотек и Интернет;
- решение юридических, экономических (других) задач с применением справочных систем «Гарант», «Консультант +»;
- консультирование студентов с использованием электронной почты;
- использование программно-педагогических тестовых заданий для проверки знаний обучающихся.

Программное обеспечение:

1. <https://www.rambler.ru/> - Поисковая система
2. <https://www.yandex.ru/> - Поисковая система
3. <https://www.mail.ru/> - Поисковая система
4. <https://www.google.com/> - Поисковая система
5. <https://www.opera.com/> - Поисковая система
6. Комплект офисных приложений MS OFFICE

Информационные справочные системы:

1. Справочная информационно-правовая система «Гарант».
2. Справочная информационно-правовая система «КонсультантПлюс».

6. Фонд оценочных средств для проведения входного, текущего, рубежного контроля и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

Типовые задания, база тестов и иные материалы, необходимые для оценки результатов освоения дисциплины (в т.ч. в процессе ее освоения), а также методические материалы,

определяющие процедуры этой оценки приводятся в приложении 1 к рабочей программе дисциплины

Универсальная система оценивания результатов обучения выполняется в соответствии с Положением о текущем контроле и включает в себя системы оценок:

- 1) «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно»;

7. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

7.1. Основная учебная литература

Николаева, И.П. Рынок ценных бумаг / И.П. Николаева. – Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2018. – 255 с. : ил. – (Учебные издания для бакалавров). – Режим доступа: по подписке. – URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=495805>

7.2. Дополнительная литература

Газалиев, М.М. Рынок ценных бумаг / М.М. Газалиев, В.А. Осипов. – Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2018. – 160 с. : ил. – (Учебные издания для бакалавров). – Режим доступа: по подписке. – URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=495766>

8. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (далее - сеть «Интернет»), необходимых для освоения дисциплины

1. <http://bankir.ru/> - Информационное агентство Bankir.Ru
2. <http://bankir.ru/> Агентство Bankir.Ru
3. <http://biblioclub.ru/> - электронно-библиотечная система «Университетская библиотека ONLINE».
4. <http://cbr.ru/> - Официальный сайт Банка России
5. <http://finvector.ru/> Научно-практический журнал «Банковские услуги»
6. <http://lib.usue.ru> – Информационно библиотечный комплекс
7. <http://www.bbdoc.ru/> - Библиотека банковского дела
8. <http://www.eLIBRARY.RU> - научная электронная библиотека
9. <http://www.knigafund.ru> -Электронная библиотека студента «КнигаФонд»

9. Требования к минимальному материально-техническому обеспечению, необходимого для осуществления образовательного процесса по дисциплине

Для изучения дисциплины используется мультимедийная аудитория, вместимостью более 25 человек. Мультимедийная аудитория оснащена современными средствами воспроизведения и визуализации любой видео и аудио информации, получения и передачи электронных документов.

Типовая комплектация мультимедийной аудитории состоит из: мультимедийного проектора, проекционного экрана, акустической системы, персонального компьютера (с техническими характеристиками не ниже: процессор - 300 MHz, оперативная память - 128 Мб), интерфейсы подключения: USB, audio, HDMI. Преподаватель имеет возможность легко управлять всей системой, что позволяет проводить лекции, практические занятия, презентации, вебинары, конференции и другие виды аудиторной нагрузки обучающихся в удобной и доступной для них форме с применением современных интерактивных средств обучения, в том числе с использованием в процессе обучения всех корпоративных ресурсов. Мультимедийная аудитория также оснащена широкополосным доступом в сеть интернет. Компьютерное оборудование имеет соответствующее лицензионное программное обеспечение. Учебно-методическая литература для данной дисциплины имеется в наличии в электронно-библиотечной системе «Университетская библиотека ONLINE», доступ к которой предоставлен обучающимся. Электронно-библиотечная система «Университетская

библиотека ONLINE» реализует легальное хранение, распространение и защиту цифрового контента учебно-методической литературы для вузов с условием обязательного соблюдения авторских и смежных прав. Электронно-библиотечная система «Университетская библиотека ONLINE» обеспечивает широкий законный доступ к необходимым для образовательного процесса изданиям с использованием инновационных технологий и соответствует всем требованиям ФГОС СПО.

**ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА И МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ
ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ
РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ
(Б1.В.ОД.13)**

По направлению подготовки	38.03.01 Экономика
Направленность подготовки	Финансы и кредит
Квалификация (степень) выпускника (уровень направления подготовки)	бакалавр
Форма обучения	очная

Рабочий учебный план по
направлению подготовки (одобрен
Ученым советом Протокол № 05/19 от
29 октября 2019г.)

6.1. Оценочные средства по итогам освоения дисциплины

6.1.1. Цель оценочных средств

Целью оценочных средств является установление соответствия уровня подготовленности обучающегося на данном этапе обучения требованиям рабочей программы по дисциплине «Рынок ценных бумаг».

Оценочные средства предназначены для контроля и оценки образовательных достижений обучающихся, освоивших программу учебной дисциплины «Рынок ценных бумаг». Перечень видов оценочных средств соответствует рабочей программе дисциплины.

Комплект оценочных средств включает контрольные материалы для проведения всех видов контроля в форме устного опроса, практических занятий, и промежуточной аттестации в форме вопросов и заданий к зачету.

Структура и содержание заданий – задания разработаны в соответствии с рабочей программой дисциплины «Рынок ценных бумаг».

6.1.2. Объекты оценивания – результаты освоения дисциплины

Объектом оценивания является способность выявлять и формировать знания о правовых основах противодействия коррупции.

Результатами освоения дисциплины являются:

Знать

3.1 основные понятия, используемые в отечественной и зарубежной статистике; структуру социально-экономических показателей;

3.2- тенденции изменений, происходящие в системе социально-экономических показателей;

3.3 - состав основных показателей отечественной и зарубежной статистики.

Уметь:

У.1 - корректно применять знания о статистике как о системе обобщающей различные формы социальной практики; формулировать и логично аргументировать исчисленные показатели статистики;

У.2 - самостоятельно анализировать различные статистические показатели, влияющие на социально-экономические процессы развития общества;

У.3 - выявлять тенденции, связанные с изменениями социально-экономических показателей; формулировать основные тенденции социально-экономических показателей.

Владеть:

способностями интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики; способами анализа статистической обработки социально-экономических показателей; методами обобщения анализа после обработки статистических показателей и возможностью их преподнести в виде отчета или доклада.

Таблица 1 - Перечень компетенций, формируемых в процессе освоения дисциплины (модуля) с указанием этапов их формирования

Темы занятий	Перечень контролируемой компетенции (или ее части)		Планируемые результаты освоения дисциплины*	Наименование оценочного средства			
	код	Содержание компетенции		входной	текущий	периодический	итоговый
Тема 1. Выпуск банками эмиссионных ценных бумаг	ПК -6	Способность анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей		Собеседование	УО		
					УО		
Тема 2. Выпуск	ПК -6	Способность			УО		

банками сберегательных (депозитных) сертификатов.		анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей					
Тема 3. Общая теория институтов	ПК -6	Способность анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей			УО		
					УО		
Тема 4. Теория транзакционных издержек.	ПК -6	Способность анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей			УО	Т	
					УО		

6.1.3. Формы контроля и оценки результатов освоения

Контроль и оценка результатов освоения – это выявление, измерение и оценивание знаний, умений и уровня владений формирующихся компетенций в рамках освоения дисциплины. В соответствии с учебным планом и рабочей программой дисциплины «Рынок ценных бумаг» предусматривается входной, текущий, периодический и итоговый контроль результатов освоения.

6.1.4. Примерные (типовые) контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, владений (или опыта деятельности), в процессе освоения дисциплины (модуля, практики), характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения дисциплины

Примерные (типовые) контрольные задания или иные материалы для проведения входного контроля

Примерные вопросы собеседования (устного опроса) для оценки подготовки к формированию компетенций.

Перечень тем эссе:

- Портфель роста.
- Портфель дохода.
- Комбинированный портфель.
- Агрессивный портфель.

- Умеренный портфель.
- Консервативный портфель.
- Выбор оптимального типа портфеля.
- Оценка приемлемого сочетания риска и дохода портфеля.
- Определение количественного и первоначального состава портфеля.
- Выбор схемы управления портфелем.
- Организованный рынок.
- Неорганизованный рынок.
- Первичный рынок.
- Вторичный рынок.
- Биржевой рынок.
- Внебиржевой рынок.
- Кассовый рынок.
- Срочный рынок.
- Комиссии биржи.
- Изучение рынка с помощью анализа цены, объема и открытого интереса (объема

открытых

позиций).

- Систематический риск.
- Селективный риск.
- Риск ликвидности.
- Кредитный риск.
- Инфляционный риск.
- Отзывной риск.
- Систематический анализ доходности по разным видам ценных бумаг.
- Оценка степени возникающего риска.
- Своевременный мониторинг портфеля ценных бумаг.

Перечень тем контрольных работ:

- Создание крупных фондов денежных средств.
- Формирование системы процентных ставок в экономике.
- Особенности применения индикаторов финансового рынка на российском и мировом

финансовых рынках.

- Органы регулирования и контроля российского и зарубежных фондовых рынков.
- Эмиссионные и неэмиссионные ценные бумаги.
- Ценность и цена акции.
- Дивидендная политика акционерного общества в кризисный и посткризисный период.

- Рейтинги облигаций и других видов ценных бумаг.
- Временная стоимость опциона.
- Опционные стратегии на российском и зарубежных фондовых рынках.
- Срочные форвардные сделки. Пролонгационные сделки.
- Виды спрэдов и условия их использования.
- Игры на повышение и понижение курса акций.
- выбор оптимального типа инвестиционного портфеля.
- Оценка приемлемого сочетания риска и дохода инвестиционного портфеля.
- Модель Гарри Марковица.
- Индексная модель Шарпа
- Алгоритм Марковица-Тобина.
- Алгоритмы Элтона-Груббера-Падберга.
- Трансформация сегментов рынка ценных бумаг в современных условиях.
- Ретроспектива зарождения и развития ведущих фондовых бирж мира.

- Установление рыночного курса финансового актива.
- Организация торгов финансовыми активами между членами биржи.
- Аналитическая база подготовки и проведения биржевых операций.
- Методология и методика фундаментального анализа на рынке ценных бумаг.
- Методология и инструментарий технического анализа фондового рынка.
- Оценка различных видов рисков операций с ценными бумагами.

Перечень вопросов для подготовки к экзамену.

- Понятие и роль финансового рынка в рыночной экономике.
- Сегменты финансового рынка.
- Основные функции финансового рынка.
- Основные индикаторы финансового рынка (ИФР).
- Участники, выполняющие ключевые функции на финансовом рынке.
- Прямые участники финансового рынка: инвесторы и заемщики.
- Финансовые посредники: кредитные организации, финансовые институты, инвестиционные институты.
- Участники, выполняющие вспомогательные функции на финансовом рынке.
- Отличительные особенности правового статуса и характера деятельности финансовых посредников на финансовом рынке России.
- Финансовый брокер и финансовый дилер.
- Депозитарная и расчетно-клиринговая деятельность в России и за рубежом.
- Понятие и основные характеристики современной ценной бумаги.
- Классификация ценных бумаг.
- Акция. Классификация видов акций.
- Способы и этапы эмиссии акций.
- Размещение и оплата акций. Организация и проведение первоначального публичного предложения акций (ИПО).
- Виды цен акции. Расчеты курсовой стоимости акции.
- Дивиденды и дивидендная политика акционерного общества.
- Облигация. Классификация видов облигаций.
- Номинальная стоимость облигации. Курс облигации. Рыночная цена облигации.
- Текущая доходность облигации. Полная доходность облигации к погашению.
- Вексель. Виды векселей.
- Расчет дохода по простому векселю.
- Учет векселей.
- Сертификат.
- Складское свидетельство.
- Коносамент.
- Жилищный сертификат.
- Понятие и классификация производных финансовых инструментов на фондовом рынке.
- Опционы.
- Оценка стоимости опционов.
- Основные опционные стратегии.
- Фьючерс. Особенности фьючерсного контракта по сравнению с опционом. Расчет стоимости фьючерсного контракта.
- Депозитарные расписки.
- Сущность и классификация сделок с ценными бумагами.
- Кассовые сделки. Срочные сделки.
- Сделки с залогом. Сделки с премией.
- Опционные сделки.
- Фьючерсные сделки.
- Стеллажные сделки.
- Игры на повышение курса акций. Игры на понижение курса акций.

- Понятие, основная цель и задачи формирования инвестиционного портфеля.
- Классификация портфелей ценных бумаг.
- Принципы формирования инвестиционного портфеля.
- Этапы формирования портфеля ценных бумаг.
- Доходность ценных бумаг. Модель Гарри Марковица. Ожидаемая доходность. Стандартное отклонение (мера риска).
- Статистические методы определения доходности инвестиционного портфеля.
- Выбор состава оптимального портфеля ценных бумаг. Определение риска ценной бумаги и риска инвестиционного портфеля.
- Сущность рынка ценных бумаг и его место в системе финансовых рынков.
- Правовое регулирование и особенности российского рынка ценных бумаг.
- Структура рынка ценных бумаг.
- Инфраструктура рынка ценных бумаг.
- Внебиржевая торговля.
- Регистраторы (реестродержатели).
- Депозитарии.
- Торговые системы на фондовом рынке.
- Расчетно-клиринговые системы на рынке ценных бумаг.
- Сегменты рынка ценных бумаг.
- Понятие фондовой биржи. Фондовые биржи в России.
- Функции фондовой биржи.
- Биржевые индексы. Ведущие мировые биржевые индексы. Российские биржевые индексы.
- Организационная структура фондовой биржи. Комиссии биржи.
- Понятие и уровни фундаментального анализа.
- Технический анализ.
- Риски операций с ценными бумагами.
- Мероприятия по предотвращению риска операций с ценными бумагами.

6.3. Методические материалы по освоению дисциплины

Методические указания для обучающихся по изучению дисциплины «Управленческий учет и владельческий контроль»

Дисциплина «Управленческий учет и владельческий контроль» считается освоенной обучающимся, если он имеет положительные результаты промежуточного, текущего и итогового контроля. Это означает, что обучающийся освоил необходимый уровень теоретических знаний в области деятельности по организации предпринимательской деятельности и овладел навыками осуществления данной деятельности.

Контактная и самостоятельная работа осуществляется обучающимся в соответствии с учебным планом, календарным учебным графиком и рабочей программой дисциплины.

Контактная работа предусматривает взаимодействие обучающегося с преподавателем в электронной информационно-образовательной среде института:

- лекции и практические/семинарские занятия,
- индивидуальные консультации преподавателя, по возникающим у обучающегося вопросам в процессе освоения учебного материала дисциплины

Для достижения вышеуказанного обучающийся должен соблюдать следующие правила, позволяющие освоить дисциплину на высоком уровне:

1. Начало освоения курса должно быть связано с изучением всех компонентов рабочей программы дисциплины с целью понимания ее содержания и указаний, которые будут доведены до сведения обучающегося на первой лекции и первом семинарском занятии. Это связано с:

- установлением сроков и контроля выполнения индивидуального задания каждым обучающимся;

- распределением тем докладов, контрольных работ (в соответствии с учебным планом) и сроки их представления;
- критериями оценки текущей и самостоятельной работы обучающегося (устного опроса, фронтального опроса, индивидуального задания, работы на семинарских/практических занятиях, тестирования - рубежного контроля).

Перед началом курса обучающемуся целесообразно ознакомиться со структурой дисциплины на основании программы, а также с последовательностью изучения тем и их объемом. С целью оптимальной самоорганизации необходимо сопоставить эту информацию с расписанием учебных занятий и выявить наиболее затратные по времени и объему темы, чтобы заранее определить для себя периоды объемных заданий.

2. Каждая тема содержит лекционный материал, список литературы для самостоятельного изучения, вопросы и задания для подготовки к семинарским и/или практическим занятиям, а также материалы для самостоятельной работы. Необходимо заранее обеспечить себя этими материалами и литературой или доступом к ним.

3. Лекционный материал и указанные литературные источники по пройденной теме необходимо изучить перед посещением следующего лекционного занятия. Это позволяет закрепить прослушанный материал лекции и проверить правильное понимание материала при ответах на вопросы, заданные лектором в начале лекции по пройденному ранее материалу.

4. Семинарское и/или практическое занятие, как правило, начинается с фронтального опроса по лекционному материалу темы и материалам указанных к теме литературных источников. В связи с этим подготовка к семинарскому/практическому занятию заключается в повторении лекционного материала и изучении вопросов предстоящего занятия.

5. В конце изучения каждого раздела обучающийся проходит тестирование - рубежный контроль.

6. Оформление всех видов письменных работ регламентируется соответствующими требованиями установленными в институте.

7. Успешное прохождение промежуточной аттестации предусматривает выполнение правил 1 – 6.

Методические указания освоению лекционного материала

Лекционный материал и указанные литературные источники по соответствующей теме необходимо изучить перед посещением соответствующего лекционного занятия, так как лекция в аудитории предполагает раскрытие актуальных и проблемных вопросов рассматриваемой темы, а не содержания лекционного материала. Таким образом, для понимания того, что будет сказано на лекции, необходимо получить базовые знания по теме, которые содержатся в лекционном материале.

При возникновении затруднений с пониманием материала занятия обучающийся должен обратиться с вопросом к лектору или преподавателю, ведущему семинарские/практические занятия, для получения соответствующих разъяснений в отведенное для этого преподавателем время на занятии либо по электронной почте. В интересах обучающегося своевременно довести до сведения преподавателя информацию о своих затруднениях в освоении предмета и получить необходимые разъяснения, так как говорить об этом после получения низкой оценки при опросе или по результатам контрольной работы не имеет смысла.

Методические указания по подготовке обучающихся к лекционным занятиям

Лекционное занятие, как правило, начинается с устного опроса по пройденной теме. Поэтому обучающемуся необходимо просматривать конспект сразу после занятий. Отметить тот материал конспекта лекций, который вызывает затруднения для понимания. Попытаться найти ответы на затруднительные вопросы, используя предлагаемую литературу. Если самостоятельно не удалось разобраться в материале, необходимо сформулировать вопросы и

обратиться на текущей консультации или на ближайшей лекции за помощью к преподавателю.

Методические указания по подготовке обучающихся к семинарским занятиям

Для успешного усвоения дисциплины обучающийся должен систематически готовиться к семинарским/практическим занятиям в течение семестра. Для этого необходимо:

- познакомиться с планом семинарского/практического занятия;
- изучить соответствующие вопросы в конспекте лекций для подготовки к фронтальному опросу на семинарском/практическом занятии;
- ответить на вопросы, вынесенные на обсуждение;
- систематически выполнять задания преподавателя, предлагаемые для выполнения во внеаудиторное время.

В ходе семинарских/практических занятий обучающиеся под руководством преподавателя могут рассмотреть различные точки зрения специалистов по обсуждаемым проблемам. Продолжительность подготовки к семинарскому/практическому занятию должна составлять не менее того объема, что определено п.4.3 рабочей программы,

Семинарские занятия могут проводиться в различных формах:

- устные ответы на вопросы преподавателя по теме семинарского/практического занятия;
- письменные ответы на вопросы преподавателя;
- групповое обсуждение той или иной проблемы под руководством и контролем преподавателя;
- заслушивания и обсуждение докладов на круглом столе;

Подготовка к семинарским занятиям должна носить систематический характер. Это позволит обучающемуся в полном объеме выполнить все требования преподавателя. Для получения более глубоких знаний обучающимся рекомендуется изучать дополнительную литературу (список приведен в рабочей программе по дисциплине).

Одним из важных показателей активности обучающегося в освоении дисциплины является подготовка по аспектам теории или практики изучаемой дисциплины в соответствии с предлагаемой тематикой. Один доклад готовят один-два обучающихся. Доклад должен содержать суть рассматриваемого аспекта, причину необходимости рассмотрения, описание существующих или возникающих для данного аспекта проблем предлагаемые пути их решения.

Доклад должен быть оформлен на бумажном носителе с указанием использованных литературных источников. Доклад и материалы презентации должны быть сданы преподавателю. При невыполнении этого условия за доклад выставляется оценка «неудовлетворительно». Продолжительность доклада не более 10 минут. Докладчики один или оба должны выступить. Представленный материал обсуждается на занятии обучающимися. Это означает, что подготовка каждого обучающегося к такому занятию будет заключаться в изучении темы, предлагаемой к обсуждению, и подготовке вопросов, которые он задаст докладчикам. При подготовке таких вопросов необходимо иметь в виду, что в докладе прозвучат основные аспекты и проблемы, поэтому поверхностные вопросы, связанные с уточнением понятийного аппарата, перечислением функций и т.п. (если это не является сутью обсуждаемой проблемы) будут оцениваться неудовлетворительно.

Преподаватель оценивает на занятии вопросы и ответы. Таким образом, по результатам занятия все обучающиеся группы имеют оценки, выставляемые в журнал. Отсутствие вопроса у обучающегося свидетельствует о его неподготовленности к занятию и получением неудовлетворительной оценки.

Методические указания по организации самостоятельной работы обучающихся

Внеаудиторная самостоятельная работа обучающийся (далее самостоятельная работа обучающийся) - планируемая учебная, учебно-исследовательская, научно-исследовательская

работа обучающийся, выполняемая во внеаудиторное время по заданию и при методическом руководстве преподавателя, но без его непосредственного участия.

Цель самостоятельной работы обучающихся - научить осмысленно и самостоятельно работать сначала с учебным материалом, затем с научной информацией, заложить основы самоорганизации и самовоспитания с тем, чтобы привить умение в дальнейшем непрерывно повышать свою квалификацию.

Самостоятельная работа обучающихся способствует развитию самостоятельности, ответственности и организованности, творческого подхода к решению различных проблем.

Объем самостоятельной работы обучающихся определяется ФГОС и обозначен в тематическом плане рабочей программы (п. 4.1 данной рабочей программы). Самостоятельная работа обучающихся является обязательной для каждого обучающегося и определяется учебным планом по направлению. Для успешной организации самостоятельной работы необходимы следующие условия:

- готовность обучающихся к самостоятельной работе по данной дисциплине и высокая мотивация к получению знаний;
- наличие и доступность необходимого учебно-методического и справочного материала;
- регулярный контроль качества выполненной самостоятельной работы;
- консультационная помощь преподавателя.

При изучении каждой дисциплины организация самостоятельной работы должна представлять единство трех взаимосвязанных форм:

1. Внеаудиторная самостоятельная работа;
2. Аудиторная самостоятельная работа, которая осуществляется под непосредственным руководством преподавателя;
3. Творческая, в том числе научно-исследовательская работа.

Виды внеаудиторной самостоятельной работы обучающихся:

- изучение учебной, учебно-методической литературы и иных источников по темам; подготовка вопросов преподавателю по дисциплине в в период контактной работы (лекции, семинары/практические занятия, групповые и индивидуальной консультации);
- подготовка и написание контрольных работ (в соответствии с учебным планом);
- подготовка и написание курсовых работ (в соответствии с учебным планом) и ее корректировка в соответствии с замечаниями рецензента;
- подготовка и написание рефератов, докладов;
- подбор и изучение литературных источников;
- поиск и анализ информации по заданной теме;
- анализ научной статьи;
- анализ статистических данных по изучаемой теме;
- подготовка к участию в научно-практических конференциях с докладами по темам изучаемой дисциплины, смотрах, олимпиадах и др.

Виды аудиторной самостоятельной работы:

- во время лекции обучающиеся могут выполнять самостоятельно небольшие задания: решать несложные задачи, приводить примеры, дополнять классификации и т.д.;
- на семинарских занятиях обучающиеся самостоятельно решают творческие задачи, кейс-ситуации, заполняют таблицы, конспектируют главное из выступлений других обучающихся, выполняют тестовые задания и т.д.

Вид творческой самостоятельной работы:

- обучающийся может выбрать тему, связанную с вопросами изучаемой дисциплины и подготовить выступление на конференцию;
- обучающийся может выбрать заинтересовавшую его тему и развивать ее во время прохождения практики, в дальнейшем в курсовых и выпускной квалификационной работе.

Оценка освоения обучающимся учебной дисциплины в течение закрепленного учебным планом периода осуществляется в процессе текущего контроля.

Текущий контроль осуществляется в следующих формах:

- фиксация участия в устных и фронтальных опросах;
- оценка качества выполнения иллюстративного материала и устного доклада;
- оценка качества работы при решении практических задач, кейс-ситуаций.
- контроль и фиксация прохождения тестирования в целях самопроверки.
- проверка ответов на вопросы рубежного контроля;
- проверка письменных контрольных заданий.

Виды заданий для самостоятельной работы изложены в п.4 настоящей программы, а содержание заданий для самостоятельной работы в форме текущего контроля по дисциплине представлены там же в п. 6.2.

Все виды активности преподаватель фиксирует в течение установочно-экзаменационной сессии и обязательно учитывает при оценке знаний обучающегося по данной дисциплине.

Методические указания по подготовке к промежуточной аттестации

Подготовка к экзамену является заключительным этапом изучения дисциплины.

При подготовке к промежуточной аттестации особое внимание следует обратить на следующие моменты:

- выучить определения всех основных понятий.
- проверить свои знания с помощью примерных тестовых заданий.

Содержание тестов находится в доступном режиме с начала изучения дисциплины. В связи с этим целесообразно изучать тесты по каждой теме вместе с подготовкой к соответствующему текущему занятию. Кроме того, необходимо помнить, что часть тестовой базы (не более 10%) непосредственно перед промежуточной аттестацией может быть дополнена или изменена. В связи с этим целесообразно изучать не только тесты, выносимые на экзамен, но и иные вопросы, рассматриваемые на лекциях и занятиях. Эти изменения, как правило, доводятся до сведения обучающихся на консультации перед экзаменом. В процессе подготовки к экзамену выявляются вопросы, по которым нет уверенности в ответе либо ответ обучающемуся не ясен. На консультации это можно прояснить, поэтому непосещение консультации может негативно отразиться на результатах экзамена. На консультации также необходимо уточнить сущность правильного ответа на так называемые «открытые» тесты, то есть те в которых не представлены варианты ответов: единицы измерения, вариант округления и т.п. и иные вопросы по организации и проведению экзамена.