

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего  
образования

«САНКТ-ПЕТЕРБУРГСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ  
АЭРОКОСМИЧЕСКОГО ПРИБОРОСТРОЕНИЯ»

---

Кафедра №82

«УТВЕРЖДАЮ»

Руководитель направления

д.э.н., проф.

(должность, уч. степень, звание)

А.В. Самойлов

(подпись)

«31» \_\_ августа 2021г

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

«Рынок ценных бумаг»

(Название дисциплины)

Код направления	38.05.01
Наименование направления/ специальности	Экономическая безопасность
Наименование направленности	Финансовый учет и контроль в правоохранительных органах
Форма обучения	очная

Санкт-Петербург 2021\_г.

## Лист согласования рабочей программы дисциплины

Программу составил(а)

доц.,к.э.н.,доц.

должность, уч. степень, звание

  
\_\_\_\_\_

27.08.2021

подпись, дата

Л.Г. Фетисова

инициалы, фамилия

Программа одобрена на заседании кафедры № 82

«30»\_\_08\_\_2021г, протокол № \_\_\_\_1\_\_\_\_

Заведующий кафедрой № 82

проф.,д.э.н.,проф.

должность, уч. степень, звание

  
\_\_\_\_\_

30.08.2021г.

подпись, дата

А.С. Будагов

инициалы, фамилия

Ответственный за ОП 38.05.01(05)

доц.,к.э.н.,доц.

должность, уч. степень, звание

  
\_\_\_\_\_

30.08.2021г.

подпись, дата

Н.Г. Лашкова

инициалы, фамилия

Заместитель директора института (факультета) № 8 по методической работе

доц.,к.э.н.,доц.

должность, уч. степень, звание

  
\_\_\_\_\_

30.08.2021г.

подпись, дата

Л.Г. Фетисова

инициалы, фамилия

## Аннотация

Дисциплина «Рынок ценных бумаг» входит в базовую часть образовательной программы подготовки обучающихся по специальности «38.05.01 «Экономическая безопасность» направленность «Финансовый учет и контроль в правоохранительных органах». Дисциплина реализуется кафедрой №82.

Дисциплина нацелена на формирование у выпускника

профессиональных компетенций:

ПК-24 «способность оценивать эффективность формирования и использования государственных и муниципальных финансовых ресурсов, выявлять и пресекать нарушения в сфере государственных и муниципальных финансов»,

ПК-29 «способность выбирать инструментальные средства для обработки финансовой, бухгалтерской и иной экономической информации и обосновывать свой выбор»,

ПК-40 «способность осуществлять экспертную оценку факторов риска, способных создавать социально-экономические ситуации критического характера, оценивать возможные экономические потери в случае нарушения экономической и финансовой безопасности, определять необходимые компенсационные резервы».

Содержание дисциплины охватывает круг вопросов, связанных с основополагающими вопросами рынка ценных бумаг, даются фундаментальные понятия фондового рынка, рассматриваются все виды ценных бумаг, обращающихся на российском рынке ценных бумаг, анализируется поведение эмитента и инвестора на рынке, а также функционирование организованных форм фондового рынка (фондовая биржа, внебиржевые системы).

Преподавание дисциплины предусматривает следующие формы организации учебного процесса: лекции, практические занятия, самостоятельная работа студента, консультации

Программой дисциплины предусмотрены следующие виды контроля: текущий контроль успеваемости, промежуточная аттестация в форме зачета.

Общая трудоемкость освоения дисциплины составляет 4 зачетных единицы, 144 часа.

Язык обучения по дисциплине «русский».

## 1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине

### 1.1. Цели преподавания дисциплины

Целью преподавания дисциплины «Рынок ценных бумаг» является формирование у студентов современных знаний в области экономического содержания различных видов ценных бумаг, механизма работы фондовой биржи и получение навыков по формированию и управлению портфелем ценных бумаг.

### 1.2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения ОП

В результате освоения дисциплины обучающийся должен обладать следующими компетенциями:

ПК-24 «способность оценивать эффективность формирования и использования государственных и муниципальных финансовых ресурсов, выявлять и пресекать нарушения в сфере государственных и муниципальных финансов:

знать - актуальные проблемы политики фондовой торговли;

уметь - систематизировать информацию по экономическому содержанию и видам биржевых товаров;

владеть навыками - методики качественного анализа оценки операций с ценными бумагами;

иметь опыт деятельности - по использованию знаний об организации и методах работы на биржевых рынках на предприятиях различных форм собственности;

ПК-29 «способность выбирать инструментальные средства для обработки финансовой, бухгалтерской и иной экономической информации и обосновывать свой выбор»:

знать - нормативную базу и механизм сделок и операций на данном сегменте рынка;

уметь - принимать решения на рынках ценных бумаг для оценки инвестиционной привлекательности финансовых инструментов;

владеть навыками - аналитической оценки экономической ситуации на фондовом рынке

иметь опыт деятельности по экономическому обоснованию принимаемых решений;

ПК-40 «способность осуществлять экспертную оценку факторов риска, способных создавать социально-экономические ситуации критического характера, оценивать возможные экономические потери в случае нарушения экономической и финансовой безопасности, определять необходимые компенсационные резервы»:

знать современную классификацию и характеристику биржевого товара;

уметь анализировать оперативно биржевую ситуацию и принципы организации биржевой торговли с учетом специфики отраслей и финансовой стратегии;

владеть навыками стоимостной оценки финансовых инструментов;

иметь опыт деятельности - деятельности по системному анализу принимаемых решений.

## 2. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина базируется на знаниях, ранее приобретенных студентами при изучении следующих дисциплин:

– Деньги, кредит, банки;

Знания, полученные при изучении материала данной дисциплины, имеют как самостоятельное значение, так и используются при изучении других дисциплин:

– Финансовая безопасность предприятия

– Финансовый менеджмент.

## 3. Объем дисциплины в ЗЕ/академ. час

Данные об общем объеме дисциплины, трудоемкости отдельных видов учебной работы по дисциплине (и распределение этой трудоемкости по семестрам) представлены в таблице 1

Таблица 1 – Объем и трудоемкость дисциплины

Вид учебной работы	Всего	Трудоемкость по семестрам
		№7
1	2	3
<b>Общая трудоемкость дисциплины, ЗЕ/(час)</b>	4/ 144	4/ 144
<i>Аудиторные занятия</i> , всего час., <i>В том числе</i>	51	51
лекции (Л), (час)	34	34
Практические/семинарские занятия (ПЗ), (час)	17	17
лабораторные работы (ЛР), (час)		
курсовой проект (работа) (КП, КР), (час)		
Экзамен, (час)		
<i>Самостоятельная работа</i> , всего	93	93
<b>Вид промежуточного контроля:</b> зачет, дифф. зачет, экзамен (Зачет, Дифф. зач, Экз.)	Дифф. Зач.	Дифф. Зач.

#### 4. Содержание дисциплины

##### 4.1. Распределение трудоемкости дисциплины по разделам и видам занятий

Разделы и темы дисциплины и их трудоемкость приведены в таблице 2.  
Таблица 2. – Разделы, темы дисциплины и их трудоемкость

Разделы, темы дисциплины	Лекции (час)	ПЗ (СЗ) (час)	ЛР (час)	КП (час)	СРС (час)
Семестр 7					
<b>Раздел 1. Фундаментальные понятия рынка ценных бумаг</b>					
Тема 1.1. Характеристика составляющих современного рынка ценных бумаг	4	2			16
Тема 1.2. Классификация рынков ценных бумаг	6	3			14
Тема 1.3. Сравнительный экономический анализ видов ценных бумаг	8	4			14
<b>Раздел 2. Профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг</b>					
Тема 2.1. Профессиональные участники рынка ценных бумаг	4	2			16
Тема 2.2. Виды сделок и операций с ценными бумагами	4	2			17
Тема 2.3. Проведение биржевых торгов и формирование итоговых биржевых индексов	8	4			16
Итого в семестре:	34	17			93
Итого:	34	17	0	0	93

#### 4.2. Содержание разделов и тем лекционных занятий

Содержание разделов и тем лекционных занятий приведено в таблице 3.

Таблица 3 - Содержание разделов и тем лекционных занятий

Номер раздела	Название и содержание разделов и тем лекционных занятий
1	<p><b>Раздел 1. Фундаментальные понятия рынка ценных бумаг</b></p> <p><b>Тема 1.1 Характеристика составляющих современного рынка ценных бумаг</b>  Схема организации рынка ценных бумаг. Понятие ценной бумаги. Эмиссионные ценные бумаги. Понятие и виды финансовых рисков, связанных с ценными бумагами. Фундаментальные свойства ценных бумаг. Сравнительная характеристика рынков различных видов ценных бумаг. Понятие рынка ценных бумаг, его сущность и функции в макро- и микроэкономике. Соотношение рынка ценных бумаг, кредитного рынка и бюджета в перераспределении денежных ресурсов.</p> <p><b>Тема 1.2. Классификация рынков ценных бумаг</b>  Виды рынков ценных бумаг. Международный, национальный и региональный</p>

	<p>рынки ценных бумаг. Развитые и формирующиеся рынки ценных бумаг. Мировая классификация фондовых рынков.</p> <p>Первичный и вторичный рынки ценных бумаг в российской и международной практике. Фундаментальные свойства первичного и вторичного рынков.</p> <p>Биржевой и внебиржевой рынки ценных бумаг в российской и международной практике.</p> <p>Классификация рынков по видам применяемых технологий. Прочие классификации рынков ценных бумаг.</p> <p><b>Тема 1.3. Сравнительный экономический анализ видов ценных бумаг</b></p> <p>Акции: понятие и развернутая характеристика. Простые и привилегированные акции. Разновидности простых акций, используемые в российской и международной практике. Разновидности привилегированных акций, используемые в российской и международной практике. Сертификаты акций. Производные ценные бумаги, связанные с акциями.</p> <p>Облигации: развернутая характеристика. Краткосрочные и долгосрочные долговые ценные бумаги. Облигации предприятий и их разновидности, используемые в российской и международной практике.</p> <p>Виды долговых обязательств государства. Государственные ценные бумаги РФ. Государственные ценные бумаги субъектов РФ. Ценные бумаги органов местного самоуправления. Внешние облигационные займы государства. Прочие государственные ценные бумаги.</p> <p>Понятие векселя. Классификация векселей. Простой и переводной вексель и основные понятия, связанные с ними. Развернутая характеристика векселя в качестве ценной бумаги. Цели и практика использования векселя в российской и зарубежной коммерческой практике</p> <p>Депозитные и сберегательные сертификаты банков: общее и особенности. Развернутая характеристика депозитных и сберегательных сертификатов в качестве ценных бумаг (в российской и международной практике).</p> <p>Чеки. Коносаменты. Варранты. Прочие ценные бумаги, не являющиеся производными.</p> <p>Производные ценные бумаги. Товарные фьючерсы и опционы. Финансовые фьючерсы и опционы, свопы. Основы спекулятивной игры на повышение-понижение с использованием производных ценных бумаг. Фьючерсы и опционы как инструмент хеджирования</p>
2	<p><b>Раздел 2. Профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг</b></p> <p><b>Тема 2.1. Профессиональные участники рынка ценных бумаг</b></p> <p>Понятие и виды профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг. Требования, предъявляемые к участникам рынка ценных бумаг, их организационно-правовые формы, учредители.</p> <p>Специфика выполняемых операций по отдельным видам профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг: брокерская и дилерская деятельность по управлению ценными бумагами; деятельность по определению взаимных обязательств (клиринг); депозитарная деятельность; деятельность по ведению реестра владельцев ценных бумаг; деятельность по организации торговли на рынке ценных бумаг. Процедура эмиссии: решение о выпуске, требования к проспекту и регистрация выпуска, размещение ценных бумаг и отчет об итогах выпуска.</p> <p><b>Тема 2.2. Виды сделок и операций с ценными бумагами</b> Вторичный рынок ценных бумаг. Понятие биржи и формы ее организации.</p> <p>Классификация сделок и операций с ценными бумагами: перечень видов, экономическое содержание.</p> <p>Виды операций на фондовой бирже. Кассовые, срочные, фьючерсные, стеллажные и опционные сделки. Участники биржевой торговли. Листинг. Экономические расчеты в процессе листинга.</p>

	<p><b>Тема 2.3. Проведение биржевых торгов и формирование итоговых биржевых индексов</b></p> <p>Спекулятивные операции и основы игры на курсах ценных бумаг. Запрещенные сделки (сделки, связанные с манипулированием ценами). Основные требования к сделкам по ценным бумагам и правила по их совершению. Типы биржевых приказов и способы проведения биржевых торгов. Этапы прохождения сделки с ценными бумагами. Клиринг. Исполнение сделки. Хеджирование биржевых операций.</p> <p>Биржевые бюллетени и сделки с биржевыми индексами</p>
--	---

#### 4.3. Практические (семинарские) занятия

Темы практических занятий и их трудоемкость приведены в таблице 4.

Таблица 4 – Практические занятия и их трудоемкость

№ п/п	Темы практических занятий	Формы практических занятий	Трудоемкость, (час)	№ раздела дисциплины
Семестр 7				
1	Тема «Основные понятия и нормативная база функционирования рынка ценных бумаг ценных в России»	практическое занятие	2	1
2	Тема «Основные характеристики и показатели долевых ценных бумаг»	практическое занятие	3	1
3	Тема «Определение текущей рыночной стоимости долевых ценных бумаг»	практическое занятие	2	1
4	Тема «Определение текущей рыночной стоимости долевых ценных бумаг»	практическое занятие	3	1
5	Тема «Определение результата сделок с опционами»	практическое занятие	1	2
6	Тема «Особенности рынка векселей»	практическое занятие	2	2
7	Тема «Анализ финансовых результатов биржевой операции»	практическое занятие	2	2
8	Тема «Контрольная работа по курсу дисциплины»	практическое занятие	2	2

Всего:	17	
--------	----	--

#### 4.4. Лабораторные занятия

Темы лабораторных занятий и их трудоемкость приведены в таблице 5.

Таблица 5 – Лабораторные занятия и их трудоемкость

№ п/п	Наименование лабораторных работ	Трудоемкость, (час)	№ раздела дисциплины
Учебным планом не предусмотрено			
Всего:			

#### 4.5. Курсовое проектирование (работа)

Учебным планом не предусмотрено

#### 4.6. Самостоятельная работа обучающихся

Виды самостоятельной работы и ее трудоемкость приведены в таблице 6.

Таблица 6 Виды самостоятельной работы и ее трудоемкость

Вид самостоятельной работы	Всего, час	Семестр 7, час
1	2	3
<b>Самостоятельная работа, всего</b>	93	93
изучение теоретического материала дисциплины (ТО)	43	43
Подготовка к текущему контролю (ТК)	18	18
домашнее задание (ДЗ)	32	32
контрольные работы заочников (КРЗ)		

### 5. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся указаны в п.п. 8-10.

### 6. Перечень основной и дополнительной литературы

#### 6.1. Основная литература

Перечень основной литературы приведен в таблице 7.

Таблица 7 – Перечень основной литературы

Шифр	Библиографическая ссылка / URL адрес	Количество экземпляров в библиотеке (кроме электронных экземпляров)

	Зверев, В. А. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс] : Учебник для бакалавров / В. А. Зверев, А. В. Зверева, С. Г. Евсюков, А. В. Макеев. — М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2015. — 256 с. <a href="http://znanium.com/bookread2.php?book=513247">http://znanium.com/bookread2.php?book=513247</a>	
	Рынок ценных бумаг: Учебник / Е.Б. Стародубцева. - М.: ИД ФОРУМ: НИЦ ИНФРА-М, 2013. - 176 с <a href="http://znanium.com/bookread2.php?book=407701">http://znanium.com/bookread2.php?book=407701</a>	
	Рынок ценных бумаг и биржевое дело: Учебное пособие / И.В. Кирьянов. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2013. - 264 с. <a href="http://znanium.com/bookread2.php?book=392206">http://znanium.com/bookread2.php?book=392206</a>	
	Рынок ценных бумаг: Учебник / В.А. Галанов. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2014. - 378 с. <a href="http://znanium.com/bookread2.php?book=426879">http://znanium.com/bookread2.php?book=426879</a>	

## 6.2. Дополнительная литература

Перечень дополнительной литературы приведен в таблице 8.

Таблица 8 – Перечень дополнительной литературы

Шифр	Библиографическая ссылка/ URL адрес	Количество экземпляров в библиотеке (кроме электронных экземпляров)
	Бердникова Т. Б. Рынок ценных бумаг и биржевое дело: Учебное пособие. - (Серия "Высшее образование")/Бердникова Т. Б. ИНФРА-М, 2000. - 270 с. <a href="http://znanium.com/bookread2.php?book=36634">http://znanium.com/bookread2.php?book=36634</a>	
	Финансовый рынок: Рынок ценных бумаг: Учебное пособие / И.В. Кирьянов, С.Н. Часовников. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2014. - 281 с. <a href="http://znanium.com/bookread2.php?book=488348">http://znanium.com/bookread2.php?book=488348</a>	
	Жуков, Е. Ф. Деньги. Кредит. Банки. Ценные бумаги. Практикум [Электронный ресурс] : учеб. пособие для студентов вузов, обучающихся по специальностям экономики и управления / Е. Ф. Жуков; под ред. Е.Ф. Жукова. - 2-е изд., перераб. и доп. - М. : ЮНИТИ-ДАНА, 2012. - 431 с. <a href="http://znanium.com/bookread2.php?book=390987">http://znanium.com/bookread2.php?book=390987</a>	

## 7. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети ИНТЕРНЕТ, необходимых для освоения дисциплины

Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети ИНТЕРНЕТ, необходимых для освоения дисциплины приведен в таблице 9.

Таблица 9 – Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети ИНТЕРНЕТ, необходимых для освоения дисциплины

URL адрес	Наименование
<a href="http://e.lanbook.com/books">http://e.lanbook.com/books</a>	Издательство «Лань» электронно-библиотечная система
<a href="http://znanium.com/bookread">http://znanium.com/bookread</a>	«Инфра-М» электронно-библиотечная система

## 8. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине

### 8.1. Перечень программного обеспечения

Перечень используемого программного обеспечения представлен в таблице 10.

Таблица 10 – Перечень программного обеспечения

№ п/п	Наименование
	Не предусмотрено

### 8.2. Перечень информационно-справочных систем

Перечень используемых информационно-справочных систем представлен в таблице 11.

Таблица 11 – Перечень информационно-справочных систем

№ п/п	Наименование
	Не предусмотрено

## 9. Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине

Состав материально-технической базы представлен в таблице 12.

Таблица 12 – Состав материально-технической базы

№ п/п	Наименование составной части материально-технической базы	Номер аудитории (при необходимости)
1	Лекционная аудитория	24-13
2	Мультимедийная лекционная аудитория	22-09

## 10. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

10.1. Состав фонда оценочных средств приведен в таблице 13

Таблица 13 - Состав фонда оценочных средств для промежуточной аттестации

Вид промежуточной аттестации	Примерный перечень оценочных средств
Зачет	Список вопросов Практические задачи Тесты.

10.2. Перечень компетенций, относящихся к дисциплине, и этапы их формирования в процессе освоения образовательной программы приведены в таблице 14.

Таблица 14 – Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

Номер семестра	Этапы формирования компетенций по дисциплинам/практикам в процессе освоения ОП
ПК-24	«способность оценивать эффективность формирования и использования государственных и муниципальных финансовых ресурсов, выявлять и пресекать нарушения в сфере государственных и муниципальных финансов»
1	Основы социального государства
6	Бюджетный учет и отчетность
6	Налоги и налогообложение
6	Основы аудита

7	Аудит
7	Рынок ценных бумаг
8	Оценка рисков
9	Государственное и муниципальное управление
9	Противодействие преступлениям в сфере экономики
9	Системы государственного и муниципального управления
ПК-29 «способность выбирать инструментальные средства для обработки финансовой, бухгалтерской и иной экономической информации и обосновывать свой выбор»	
2	Учебная практика
4	Производственная практика
5	Деньги, кредит, банки
6	Бюджетный учет и отчетность
7	Рынок ценных бумаг
7	Финансовый менеджмент
7	Информационные системы в экономике
8	Оценка рисков
8	Контроль и ревизия
10	Финансовая безопасность предприятия
10	Информационное обеспечение безопасности предпринимательства
ПК-40 «способность осуществлять экспертную оценку факторов риска, способных создавать социально-экономические ситуации критического характера, оценивать возможные экономические потери в случае нарушения экономической и финансовой безопасности, определять необходимые компенсационные резервы»	
7	Рынок ценных бумаг
8	Контроль и ревизия
8	Организация и методика проведения налоговых проверок
8	Оценка рисков
9	Международное сотрудничество в борьбе с экономическими преступлениями
9	Проблемы противодействия терроризму
9	Научно-исследовательская работа
9	Научно-исследовательская работа
10	Научно-исследовательская работа
10	Научно-исследовательская работа

10.3. В качестве критериев оценки уровня сформированности (освоения) у обучающихся компетенций применяется шкала модульно–рейтинговой системы университета. В таблице 15 представлена 100–балльная и 4–балльная шкалы для оценки сформированности компетенций.

Таблица 15 –Критерии оценки уровня сформированности компетенций

Оценка компетенции		Характеристика сформированных компетенций
100-балльная шкала	4-балльная шкала	

$85 \leq K \leq 100$	«отлично» «зачтено»	<ul style="list-style-type: none"> <li>- обучающийся глубоко и всесторонне усвоил программный материал;</li> <li>- уверенно, логично, последовательно и грамотно его излагает;</li> <li>- опираясь на знания основной и дополнительной литературы, тесно привязывает усвоенные научные положения с практической деятельностью направления;</li> <li>- умело обосновывает и аргументирует выдвигаемые им идеи;</li> <li>- делает выводы и обобщения;</li> <li>- свободно владеет системой специализированных понятий.</li> </ul>
$70 \leq K \leq 84$	«хорошо» «зачтено»	<ul style="list-style-type: none"> <li>- обучающийся твердо усвоил программный материал, грамотно и по существу излагает его, опираясь на знания основной литературы;</li> <li>- не допускает существенных неточностей;</li> <li>- увязывает усвоенные знания с практической деятельностью направления;</li> <li>- аргументирует научные положения;</li> <li>- делает выводы и обобщения;</li> <li>- владеет системой специализированных понятий.</li> </ul>
$55 \leq K \leq 69$	«удовлетворительно» «зачтено»	<ul style="list-style-type: none"> <li>- обучающийся усвоил только основной программный материал, по существу излагает его, опираясь на знания только основной литературы;</li> <li>- допускает несущественные ошибки и неточности;</li> <li>- испытывает затруднения в практическом применении знаний направления;</li> <li>- слабо аргументирует научные положения;</li> <li>- затрудняется в формулировании выводов и обобщений;</li> <li>- частично владеет системой специализированных понятий.</li> </ul>
$K \leq 54$	«неудовлетворительно» «не зачтено»	<ul style="list-style-type: none"> <li>- обучающийся не усвоил значительной части программного материала;</li> <li>- допускает существенные ошибки и неточности при рассмотрении проблем в конкретном направлении;</li> <li>- испытывает трудности в практическом применении знаний;</li> <li>- не может аргументировать научные положения;</li> <li>- не формулирует выводов и обобщений.</li> </ul>

#### 10.4. Типовые контрольные задания или иные материалы:

##### 1. Вопросы (задачи) для экзамена (таблица 16)

Таблица 16 – Вопросы (задачи) для экзамена

№ п/п	Перечень вопросов (задач) для экзамена
	Учебным планом не предусмотрено

##### 2. Вопросы (задачи) для зачета / дифференцированного зачета (таблица 17)

№ п/п	Перечень вопросов (задач) для зачета /
	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Классификация участников рынка ценных бумаг. Кто может выступать эмитентами на рынке ценных бумаг?</li> <li>2. Классификация участников рынка ценных бумаг. Кто может выступать инвесторами на рынке ценных бумаг?</li> <li>3. Структура рынка ценных бумаг в зависимости от различных признаков.</li> <li>4. Классификация ценных бумаг в зависимости от различных признаков.</li> <li>5. Какие ценные бумаги относятся к краткосрочным долговым инструментам и почему они называются дисконтными?</li> </ol>

6. Дисконтная и инвестиционная доходность краткосрочных облигаций. Пример.
7. Вексель. Банковский вексель. Инвестиционная доходность по векселю в зависимости от момента его приобретения.
8. Расчет текущей доходности векселя в зависимости от изменения процентных ставок по другим финансовым инструментам.
9. Классификация облигаций в зависимости от различных признаков.
10. Оценка уровня доходности облигаций на первичном и вторичном рынках.
11. Расчет курсовой цены облигации в зависимости от процентных ставок по банковским вкладам.
12. Характеристика долевых ценных бумаг, отличие их от долговых и классификация в зависимости от способа передачи.
13. Характеристика долевых ценных бумаг и их классификация в зависимости от степени полноты предоставляемых своим владельцам прав.
14. Классификация привилегированных акций.
15. Цена и доходность акций.
16. Определение приемлемой нормы прибыли для вложений в акции.
17. Характеристика и оценка производных ценных бумаг.
18. Соотношение доходности различных видов ценных бумаг.
19. Процедура эмиссии. Момент эмиссии, содержание проспекта эмиссии.
20. Процедура эмиссии. Этапы процедуры эмиссии.
21. Процедура эмиссии. Регистрация выпуска и информация о выпуске, раскрываемая эмитентом.
22. Процедура эмиссии. Размещение ценных бумаг.
23. Организация и характеристика вторичного рынка ценных бумаг. Механизм функционирования биржи.
24. Особенности различных организационно-правовых форм организации бирж. Права и обязанности.
25. Листинг. Правила допуска ценных бумаг к торговле на бирже, расчет платы за принятие акций к котировке.
26. Виды биржевых операций. Характеристика кассовых сделок ( spot ).
27. Виды биржевых операций. Характеристика сделки на срок ( futures ) и ее участников («быков» и «медведей»).
28. Характеристика спекулятивных сделок. Твердые срочные сделки участников на повышение курса ценных бумаг.
29. Характеристика спекулятивных сделок. Твердые срочные сделки участников на понижение курса ценных бумаг.
30. Характеристика спекулятивных сделок. Условные сделки с предварительной премией.
31. Характеристика спекулятивных сделок. Условная сделка –опцион на примере игроков на понижение.
32. Фьючерсные сделки с опционом. Опционы на покупку « call » и на продажу « put ».
33. Осуществление стеллажных сделок .Пример.
34. Основные способы хеджирования биржевых операций.
35. Содержание и типы биржевых приказов. Сравнительный анализ рыночного и лимитированного приказов.
36. Основные способы проведения биржевых торгов
37. Основные этапы прохождения сделки с ценными бумагами. Процедуры заключения и сверки сделки.
38. Основные этапы прохождения сделки с ценными бумагами. Процедура клиринга. Длинная и короткая позиция.

<p>39. Основные этапы прохождения сделки с ценными бумагами. Процедура исполнения сделки.</p> <p>40. Определение котировальных цен и содержание биржевых бюллетеней</p> <p>41. Обобщающие показатели динамики курсов ценных бумаг. Классификация биржевых индексов.</p> <p>50. Обобщающие показатели динамики курсов ценных бумаг. Сделки с биржевыми индексами.</p>
--

3. Темы и задание для выполнения курсовой работы / выполнения курсового проекта (таблица 18)

Таблица 18 – Примерный перечень тем для выполнения курсовой работы / выполнения курсового проекта

№ п/п	Примерный перечень тем для выполнения курсовой работы / выполнения курсового проекта
	Учебным планом не предусмотрено

4. Вопросы для проведения промежуточной аттестации при тестировании (таблица 19)

Таблица 19 – Примерный перечень вопросов для тестов

№ п/п	Примерный перечень вопросов для тестов
Тест 1	<p><b>1. Рынок ценных бумаг представляет собой:</b></p> <p>а) место, где продаются и покупаются ценные бумаги (фондовые инструменты);</p> <p>б) совокупность экономических отношений, возникающих в процессе выпуска (эмиссии), обращения на вторичном рынке и погашения ценных бумаг, позволяющих мобилизовать капитал для инвестиций в экономику;</p> <p>в) систему уполномоченных банков, осуществляющих операции с ценными бумагами;</p> <p>г) финансовый инструмент мобилизации денежных средств.</p> <p><b>Варианты ответов: 1) а; 2) б; 3) в; 4) г.</b></p>
Тест 1	<p><b>2. Государственные органы регулирования рынка ценных бумаг правительственного уровня управления включают:</b></p> <p>а) ФКЦБ;</p> <p>б) Министерство финансов РФ;</p> <p>в) Центральный банк РФ;</p> <p>г) Министерство РФ по антимонопольной политике и поддержке предпринимательства;</p> <p>д) Госстрахнадзор.</p> <p><b>Варианты ответов: 1) а, б; 2) а, б, в; 3) а, б, в, г; 4) а, б, в, г, д.</b></p>
Тест 1	<p><b>3. Законодательством РФ в качестве ценных бумаг признаются:</b></p> <p>а) акции;</p> <p>б) облигации;</p> <p>в) векселя;</p> <p>г) банковские сертификаты;</p> <p>д) банковская сберегательная книжка;</p> <p>е) чек;</p> <p>ж) коносамент;</p> <p>з) приватизационные ценные бумаги;</p> <p>и) закладные;</p> <p>к) страховые и медицинские полисы.</p> <p><b>Варианты ответов: 1) а, б, в, г, д, е, ж, з, и, к; 2) а, б, в, г, д, е, ж, з, и; 3) а, б, в, г, д, е, ж, з; 4) а, б, в, г, д, е, ж.</b></p>
Тест 1	<p><b>4. Непосредственным участником биржевых торгов являются:</b></p> <p>а) инвесторы (покупатели);</p> <p>б) эмитенты (продавцы);</p> <p>в) фондовые посредники (дилеры и брокеры);</p> <p>г) организации, предоставляющие услуги на рынке ценных бумаг (биржа, регистраторы, депозитарии, клиринговые организации, консультанты и др.);</p>

	<p>д) организации, осуществляющие доверительное управление (трастовые организации);</p> <p>е) государственные органы регулирования и контроля.</p> <p><b>Варианты ответов: 1) а, б; 2) б, в; 3) в, г, д; 4) г, д, е</b></p>
Тест 1	<p><b>5. В случае нахождения сертификата предъявительской документарной ценной бумаги у владельца право на ее владение переходит к покупателю в момент:</b></p> <p>а) передачи сертификата покупателю;</p> <p>б) осуществления приходной записи по счету депо покупателя;</p> <p>в) передачи ему сертификата ценной бумаги после внесения приходной записи по лицевому счету приобретателя;</p> <p>г) внесения приходной записи по лицевому счету покупателя.</p> <p><b>Варианты ответов: 1) а; 2) б; 3) в; 4) г.</b></p>
Тест 1	<p><b>6. В качестве профессионального участника рынка ценных бумаг фондовая биржа может быть признана как:</b></p> <p>а) общество с ограниченной ответственностью;</p> <p>б) некоммерческое партнерство;</p> <p>в) ассоциация;</p> <p>г) акционерное общество.</p> <p><b>Варианты ответов: 1) а; 2) б; 3) в; 4) г.</b></p>
Тест 1	<p><b>7. К основным параметрам, характеризующим сделки, заключаемые на рынке ценных бумаг, относятся:</b></p> <p>а) предмет сделки (наименование ценных бумаг);</p> <p>б) объем сделки (количество ценных бумаг, предложенное для купли-продажи);</p> <p>в) цена исполнения сделки (цена одной ценной бумаги, по которой будет заключена сделка);</p> <p>г) срок исполнения сделки (когда продавец должен поставить, а покупатель принять ценные бумаги);</p> <p>д) срок расчета по сделке (когда покупатель должен оплатить ценные бумаги);</p> <p>е) размер комиссионных по сделке.</p> <p><b>Варианты ответов: -1) а, б, в, е; 2) б, в, г, д; 3) а, б, в, г, д; 4) а, г, д, е</b></p>
Тест 1	<p><b>8. Имеют ли право учредители АО отказать одному из учредителей в праве оплаты акций АО облигациями другого предприятия:</b></p> <p>а) имеют;</p> <p>б) не имеют;</p> <p>в) имеют, если облигации не обеспечены залогом;</p> <p>г) имеют, если облигации неконвертируемые.</p> <p><b>Варианты ответов: 1) а; 2) б; 3) в; 4) г.</b></p>
Тест 1	<p><b>9. Какие виды государственных ценных бумаг обращаются на фондовых биржах США:</b></p> <p>а) векселя;</p> <p>б) ноты;</p> <p>в) бонды;</p> <p>г) облигации федерального займа;</p> <p>д) специальные займы;</p> <p>е) беспроцентные казначейские свидетельства.</p> <p><b>Варианты ответов: 1) а, б, в, д; 2) а, б, в, г; 3) б, в, г, д, е; 4) в, г, д, е</b></p>
Тест 1	<p><b>10. Анализ дисконтированных денежных потоков состоит из следующих этапов:</b></p> <p>а) определение приведенной стоимости денежного потока;</p> <p>б) включение оценки риска в анализ;</p> <p>в) оценка степени риска денежных потоков;</p> <p>г) расчет прогнозируемых денежных потоков.</p> <p><b>Варианты ответов: 1) а, б, в, г; 2) а, б, в; 3) а, б; 4) а</b></p>
Тест 1	<p><b>11. Ожидаемая доходность определяется:</b></p> <p>а) по реально сложившимся рыночным характеристикам ценных бумаг за истекший период;</p> <p>б) расчетным путем, исходя из доходностей альтернативных проектов инвестиций;</p> <p>в) расчетным путем, исходя из планируемых (прогнозируемых) показателей деятельности акционерных обществ;</p> <p>г) по реально сложившимся результатам деятельности акционерных обществ за истекший период.</p> <p><b>Варианты ответов: 1) а, б; 2) б, в; 3) а, г; 4) б, г.</b></p>
Тест 1	<p><b>12. В базовой модели оценки финансовых активов (ВСП-модели) риски учитываются:</b></p> <p>а) риск в ожидаемой доходности;</p> <p>б) корректировка параметров денежного потока;</p> <p>в) влияние на стоимость актива;</p> <p>г) влияние на купонный доход.</p>

	<p><b>Варианты ответов: 1) а, б; 2) б, в; 3) в, г; 4) б, г.</b></p>
<p><b>Тест 2</b></p>	<p><b>1. Кто может выступать эмитентами на рынке ценных бумаг?</b>  а) юридическое лицо, или органы исполнительной власти, либо органы местного самоуправления, не несущие от своего имени обязательства перед владельцами ценных бумаг по осуществлению прав, закреплённых ими, б) только юридические лица, в) юридическое лицо, или органы исполнительной власти, либо органы местного самоуправления, несущие от своего имени обязательства перед владельцами ценных бумаг по осуществлению прав, закреплённых ими, г) только физические лица, д) только органы исполнительной власти</p> <p><b>2. Кто может выступать инвесторами на рынке ценных бумаг?</b>  а) физические лица, использующие свои сбережения для приобретения ценных бумаг и последующего получения убытков, б) профессионалы фондового рынка в) лица, владеющие знаниями г) лица, владеющие ценными бумагами, д) лица преклонного возраста</p> <p><b>3. Какие признаки классификации рынка ценных бумаг?</b> а) по географическим признакам и общественному признанию б) по финансированию холдинговых компаний в) по хеджированию г) по организации торговли предприятиями д) по организации торговли ценными бумагами</p> <p><b>4. Какова структура и характеристика рынка ценных бумаг в зависимости от дополнительных прав владельца ценных бумаг</b> а) именные б) на предъявителя в) ордерные г) ордерные и краткосрочные д) именные и долгосрочные</p> <p><b>5. Структура и характеристика рынка ценных бумаг в зависимости от типа продаваемых бумаг</b>  а) рынок капитала б) рынок акций в) денежный рынок г) рынок облигаций д) организованный рынок</p> <p><b>6. Что такое первичный рынок</b>  а) это рынок, на котором обращаются ранее эмитированные ценные бумаги б) это рынок, на котором продаются новые выпуски ценных бумаг в) мобилизация финансовых ресурсов г) перераспределение финансовых ресурсов д) перепродажа ценных бумаг</p> <p><b>7. К обязательным реквизитам акции относится</b>  а) сроки выплаты дивидендов б) номинальная стоимость в) имя держателя г) вид акции д) все варианты верны</p> <p><b>8. Что такое call option</b>  а) дает право покупателю, но не обязанность, продать определенный пакет ценных бумаг по соответствующей цене в течение срока действия этого опциона  б) это комбинация опциона на продажу и на покупку, которая позволяет его покупателю купить или продать ценные бумаги по соответствующей цене  в) это сделка с премией, при которой плательщик премии имеет право требовать от своего контрагента передачу ему, например, ценных бумаг  г) дает право покупателю, но не обязанность, купить определенный пакет ценных бумаг по соответствующей цене в течение срока действия этого опциона  д) дает право покупателю и обязанность, продать определенный пакет ценных бумаг по соответствующей цене в течение срока действия этого опциона</p> <p><b>9. Кто такие «медведи»</b>  а) игроки на повышение б) игроки на понижение в) кто извлекает выгоду не только от изменения биржевых цен, но и от разницы между ценами бумаг при подписке и их последующей продаже г) правильных вариантов нет д) кто не извлекает выгоду не только от изменения биржевых цен, но и от разницы между ценами бумаг при подписке и их последующей продаже</p> <p><b>10. Классификация ценных бумаг в зависимости от различных признаков.</b>  а) по виду продавца б) в зависимости от форм организации в) в зависимости от регистра г) в зависимости от управляющих д) в зависимости от типа продаваемых ценных бумаг</p> <p><b>11. Какие ценные бумаги относятся к краткосрочным долговым инструментам, продаются по цене ниже номинала, а погашаются по номиналу?</b>  а) государственные б) акции в) процентная ценная бумага г) облигации д) дисконтированные</p> <p><b>12. Дисконтная и инвестиционная доходность краткосрочных облигаций представляют...</b>  а) банковскую доходность и реальную доходность б) фиктивный вексель в) обеспеченность и не обеспеченность ценных бумаг г) нереальную доходность д) депозитарные сертификаты</p> <p><b>13. При определении выгодности вложений, используя расчёт дисконтной и инвестиционной доходности депозитных сертификатов, следует учитывать:</b>  а) фактор занятости б) фактор будущей стоимости товара в) фактор времени г) финансовое положение д) фактор оборачиваемости</p> <p><b>14. Банковский вексель – это...</b>  а) вексель, на сумму которого начисляются проценты б) вексель, по которому банк является основным должником в) вексель, по которому нет основных должников г) вексель, по которому банк не является основным должником д) вексель, по которому частное лицо является основным</p>

	<p>должником</p> <p><b>15. После чего эмитент начинает размещение ценных бумаг:</b>  а) регистрации отчета об итогах выпуска б) принятие эмитентом решения о выпуске в) регистрации их выпуска г) принятие эмитентом решения о не выпуске</p> <p><b>16. По размерности выборки индексы делятся на:</b>  а) индексы с ограниченной выборкой и индексы с широкой выборкой б) отраслевые, региональные, сводные в) индексы агентств, индексы торговых площадок г) индексы акций стоимости и акций роста д) индексы с не ограниченной выборкой и индексы с широкой выборкой</p> <p><b>17. Какая информация раскрывается эмитентом, при регистрации выпуска ценных бумаг?</b>  а) объём выпуска ценных бумаг по номиналу б) характеристика выпускаемых ценных бумаг в) заявление на регистрацию г) копия платёжного поручения об уплате налога на операции с ценными бумагами д) документы, подтверждающие согласование данного выпуска ценных бумаг с соответствующим органом</p> <p><b>18. Что такое call option</b>  а) дает право покупателю, но не обязанность, продать определенный пакет ценных бумаг по соответствующей цене в течение срока действия этого опциона  б) это комбинация опциона на продажу и на покупку, которая позволяет его покупателю купить или продать ценные бумаги по соответствующей цене  в) это сделка с премией, при которой плательщик премии имеет право требовать от своего контрагента передачу ему, например, ценных бумаг  г) дает право покупателю, но не обязанность, купить определенный пакет ценных бумаг по соответствующей цене в течение срока действия этого опциона  д) дает право покупателю и обязанность, продать определенный пакет ценных бумаг по соответствующей цене в течение срока действия этого опциона</p>
--	---

## 5. Контрольные и практические задачи / задания по дисциплине (таблица 20)

Таблица 20 – Примерный перечень контрольных и практических задач / заданий

№ п/п	Примерный перечень контрольных и практических задач / заданий
1	<p><b>Контрольное задание 1</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Классификация участников рынка ценных бумаг. Кто может выступать эмитентами на рынке ценных бумаг?</li> <li>• Какие ценные бумаги относятся к краткосрочным долговым инструментам и почему они называются дисконтными?</li> <li>• Момент эмиссии и основное содержание проспекта эмиссии .</li> <li>• Дать характеристику обобщающих показателей динамики курсов ценных бумаг и указать классификация биржевых индексов.</li> </ul> <p><b>ЗАДАЧА</b> Определить курсовую стоимость 10%- ой облигации номиналом 10000 рублей и сроком действия 4 года, приемлемой для покупателя и продавца, если ставка по банковским вкладам меняется и составляет 9%.</p>
2	<p><b>Контрольное задание 2</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Классификация участников рынка ценных бумаг. Кто может выступать инвесторами на рынке ценных бумаг?</li> <li>• 2. Как оценивается дисконтная и инвестиционная доходность депозитных сертификатов. Привести пример.</li> <li>• Указать основные этапы процедуры эмиссии</li> <li>• Какие существуют основные способы проведения биржевых торгов?</li> </ul> <p><b>ЗАДАЧА</b> Определить финансовый результат по итогам фьючерсного контракта на продажу без покрытия акций по цене 800 рублей, если на дату реализации контракта курс составлял 80 рублей.</p>
3	<p><b>Контрольное задание 3</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1 Структура рынка ценных бумаг в зависимости от различных признаков.</li> <li>2 Дать характеристику векселю, в том числе банковскому. Как оценивается инвестиционная доходность по векселю в зависимости от момента его приобретения?</li> <li>3 Процедура эмиссии. Размещение ценных бумаг.</li> <li>4 Виды биржевых операций. Характеристика сделки на срок ( futures ) и ее участников(“быков” и “медведей</li> </ol> <p><b>ЗАДАЧА</b> Рассчитать инвестиционную и банковскую доходность краткосрочной облигации номиналом 20000 рублей при покупке за 15890 рублей на срок 48 дней.</p>

4	<p><b>Контрольное задание 4</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1 Структура и характеристика рынка ценных бумаг в зависимости от времени и способа поступления продаваемых ценных бумаг.</li> <li>2 Дать сравнительную характеристику различных видов долгосрочных долговых ценных бумаг и показать способы их оценки.</li> <li>3 Особенности различных организационно-правовых форм организации бирж. Права и обязанности биржи.</li> <li>4 Характеристика спекулятивных сделок. Твердые срочные сделки участников на повышение курса ценных бумаг</li> </ol>
5	<p><b>ЗАДАЧА</b> Определить стоимость акционерного капитала, если рыночная стоимость акции 1000 рублей, ожидаемый дивиденд 50 рублей, темп роста дивиденда 7%.</p> <p><b>Контрольное задание 5</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Структура и характеристика рынка ценных бумаг в зависимости от типа продаваемых бумаг.</li> <li>2. Характеристика долевых ценных бумаг и их классификация в зависимости от степени полноты предоставляемых своим владельцам прав. Какими показателями оцениваются стоимостные характеристики и доходность долевых ценных бумаг?</li> <li>3. Специфика выполняемых операций профессиональных участников рынка ценных бумаг.</li> <li>4. Сравнительный анализ фьючерсных сделок и фьючерсных контрактов.</li> </ol> <p><b>ЗАДАЧА</b> Определить доходность акции, если по обращающимся привилегированным авциям выплачиваются ежегодные дивиденды 120 рублей.</p>
6	<p><b>Контрольное задание 6</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Дать сравнительный анализ основных свойств первичного и вторичного рынков ценных бумаг.</li> <li>2. Охарактеризовать привилегированные акции и дать их классификацию.</li> <li>3. Содержание и типы биржевых приказов. Сравнительный анализ рыночного и лимитированного приказов.</li> <li>4. Основные способы проведения биржевых торгов.</li> </ol> <p><b>ЗАДАЧА</b> Вексель номиналом 500000 рублей учтен банком по стоимости 456700 рублей за 59 дней до его погашения. Определить доходность дисконтного векселя.</p>
7	<p><b>Контрольное задание 7</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Классификация участников рынка ценных бумаг. Кто может выступать эмитентами на рынке ценных бумаг?</li> <li>2. Характеристика долевых ценных бумаг и их классификация в зависимости от степени полноты предоставляемых своим владельцам прав. Какими показателями оцениваются стоимостные характеристики и доходность долевых ценных бумаг?</li> <li>3. Момент эмиссии и основное содержание проспекта эмиссии .</li> <li>4. Специфика выполняемых операций профессиональных участников рынка ценных бумаг..</li> </ol> <p><b>ЗАДАЧА.</b> Определить курсовую стоимость облигации, приемлемую для покупателя и продавца в зависимости от времени свершения сделки, номинал 1000, процентная ставка при выплате 3 раза в год 10%, банковской ставке 7%, срок до погашения 4 года и 15 дней.</p>

10.3. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и / или опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций, содержатся в Положениях «О текущем контроле успеваемости и промежуточной аттестации студентов ГУАП, обучающихся по программы высшего образования» и «О модульно-рейтинговой системе оценки качества учебной работы студентов в ГУАП».

## 11. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Целью преподавания дисциплины «Рынок ценных бумаг» является формирование у студентов современных знаний в области экономического содержания различных видов ценных бумаг, механизма работы фондовой биржи и получение навыков по формированию и управлению портфелем ценных бумаг.

**Методические указания для обучающихся по освоению лекционного материала по дисциплине «Рынок ценных бумаг»**

Основное назначение лекционного материала – логически стройное, системное, глубокое и ясное изложение учебного материала. Назначение современной лекции в рамках дисциплины не в том, чтобы получить всю информацию по теме, а в освоении

фундаментальных проблем дисциплины, методов научного познания, новейших достижений научной мысли. В учебном процессе лекция выполняет методологическую, организационную и информационную функции. Лекция раскрывает понятийный аппарат конкретной области знания, её проблемы, дает цельное представление о дисциплине, показывает взаимосвязь с другими дисциплинами.

Планируемые результаты при освоении обучающимся лекционного материала:

- получение современных, целостных, взаимосвязанных знаний, уровень которых определяется целевой установкой к каждой конкретной теме;
- получение опыта творческой работы совместно с преподавателем;
- развитие профессионально–деловых качеств, любви к предмету и самостоятельного творческого мышления.
- появление необходимого интереса, необходимого для самостоятельной работы;
- получение знаний о современном уровне развития науки и техники и о прогнозе их развития на ближайшие годы;
- научиться методически обрабатывать материал (выделять главные мысли и положения, приходиться к конкретным выводам, повторять их в различных формулировках);
- получение точного понимания всех необходимых терминов и понятий.

Лекционный материал может сопровождаться демонстрацией слайдов и использованием раздаточного материала при проведении коротких дискуссий об особенностях применения отдельных тематик по дисциплине.

Структура предоставления лекционного материала:

по дисциплине «Рынок ценных бумаг» включает в себя формулировку темы лекции, указание основных изучаемых разделов и или вопросов, предполагаемых затрат времени на их изложение. Изложение вводной части, изложение основной части лекции, выводы по изучаемым вопросам и рекомендации по самостоятельному изучению некоторых положений темы

**Методические указания для обучающихся по прохождению практических занятий по дисциплине «Рынок ценных бумаг»**

Практическое занятие является одной из основных форм организации учебного процесса, заключающаяся в выполнении обучающимися под руководством преподавателя комплекса учебных заданий с целью усвоения научно-теоретических основ учебной дисциплины, приобретения умений и навыков, опыта творческой деятельности.

Целью практического занятия для обучающегося является привитие обучающемуся умений и навыков практической деятельности по изучаемой дисциплине.

Планируемые результаты при освоении обучающимся практических занятий:

- закрепление, углубление, расширение и детализация знаний при решении конкретных задач;
- развитие познавательных способностей, самостоятельности мышления, творческой активности;
- овладение новыми методами и методиками изучения конкретной учебной дисциплины;
- выработка способности логического осмысления полученных знаний для выполнения заданий;
- обеспечение рационального сочетания коллективной и индивидуальной форм обучения.

Функции практических занятий:

- познавательная;
- развивающая;
- воспитательная.

По характеру выполняемых обучающимся заданий по практическим занятиям подразделяются на:

- ознакомительные, проводимые с целью закрепления и конкретизации изученного теоретического материала;
- аналитические, ставящие своей целью получение новой информации на основе формализованных методов;
- творческие, связанные с получением новой информации путем самостоятельно выбранных подходов к решению задач.

Формы организации практических занятий определяются в соответствии со специфическими особенностями учебной дисциплины и целями обучения. Они могут проводиться:

- в интерактивной форме (решение ситуационных задач, занятия по моделированию реальных условий, деловые игры, игровое проектирование, имитационные занятия, выездные занятия в организации (предприятия), деловая учебная игра, ролевая игра, психологический тренинг, кейс, мозговой штурм, групповые дискуссии);
- в не интерактивной форме (выполнение упражнений, решение типовых задач, решение ситуационных задач и другое).

Методика проведения практического занятия может быть различной, при этом важно достижение общей цели дисциплины.

### **Требования к проведению практических занятий**

**Формами организации практических занятий** в соответствии со специфическими особенностями учебной дисциплины и целями обучения являются: решение типовых задач; занятия с решением ситуационных задач; деловые игры; выездные занятия (в организации, учреждения) со специальными заданиями; кейсы; групповые дискуссии.

**Типичными структурными элементами практического занятия являются:** вводная часть, основная часть, заключительная часть.

**Вводная часть** обеспечивает подготовку студентов к выполнению заданий работы. В ее состав входят: формулировка темы, цели и задач занятия, обоснование его значимости в профессиональной подготовке студентов; рассмотрение связей данной темы с другими темами курса; изложение теоретических основ работы; характеристика состава и особенностей заданий работы и объяснение подходов (методов, способов, приемов) к их выполнению; характеристика требований к результату работы; вводный инструктаж по технике безопасности при эксплуатации технических средств; проверка готовности студентов к выполнению заданий работы; пробное выполнение заданий под руководством преподавателя; указания по самоконтролю результатов выполнения заданий студентами.

**Основная часть** предполагает самостоятельное выполнение заданий студентами. Может сопровождаться: дополнительными разъяснениями по ходу работы; устранением трудностей при выполнении заданий работы; текущим контролем и оценкой результатов работы; поддержанием в рабочем состоянии технических средств; ответами на вопросы студентов.

**Заключительная часть** содержит: подведение общих итогов (позитивных, негативных) занятия; оценку результатов работы отдельных студентов; ответы на вопросы студентов; выдачу рекомендаций по улучшению показателей работы и устранению пробелов в системе знаний и умений студентов; сбор отчетов студентов по выполненной работе для проверки преподавателем; изложение сведений о подготовке к выполнению следующей работы, в частности, о подлежащей изучению учебной литературе.

Вводная и заключительная части практического занятия проводятся фронтально. Основная часть выполняется каждым студентом индивидуально

**Методические указания для обучающихся по прохождению самостоятельной работы по дисциплине «Рынок ценных бумаг»**

В ходе выполнения самостоятельной работы, обучающийся выполняет работу по заданию и при методическом руководстве преподавателя, но без его непосредственного участия.

Для обучающихся по заочной форме обучения, самостоятельная работа может включать в себя контрольную работу.

В процессе выполнения самостоятельной работы, у обучающегося формируется целесообразное планирование рабочего времени, которое позволяет им развивать умения и навыки в усвоении и систематизации приобретаемых знаний, обеспечивает высокий уровень успеваемости в период обучения, помогает получить навыки повышения профессионального уровня.

Темы самостоятельной работы и их трудоемкость полностью соответствуют разделам курса и включают изучение законодательных и инструктивных материалов в области ценных бумаг и биржевой деятельности

- изучение форм учредительных биржевых документов, основных внутренних регулирующих биржевую деятельность;
- изучение государственных законодательных, инструктивных и нормативных документов, регулирующих биржевую деятельность в РФ и за рубежом;
- изучение примерных форм документов, регистрирующих биржевую сделку и регулирующих биржевой торг;
- изучение регламентации деятельности брокерских фирм в биржевом механизме;
- практическое изучение документального оформления и форм использования на фондовом рынке различных инструментов;
- организация процедур оформления и исполнения биржевой сделки;
- изучение государственных законодательных, инструктивных и нормативных документов, регулирующих банковскую деятельность в РФ;
- технический анализ ценных бумаг.

Результатом самостоятельной работы по дисциплине «Рынок ценных бумаг» является электронная презентация по по темам

1. Рынок ценных бумаг как альтернативный источник финансирования экономики.
2. Классификация ценных бумаг.
3. Стоимостная оценка акции.
4. Сравнительная характеристика классических видов ценных бумаг.
5. Приватизация и история формирования российского рынка акций.
6. Схемы применения различных видов акций в системе управления акционерным обществом.
7. Эмиссия акций. Этапы эмиссии акций, их характеристика, документация.
8. Способы размещения акций: распределение, подписка, конвертация.
9. Разработка проспекта эмиссии акций.
10. Дивидендная политика акционерного общества.
11. Особенности выпуска и регистрации акций коммерческого банка.
12. Биржевой рынок акций в РФ.
13. Внебиржевой рынок акций в РФ.
14. Индексы цен на российские акции: определение, виды, методика составления.
15. Характеристика российского рынка корпоративных облигаций.
16. Стоимостная оценка облигаций, доход и доходность облигаций.
17. Ценные бумаги субъектов РФ: понятие, виды и практика применения на российском рынке ценных бумаг.
18. Государственные и муниципальные ценные бумаги: понятие, виды, практика применения на российском рынке ценных бумаг.
19. Расчеты дохода и доходности на рынке государственных ценных бумаг.
20. Особенности выпуска и обращения облигаций внутреннего валютного займа.

21. Состояние и перспективы развития рынка государственных ценных бумаг.
22. Инвестиционная деятельность кредитно-финансовых институтов на рынке ценных бумаг
23. Государственные жилищные сертификаты: история и практика выпуска и обращения.
24. Финансовые инструменты на рынке ценных бумаг.
25. Вексельные операции и вексельное законодательство.
26. Рынок векселей: особенности российской вексельного рынка.
27. Банковские операции с векселями и вексельное кредитование.
28. Банковские сертификаты: виды, особенности выпуска и обращения в РФ.
29. Производные ценные бумаги.
30. Инфраструктура рынка ценных бумаг: понятие, функции, характерные особенности.
31. Профессиональные участники рынка ценных бумаг
32. Государственное регулирование рынка ценных бумаг.
33. Торговые системы рынка ценных бумаг: понятие история возникновения и перспективы развития.
34. Фондовая биржа: понятие, виды, законодательные основы функционирования, организационная структура и управление.
35. Российская торговая система (РТС)
36. Организация биржевой торговли ценными бумагами и биржевые операции.
37. Информационное обеспечение рынка ценных бумаг.
38. Фундаментальный анализ рынка ценных бумаг.
39. Системы технического анализа на рынке ценных бумаг.
40. Системы электронных торгов на рынке ценных бумаг.
41. Инвестиционный портфель: сущность, классификация, управление.
42. Инвестиционные фонды: виды, особенности законодательного регулирования, организация.
43. Паевые инвестиционные фонды в РФ.
44. Срочный рынок: понятие, возникновение российского срочного рынка, оценка его современного состояния в РФ.
45. Технология и системы проведения торгов срочными контрактами (российская практика).
46. Ценообразование и хеджирование на срочном рынке.
47. Принципы и практика ценообразования на рынке ценных бумаг.
48. Риски на рынке ценных бумаг: понятие, классификация, методы управления.
49. Механизмы увеличения капитализации российских компаний с помощью IPO.
50. Анализ факторов и прогноз динамики основных биржевых индексов.

#### **Методические указания для обучающихся по прохождению промежуточной аттестации**

Промежуточная аттестация обучающихся предусматривает оценивание промежуточных и окончательных результатов обучения по дисциплине. Она включает в себя:

– зачет – это форма оценки знаний, полученных обучающимся в ходе изучения учебной дисциплины в целом или промежуточная (по окончании семестра) оценка знаний обучающимся по отдельным разделам дисциплины с аттестационной оценкой «зачтено» или «не зачтено».

Система оценок при проведении промежуточной аттестации осуществляется в соответствии с требованиями Положений «О текущем контроле успеваемости и промежуточной аттестации студентов ГУАП, обучающихся по программы высшего образования» и «О модульно-рейтинговой системе оценки качества учебной работы студентов в ГУАП».

## Лист внесения изменений в рабочую программу дисциплины

Дата внесения изменений и дополнений. Подпись внесшего изменения	Содержание изменений и дополнений	Дата и № протокола заседания кафедры	Подпись зав. кафедрой