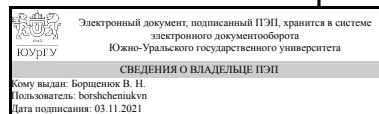


ЮЖНО-УРАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

УТВЕРЖДАЮ:
Директор филиала
Филиал г. Нижневартовск



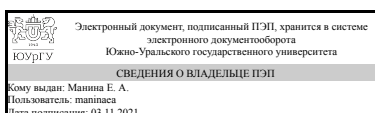
В. Н. Борщенок

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины Б.1.29 Рынок ценных бумаг
для направления 38.03.02 Менеджмент
уровень бакалавр **тип программы** Прикладной бакалавриат
профиль подготовки Производственный менеджмент на предприятии нефтяной и газовой отрасли
форма обучения заочная
кафедра-разработчик Экономика, менеджмент и право

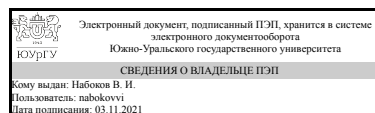
Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент, утверждённым приказом Минобрнауки от 12.01.2016 № 7

Зав.кафедрой разработчика,
к.экон.н., доц.



Е. А. Манина

Разработчик программы,
д.экон.н., проф., профессор



В. И. Набоков

1. Цели и задачи дисциплины

Цель освоения дисциплины «Рынок ценных бумаг» - развитие общекультурных и общепрофессиональных компетенций, в соответствии с которыми обучающийся должен быть способен логически верно, аргументировано и ясно строить устную и письменную речь, приобрести комплекс фундаментальных знаний по методологии и нормативному регулированию рынка ценных бумаг; освоить навыки оценки финансовых инструментов; приобрести умения аналитического исследования конкретных экономических показателей. Для достижения поставленной цели необходимо решить следующие задачи:

- дать общее представление о рынке ценных бумаг как науке о совокупности экономических отношений по поводу выпуска и обращения ценных бумаг между его участниками;
- систематизировать знания об отдельных видах российских ценных бумаг, провести их классификацию, дать их основные характеристики с учетом регулирующей законодательной базы;
- на основе полученных знаний проводить расчеты и осуществлять ценообразование на рынке ценных бумаг, осуществлять самостоятельный анализ ситуаций, возникающих на рынке ценных бумаг.

Краткое содержание дисциплины

Дисциплина «Рынок ценных бумаг» тесно связана и опирается на такие ранее изученные дисциплины, как «Микроэкономика», «Макроэкономика». Предметом изучения дисциплины является организация и функционирование российского фондового рынка, объектом – корпоративные, государственные и муниципальные ценные бумаги, обращающиеся на территории Российской Федерации. Рынок ценных бумаг и его участники. Особенности развития рынка ценных бумаг в России. Сущность и виды ценных бумаг. Классические виды ценных бумаг и их характеристика. Производные ценные бумаги. Краткосрочные финансовые инструменты. Инвестиционная деятельность кредитно-финансовых институтов на рынке ценных бумаг.

2. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины

Планируемые результаты освоения ОП ВО (компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине (ЗУНы)
ПК-4 умением применять основные методы финансового менеджмента для оценки активов, управления оборотным капиталом, принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала, в том числе, при принятии решений, связанных с операциями на мировых рынках в условиях глобализации	Знать: виды ценных бумаг и способы определения их стоимостных параметров; процедуры и особенности эмиссии (выпуска) и обращения ценных бумаг; сущность основных операций на рынке ценных бумаг для принятия инвестиционных решений
	Уметь: производить расчеты стоимостных показателей по сделкам с ценными бумагами; рассчитывать эффективность совершения операций с ценными бумагами и делать выводы относительно вложений денежных средств
	Владеть: способами определения стоимостных параметров ценных бумаг; навыками оценки эффективности операций с ценными бумагами для принятия инвестиционных решений

ПК-16 владением навыками оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов	Знать:основные законодательные и нормативные акты Российской Федерации, регламентирующее обращение ценных бумаг; структуру и функции фондовой биржи; основы деятельности профессиональных участников рынка ценных бумаг;
	Уметь:осуществлять ценообразование на рынке ценных бумаг, проводить анализ ситуаций, возникающих на рынке ценных бумаг; делать обоснованные выводы относительно эффективности операций с ценными бумагами
	Владеть:навыки стоимостной оценки финансовых инструментов; оценки эффективности операций с ценными бумагами
ОК-3 способностью использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности	Знать:экономическую сущность ценных бумаг, процедуры и особенности эмиссии (выпуска) и обращения ценных бумаги, их роли в системе рыночных отношений
	Уметь:осуществлять расчеты стоимостных показателей по сделкам с ценными бумагами и делать выводы об эффективности вложений денежных средств
	Владеть:навыками оценки эффективности операций с ценными бумагами
ОПК-1 владением навыками поиска, анализа и использования нормативных и правовых документов в своей профессиональной деятельности	Знать:способы сбора и анализа информации о деятельности предприятия, исходных данных необходимых для решения профессиональных задач в сфере экономических отношений, связанных с выпуском и обращением ценных бумаг
	Уметь:осуществлять анализ и обработку финансово-экономической информации; осуществлять расчеты стоимостных показателей по сделкам с ценными бумагами и делать выводы по эффективности вложений денежных средств
	Владеть:способы сбора и анализа исходных данных необходимых для решения профессиональных задач в сфере экономических отношений, связанных с выпуском и обращением ценных бумаг; навыками оценки эффективности операций с ценными бумагами

3. Место дисциплины в структуре ОП ВО

Перечень предшествующих дисциплин, видов работ учебного плана	Перечень последующих дисциплин, видов работ
Б.1.15 Макроэкономика, Б.1.14 Микроэкономика	Не предусмотрены

Требования к «входным» знаниям, умениям, навыкам студента, необходимым при освоении данной дисциплины и приобретенным в результате освоения предшествующих дисциплин:

Дисциплина	Требования
Б.1.15 Макроэкономика	знать основные макроэкономические категории; уметь использовать макроэкономические показатели при принятии управленческих решений; владеть навыками оценки влияния макроэкономической среды на функционирование экономического субъекта.
Б.1.14 Микроэкономика	знать основные понятия микроэкономики, экономические основы поведения предприятий; уметь анализировать поведение потребителей экономических благ и формирование спроса; владеть навыками оценки деятельности хозяйствующих субъектов

4. Объём и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 з.е., 108 ч.

Вид учебной работы	Всего часов	Распределение по семестрам в часах	
		Номер семестра	
		7	
Общая трудоёмкость дисциплины	108	108	
<i>Аудиторные занятия:</i>	12	12	
Лекции (Л)	8	8	
Практические занятия, семинары и (или) другие виды аудиторных занятий (ПЗ)	4	4	
Лабораторные работы (ЛР)	0	0	
<i>Самостоятельная работа (СРС)</i>	96	96	
Подготовка к зачету	46	46	
Подготовка к практическим занятиям по темам курса	25	25	
Выполнение эссе	25	25	
Вид итогового контроля (зачет, диф.зачет, экзамен)	-	зачет	

5. Содержание дисциплины

№ раздела	Наименование разделов дисциплины	Объем аудиторных занятий по видам в часах			
		Всего	Л	ПЗ	ЛР
1	Рынок ценных бумаг: сущность, функции, структура	4	2	2	0
2	Виды ценных бумаг	7	5	2	0
3	Биржевой фондовый рынок	1	1	0	0

5.1. Лекции

№ лекции	№ раздела	Наименование или краткое содержание лекционного занятия	Кол-во часов
1	1	Тема 1. Рынок ценных бумаг и его участники. Определение рынка ценных	1

		бумаг и его виды (классификации видов рынков ценных бумаг). Место рынка ценных бумаг. Функции рынка ценных бумаг: общерыночные и специфические. Виды рынка ценных бумаг (первичный, вторичный рынки; организованный, неорганизованный рынок ЦБ; кассовый, срочный, отсроченный и др.). Основные группы участников рынка ценных бумаг (эмитенты, инвесторы, фондовые посредники; организации, обслуживающие РЦБ; государственные органы регулирования и контроля), общая их характеристика.	
2	1	Тема 2. Особенности развития рынка ценных бумаг в России. Этапы становления рынка ценных бумаг в России, их характеристика. Современные тенденции развития рынка ценных бумаг в России	1
3	2	Тема 3. Сущность и виды ценных бумаг. Понятие ценных бумаг. Основные виды ценных бумаг (акция, облигация, банковский сертификат, вексель, чек, коносамент, варрант, опцион, фьючерсный контракт). Классификация ценных бумаг в соответствии с временными, пространственными и рыночными характеристиками. Выпуск и обращение ценных бумаг: основные этапы эмиссии ценных бумаг, порядок обращения ценных бумаг.	1
4	2	Тема 4. Классические виды ценных бумаг и их характеристика. Акции: характеристика акций, их особенности, виды цен на акции, классификация акций, алгоритм определения дивидендов. Облигации: характеристика облигаций, их особенности, виды цен на облигации, классификация облигаций, стоимостная оценка облигаций, дисконт и процентный доход по облигации, доходность облигаций. Государственные и муниципальные ценные бумаги: общая характеристика (определение, наименование, функции, преимущества, размещение), виды государственных ценных бумаг (по виду эмитента, по форме обращаемости, по срокам обращения, по способу выплаты (получения) доходов), особенности налогообложения доходов по государственным и муниципальным ценным бумагам. Показатели доходности операций по государственным и муниципальным ценным бумагам.	1
5	2	Тема 5. Производные ценные бумаги. Понятие производных ценных бумаг. Отличительные особенности производных ценных бумаг. Основные виды производных ценных бумаг: форварды, фьючерсы, опционы («колл», «путт»), свопы. Характеристика производных ценных бумаг, их стоимостная оценка.	1
6	2	Тема 6. Краткосрочные финансовые инструменты. Понятие векселя. Классификация векселей. Механизм обращения. Основные показатели дисконтного и процентного векселя. Депозитные, сберегательные, инвестиционные сертификаты и их характеристика. Обязательные реквизиты сертификата. Основные показатели банковских сертификатов.	1
7	2	Тема 7. Инвестиционная деятельность кредитно-финансовых институтов на рынке ценных бумаг. Инвестиционная деятельность кредитно-финансовых институтов на рынке ценных бумаг (западная и российская модели). Цели и принципы инвестирования. Коммерческие банки, страховые компании, пенсионные фонды, инвестиционные компании и фонды на рынке ценных бумаг. Типы инвестиционных фондов и принципы их функционирования. Принципы деятельности инвестиционных компаний. Андеррайтинг. Виды инвесторов в зависимости от стратегии вложений: стратегические и портфельные. Типы инвесторов в зависимости от тактики поведения: консервативные, умеренно-агрессивные, агрессивные, изошрённые. Понятие портфеля ценных бумаг. Цели портфельного инвестирования. Типы портфелей ценных бумаг. Активное и пассивное управление инвестиционным портфелем. Основные показатели портфеля ценных бумаг. Оценка эффективности управления портфелем.	1
8	3	Тема 8. Организационные основы деятельности фондовой биржи и механизм биржевой торговли ценными бумагами. Фондовая биржа: понятие, признаки	1

		и функции. Классификация фондовых бирж по организационно-правовому статусу. Организационная структура и персонал биржи. Нормативные требования к организации и функционированию фондовой биржи. Виды членства и требования, предъявляемые к членам биржи. Этика на фондовой бирже. Условия обращения ценных бумаг на бирже. Листинг и делистинг. Структура доходов и расходов биржи. Организация и содержание биржевой торговли. Способы биржевых торгов. Виды биржевых поручений (приказов). Сущность и механизм котировки ценных бумаг на бирже. Классификация сделок на фондовой бирже: кассовые и срочные. Цели и особенности заключения и исполнения различных видов биржевых сделок. Спекулятивные операции и хеджирование. «Быки» и «медведи».	
--	--	---	--

5.2. Практические занятия, семинары

№ занятия	№ раздела	Наименование или краткое содержание практического занятия, семинара	Кол-во часов
1	1	Практическое занятие по теме 1, 2. Рынок ценных бумаг и его участники. Особенности развития рынка ценных бумаг в России. Выполнение тестовых заданий по теме 1-3	2
2	2	Практическое занятие по теме 3, 4, 5, 6. Сущность и виды ценных бумаг. Классические виды ценных бумаг и их характеристика. Производные ценные бумаги. Краткосрочные финансовые инструменты. Решение задач по определению курсовой стоимости и доходности операций с ценными бумагами	2

5.3. Лабораторные работы

Не предусмотрены

5.4. Самостоятельная работа студента

Выполнение СРС		
Вид работы и содержание задания	Список литературы (с указанием разделов, глав, страниц)	Кол-во часов
Выполнение эссе	ПУМД, доп. лит. 1; ЭУМД, осн. лит. 1-2; доп. лит. 1-2	25
Подготовка к практическим занятиям по темам курса	ПУМД, осн. лит.1; доп. лит. 1; ЭУМД, осн. лит. 1-2; доп. лит. 1-2	25
Подготовка к зачету	ПУМД, осн. лит.1; доп. лит. 1; ЭУМД, осн. лит. 1-2; доп. лит. 1-2	46

6. Инновационные образовательные технологии, используемые в учебном процессе

Инновационные формы учебных занятий	Вид работы (Л, ПЗ, ЛР)	Краткое описание	Кол-во ауд. часов
Разбор конкретных ситуаций	Практические занятия и семинары	решение и разбор ситуационных заданий по определению курсовой стоимости и доходности операций с ценными бумагами	4
Интерактивные лекции	Лекции	Лекция - презентация	8

Собственные инновационные способы и методы, используемые в образовательном процессе

Не предусмотрены

Использование результатов научных исследований, проводимых университетом, в рамках данной дисциплины: Стратегия социально-экономического развития города Нижневартовска до 2020 года и на период до 2030 года: коллективная монография / В.Н. Борщенко, Н.В. Фролова, Н.В. Зяблицкая, О.В. Шульгин, А.Р. Ишниязова [и др.]; под ред. Н.В. Зяблицкой, О.В. Шульгина.- Екатеринбург: ФОРТ ДИАЛОГ-Исеть, 2015.- 129с.

7. Фонд оценочных средств (ФОС) для проведения текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины

7.1. Паспорт фонда оценочных средств

Наименование разделов дисциплины	Контролируемая компетенция ЗУНы	Вид контроля (включая текущий)	№№ заданий
Рынок ценных бумаг: сущность, функции, структура	ОК-3 способностью использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности	Выполнение тестовых заданий по теме 1-3	1
Виды ценных бумаг	ПК-4 умением применять основные методы финансового менеджмента для оценки активов, управления оборотным капиталом, принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала, в том числе, при принятии решений, связанных с операциями на мировых рынках в условиях глобализации	Решение задач по определению курсовой стоимости и доходности операций с ценными бумагами	2
Все разделы	ОК-3 способностью использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности	Зачет	3
Все разделы	ОПК-1 владением навыками поиска, анализа и использования нормативных и правовых документов в своей профессиональной деятельности	Зачет	3
Все разделы	ПК-4 умением применять основные методы финансового менеджмента для оценки активов, управления оборотным капиталом, принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала, в том числе, при принятии решений, связанных с операциями на мировых рынках в условиях глобализации	Зачет	3
Все разделы	ПК-16 владением навыками оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов	Зачет	3

Все разделы	ПК-4 умением применять основные методы финансового менеджмента для оценки активов, управления оборотным капиталом, принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала, в том числе, при принятии решений, связанных с операциями на мировых рынках в условиях глобализации	Контрольно-рейтинговое мероприятие промежуточной аттестации	4
Все разделы	ОПК-1 владением навыками поиска, анализа и использования нормативных и правовых документов в своей профессиональной деятельности	Контрольно-рейтинговое мероприятие промежуточной аттестации	4
Все разделы	ПК-16 владением навыками оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов	Контрольно-рейтинговое мероприятие промежуточной аттестации	4
Все разделы	ОК-3 способностью использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности	Контрольно-рейтинговое мероприятие промежуточной аттестации	4

7.2. Виды контроля, процедуры проведения, критерии оценивания

Вид контроля	Процедуры проведения и оценивания	Критерии оценивания
Выполнение тестовых заданий по теме 1-3	Обучающиеся выполняют тестовые задания. При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179). Задания, в которых из предложенных вариантов ответа только один верный. Правильный ответ - 1 балл; Нет правильного ответа- 0 баллов. Максимальное количество баллов – 20. Весовой коэффициент мероприятия – 0,1	Отлично: Величина рейтинга обучающегося по виду контроля "Текущий контроль" по дисциплине 85-100 % Хорошо: Величина рейтинга обучающегося по виду контроля "Текущий контроль" по дисциплине 75-84 % Удовлетворительно: Величина рейтинга обучающегося по виду контроля "Текущий контроль" по дисциплине 60-74 % Неудовлетворительно: Величина рейтинга обучающегося по виду контроля "Текущий контроль" по дисциплине 0-59 %
Решение задач по определению курсовой стоимости и доходности операций с ценными бумагами	Студенту выдается задание по пройденному материалу. При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179) При оценке решения задач учитываются следующие	Отлично: Величина рейтинга обучающегося по виду контроля "Текущий контроль" по дисциплине 85-100 % Хорошо: Величина рейтинга обучающегося по виду контроля "Текущий контроль" по дисциплине 75-84 %

	<p>критерии: 1. Понимание логики конкретного документа и способность в нем ориентироваться. Есть понимание - 2 балла; Нет понимания – 0 балл 2. Обоснование и качество оформления решения. Учтены параметры оформления задачи - 1 балл; Не учтены - 0 баллов. Максимальное количество баллов – 3. Весовой коэффициент мероприятия – 0,1</p>	<p>Удовлетворительно: Величина рейтинга обучающегося по виду контроля "Текущий контроль" по дисциплине 60-74 % Неудовлетворительно: Величина рейтинга обучающегося по виду контроля "Текущий контроль" по дисциплине 0-59 %</p>
Зачет	<p>На зачете происходит оценивание учебной деятельности обучающихся по дисциплине на основе полученных оценок за контрольно-рейтинговые мероприятия текущего контроля и промежуточной аттестации. При оценивании результатов учебной деятельности обучающегося по дисциплине используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. №179) Зачет проводится в форме итогового тестирования.</p>	<p>Зачтено: рейтинг обучающегося больше или равен 60 % Не зачтено: рейтинг обучающегося менее 60 %</p>
Контрольно-рейтинговое мероприятие промежуточной аттестации	<p>Эссе представляет собой письменное научное произведение (исследование) короткой формы 1,5-3 страниц текста, оформленного по правилам курсовых работ. Эссе содержательно представляет собой ответы на вопросы: 1. Что это? В чем суть экономического явления? 2. Каково его современное состояние? 3. Каковы перспективы его развития? 4. Какие автор сделал выводы? Примерная структура эссе: 1. Название темы. 2. Цель. 3. Актуальность. 4. Экономическое содержание явления. 5. Анализ экономической проблемы. 6. Перспективы развития экономического явления. 7. Выводы и предложения (рекомендации) автора по стимулированию развития. 8. Список литературы и концевые сноски. При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179). Критерии начисления баллов: 1. Четкая структура эссе: эссе структурировано (соблюдены вводная часть, основная и заключение), нет замечаний – 2 балла; есть замечания – 1 балл. 2. Проблема раскрыта на теоретическом уровне, в связях и обоснованиях (перечислены 2-3 точки зрения различных авторов, отстаивающих различные мнения), с корректным</p>	<p>Отлично: Величина рейтинга обучающегося по промежуточной аттестации 85-100 % Хорошо: Величина рейтинга обучающегося по промежуточной аттестации 75-84 % Удовлетворительно: Величина рейтинга обучающегося по промежуточной аттестации 60-74 % Неудовлетворительно: Величина рейтинга обучающегося по промежуточной аттестации 0-59 %</p>

	<p>использованием научных терминов и понятий в контексте ответа перечислены точки зрения различных авторов – 2 балла; использование терминов и понятий в контексте ответа – 1 балл; отсутствие указанного критерия - 0 баллов. 3. Сформулировано собственное мнение с учетом наиболее проработанного взгляда на решение проблемы: информация обобщена – 3 балла; субъективное суждение – 3 балла; отсутствие собственного мнения (точки зрения) – 0 баллов. 4. Объем эссе от 1,5 до 3 страниц: учтены параметры – 1 балл; не учтены параметры – 0 баллов. Максимальное количество баллов – 8 Весовой коэффициент мероприятия – 0,4</p>	
--	--	--

7.3. Типовые контрольные задания

Вид контроля	Типовые контрольные задания
<p>Выполнение тестовых заданий по теме 1-3</p>	<p>1. Частью финансового рынка является рынок: А. денежный Б. реальных активов В. ценных бумаг Г. капиталов Д. А, В, Г Е. А, Б, В</p> <p>2. Курсовая стоимость ценных бумаг: А. не имеет жесткой привязки к стоимости действительного капитала Б. соответствует определенной стоимости реального капитала В. всегда соответствует их номинальной стоимости</p> <p>3. К основным ценным бумагам относятся: А. облигации Б. акции В. коносаменты Г. все вышеперечисленное</p> <p>4. Превращение сбережений в обращаемые ценные бумаги называется...</p> <p>5. Рынки ценных бумаг по признаку эмитента подразделяются: А. федеральные Б. государственные В. корпоративные Г. банковских компаний Д. местные Е. А и Д Ж. Б,В,Г</p> <p>6. Отличие германской модели фондового рынка заключается в том, что основными участниками рынка являются: А. банковские организации Б. брокерские компании В. как банковские организации, так и брокерские компании</p> <p>7. Функция рынка ценных бумаг, позволяющая инвесторам при помощи ряда приемов страховать свои финансовые и товарные активы: А. инвестиционная Б. функция диверсификации</p>

- В. хеджирования
Г. управления
8. Физическое лицо на рынке ценных бумаг может выполнять функции:
А. инвестора
Б. профессионального участника рынка ценных бумаг
В. организатора торговли на рынке ценных бумаг
Г. эмитента
9. Банк России лицензирует следующие виды профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг:
А. по управлению ценными бумагами
Б. дилерскую
В. по ведению реестров владельцев ценных бумаг
Г. форекс-дилер
Д. А и В
Е. все вышеперечисленное
10. В соответствии с законодательством РФ деятельность по ведению реестра владельцев ценных бумаг с другими видами профессиональной деятельности:
А. совмещается только с депозитарной деятельностью
Б. совмещается
В. не совмещается
11. В России ценными бумагами являются:
А. инвестиционные паи
Б. векселя
В. долговые расписки
Г. облигации
Д. закладные
Е. А, Б, Г, Д
Ж. А, Б, Г
12. Ордерными ценными бумагами являются:
А. переводные векселя, простые векселя, чеки
Б. депозитные сертификаты, чеки
В. чеки, акции
Д. государственные ценные бумаги
13. Акция является:
А. документом, удостоверяющим право ее владельца на получение части прибыли акционерного общества
Б. долговым обязательством
В. долевым ценной бумагой
Г. А и В
Д. А и Б
14. Облигации право на участие в управлении эмитентом:
А. дают, если это право предусмотрено условиями эмиссии
Б. дают
В. дают, если это записано в уставе
Г. не дают
15. Номинальная стоимость всех выпущенных акционерным обществом облигаций превышать его оплаченный уставный капитал:
А. не может
Б. может
В. может только в случае наличия обеспечения, предоставленного третьими лицами
16. По признаку эмитента выделяют следующие виды ценных бумаг:
А. государственные и банковских компаний
Б. федеральные и региональные

	<p>В. государственные и негосударственные Г. федеральные, региональные, местные 17. Негосударственные ценные бумаги выпускаются: А. частными лицами Б. банками В. компаниями Г. все вышеперечисленное 18. Передача ордерных ценных бумаг осуществляется с помощью передаточной надписи – ... 19. Решение о выпуске облигаций принимается: А. высшим органом управления АО Б. Общим собранием акционеров В. Советом директоров АО 20. Эмитент должен представить отчет об итогах выпуска ценной бумаги не позднее: А. шести месяцев после завершения ее размещения Б. двух месяцев после завершения ее размещения В. одного месяца после завершения ее размещения Вариант 1.doc; Вариант 2.doc</p>
<p>Решение задач по определению курсовой стоимости и доходности операций с ценными бумагами</p>	<p>Задача 1. Акция приобретена 1 марта текущего года по цене 100 руб. и продана 11 января следующего года по цене 150 руб. Дивиденды были получены 15 апреля текущего года в размере 50 руб. на акцию. Период владения акцией составляет 316 дней (305 + 11). Найти конечную доходность за этот период. Задача 2. Уставный капитал в 1 млн. руб. разделен на привилегированные акции (25%) и обыкновенные (75%) одной номинальной стоимости в 100 руб. По привилегированным акциям дивиденд установлен в размере 14% к номинальной стоимости. Какие дивиденды могут быть объявлены по обыкновенным акциям, если на выплату дивидендов совет директоров рекомендует направить 110 тыс. руб. чистой прибыли? Задача 3. Компания выплачивает ежеквартальный дивиденд в размере 1,5 ден. ед. на одну акцию номиналом 50 ден. ед. и рыночной стоимостью в начале года 96 ден. ед. Рыночная цена акции в течение года не изменилась. Определить доходность акции. Задача 4. Оцените привилегированную акцию, по которой выплачивается ежеквартальный дивиденд в размере 0,50 руб. Номинал акции 10 руб. Альтернативные инвестиции могут быть сделаны под 24% годовых. Задача 5. Оцените привилегированную акцию номинальной стоимостью 10 руб. и ставкой дивиденда в 50% от номинала, если выплата дивидендов производится один раз в год, а ставка рыночной капитализации составляет 30%. Задачи Акции, Облигации.doc</p>
<p>Зачет</p>	<p>Вопросы для подготовки к зачету по дисциплине «Рынок ценных бумаг» 1. Финансовый рынок: сущность, структура и значение в экономике. 2. Рынок ценных бумаг: сущность, функции, структура. 3. Понятие и свойства ценной бумаги. 4. Классификация ценных бумаг. 5. Акция: понятие, свойства, виды. 6. Курсовая стоимость акции и факторы, ее определяющие. Доход и доходность акций. 7. Облигация: понятие, свойства, виды. 8. Процедура эмиссии облигаций. 9. Государственные ценные бумаги: понятие, цели выпуска, виды.</p>

	<p>10. Вексель: понятие, виды, особенности обращения.</p> <p>11. Чек: понятие, свойства, виды.</p> <p>12. Депозитные и сберегательные сертификаты: сравнительная характеристика.</p> <p>13. Стоимостные характеристики долговых ценных бумаг.</p> <p>14. Производные финансовые инструменты: появление и развитие, основные характеристики, цели выпуска.</p> <p>15. Механизм обращения фьючерсных и опционных контрактов.</p> <p>16. Международные ценные бумаги: сущность, виды, цели выпуска.</p> <p>17. Состав и характеристика субъектов рынка ценных бумаг.</p> <p>18. Операционная инфраструктура рынка ценных бумаг.</p> <p>19. Брокерская и дилерская деятельность на фондовом рынке.</p> <p>20. Деятельность по управлению ценными бумагами и форекс-дилера на рынке ценных бумаг.</p> <p>21. Депозитарная и деятельность по ведению реестра владельцев ценных бумаг.</p> <p>22. Сущность инвестиционной деятельности на рынке ценных бумаг. Типы инвесторов.</p> <p>23. Принципы функционирования инвестиционных компаний и фондов.</p> <p>24. Портфельное инвестирование на рынке ценных бумаг и показатели его эффективности.</p> <p>25. Деятельность коммерческого банка на рынке ценных бумаг.</p> <p>26. Фондовая биржа: понятие, признаки, функции, классификация.</p> <p>27. Характеристика условий обращения ценных бумаг на бирже.</p> <p>28. Виды биржевых поручений (приказов). Сущность и механизм биржевой котировки.</p> <p>29. Организация и содержание биржевой торговли. Способы биржевых торгов.</p> <p>30. Фондовые индексы: понятие, назначение, виды и методы расчёта.</p> <p>31. Фундаментальный анализ на рынке ценных бумаг и его содержание.</p> <p>32. Технический анализ биржевого рынка: сущность, цели, методы.</p> <p>33. Государственное регулирование рынка ценных бумаг в РФ: цели, принципы, методы.</p> <p>34. Нормативная база функционирования рынка ценных бумаг.</p> <p>35. Рынок ГКО/ОФЗ: история появления, темпы развития рынка, основные характеристики ценных бумаг.</p> <p>36. Современные тенденции развития рынка ценных бумаг в России</p> <p>Итоговый тест Рынок ценных бумаг -Менеджмент.docx; Вопросы к зачету.docx</p>
<p>Контрольно-рейтинговое мероприятие промежуточной аттестации</p>	<p>Перечень тем для написания эссе</p> <p>1. Количественная и качественная характеристика состояния рынка производных финансовых инструментов в РФ в настоящее время.</p> <p>2. Ключевые проблемы развития рынка производных финансовых инструментов в РФ.</p> <p>3. Основные этапы развития рынка производных финансовых инструментов в РФ.</p> <p>4. Способы использования кредитных производных финансовых инструментов.</p> <p>5. Способы использования процентных производных инструментов.</p> <p>6. Фьючерсы на фондовые индексы: зарубежная и отечественная практика использования.</p> <p>7. Использование стандартных срочных контрактов в управлении финансовыми рисками предприятия.</p> <p>8. Применение свопов для защиты от кредитных рисков.</p>

9. Проблемы развития механизма хеджирования ценовых рисков в товарном сегменте рынка производных финансовых инструментов в России.
10. Современные тенденции в развитии биржевого рынка производных финансовых инструментов.
11. Современные тенденции в развитии внебиржевого рынка производных финансовых инструментов.
12. Трансформация внебиржевых рынков: от модели двусторонних контрактов к модели с центральным контрагентом.
13. Принципы ценообразования во фьючерсной торговле.
14. Принципы ценообразования в торговле опционами.
15. Правила определения величины первоначальной маржи во фьючерсной торговле.
16. Финансовые риски, связанные с операциями на рынке производных.
17. Управление рисками контрагента на внебиржевом рынке с двусторонними контрактами.
18. Управление рисками ликвидности на биржевом и внебиржевом рынке с центральным контрагентом.
19. Система гарантирования сделок на фьючерсном рынке.
20. Порядок взаиморасчетов на опционных и фьючерсных биржах.
21. Причины и механизм приостановки торгов на срочной бирже.
22. Эволюция срочной торговли: от модели «опосредованного доступа» к модели «прямого доступа».
23. История создания срочного рынка Московской биржи и перспективы его развития.
24. Инструменты и технологии срочного рынка Московской биржи.
25. Регулирование операций с ПФИ посредством рамочного соглашения (ISDA Master Agreement).
26. Институт ликвидационного неттинга и его значение для развития внебиржевого рынка деривативов.
27. Регулирование и особенности функционирования рынка производных финансовых инструментов США.
28. Регулирование и особенности функционирования срочной торговли в Великобритании.
29. Организация торговли на Лондонской международной финансовой фьючерсной и опционной бирже (LIFFE).
30. Организация торговли производными инструментами на Токийской фондовой бирже (TSE).
31. Организация торговли на Европейской бирже (Eurex).
32. Арбитражные стратегии с использованием фьючерсных контрактов.
33. Принципы выбора элементарных и комбинированных стратегий при торговле опционами.
34. Применение коэффициентов чувствительности цены опциона в торговой практике.
35. Формирование опционной позиции с заданными величинами коэффициентов чувствительности цены.
36. Использование фьючерсов для увеличения доходности инвестиций.
37. Арбитражные сделки при торговле фьючерсами на фондовый индекс.
38. Принцип паритета европейских и американских опционов на покупку и на продажу.
39. Подходы к оценке стоимости нестандартных опционов.
40. Международный опыт торговли «погодными» производными.

	<p>41. Подходы к использованию опционов и фьючерсов при формировании консервативного инвестиционного портфеля.</p> <p>42. Подходы к использованию опционов и фьючерсов при формировании агрессивного инвестиционного портфеля.</p> <p>43. Производный финансовый инструмент: товар, ценная бумага, контракт?</p> <p>44. Могут ли производные финансовые инструменты быть объектом инвестиций индивидуального инвестора?</p> <p>45. Бесконтрольный рост объемов рынка производных: существует ли опасность нового финансового кризиса?</p> <p>46. Судебная защита сделок с производными: обеспечение прав участников сделок или нарушение принципов организации срочного рынка?</p> <p>47. Хронология развития рынка производных: взгляды ученых на вопрос о начале его функционирования.</p> <p>48. Взаимосвязь цен наличного и кассового рынка (на основе анализа корреляции фьючерсных и спот-цен на отдельные виды активов по данным Thomson Reuters).</p> <p>49. Модель Блэка-Шоулза: практическая ценность теоретических расчетов.</p> <p>50. Сравнительная характеристика различных подходов к оценке стоимости опционов.</p>
--	---

8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

Печатная учебно-методическая документация

а) основная литература:

Не предусмотрена

б) дополнительная литература:

1. Лялин, В.А. Рынок ценных бумаг [Текст]: учебник / В.А. Лялин, П.В.Воробьев. – 2-е изд., перераб. и доп. – М.: Проспект, 2010.- 400с.- ISBN 978-5-392-01276-3.

2. Рынок ценных бумаг[Текст]: учебное пособие обучающихся заочной формы обучения направления подготовки: 38.03.01 «Экономика» профиль «Финансы и кредит», 38.03.02 «Менеджмент» профиль «Производственный менеджмент на предприятии нефтяной и газовой отрасли» / Е.А. Маслихова, Е.В. Касаткина. – Ижевск: ООО «Принт-2», 2017. – 96 с.– ISBN 978-5-9631-0592-4.

в) отечественные и зарубежные журналы по дисциплине, имеющиеся в библиотеке:

Не предусмотрены

г) методические указания для студентов по освоению дисциплины:

1. Рынок ценных бумаг: Методические указания по выполнению самостоятельной работы для обучающихся очной формы обучения направлений подготовки: 38.03.01 Экономика профиль: (Финансы и кредит), 38.03.02 Менеджмент профиль: (Производственный менеджмент на предприятии нефтяной и газовой отрасли)/сост. Е.А. Маслихова - Нижневартовск, 2017. – 21 с.

из них: учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студента:

1. Рынок ценных бумаг: Методические указания по выполнению самостоятельной работы для обучающихся очной формы обучения направлений подготовки: 38.03.01 Экономика профиль: (Финансы и кредит), 38.03.02 Менеджмент профиль: (Производственный менеджмент на предприятии нефтяной и газовой отрасли)/сост. Е.А. Маслихова - Нижневартовск, 2017. – 21 с.

Электронная учебно-методическая документация

№	Вид литературы	Наименование ресурса в электронной форме	Библиографическое описание
1	Дополнительная литература	Электронно-библиотечная система издательства Лань	Николаева, И.П. Рынок ценных бумаг : учебник / И.П. Николаева. — Электрон. дан. — Москва : Дашков и К, 2018. — 256 с. — Режим доступа: https://e.lanbook.com/book/105563
2	Основная литература	Электронно-библиотечная система Znanium.com	Галанов, В. А. Рынок ценных бумаг : учебник / В. А. Галанов. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : ИНФРА-М, 2021. — 414 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). - ISBN 978-5-16-012443-8. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1146798 .
3	Основная литература	Электронно-библиотечная система Znanium.com	Рынок ценных бумаг : учебник для бакалавров / В. А. Зверев, А. В. Зверева, С. Г. Евсюков, А. В. Макеев. — 2-е изд., стер. — Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2020. — 256 с. - ISBN 978-5-394-03579-1. - URL: https://znanium.com/catalog
4	Дополнительная литература	Электронно-библиотечная система издательства Лань	Газалиев, М. М. Рынок ценных бумаг : учебное пособие / М. М. Газалиев, В. А. Осипов. — Москва : Дашков и К, 2018. — 160 с. — ISBN 978-5-394-02534-1. — URL: https://e.lanbook.com/book/105562

9. Информационные технологии, используемые при осуществлении образовательного процесса

Перечень используемого программного обеспечения:

1. Microsoft-Windows(бессрочно)
2. Microsoft-Office(бессрочно)

Перечень используемых информационных справочных систем:

1. -Консультант Плюс (Нижневартовск)(бессрочно)

10. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Вид занятий	№ ауд.	Основное оборудование, стенды, макеты, компьютерная техника, предустановленное программное обеспечение, используемое для различных

	видов занятий
Лекции	<p>Учебная аудитория 125 с мультимедийным оборудованием. Для самостоятельной работы, проведения занятий лекционного и семинарского типа, текущего контроля и промежуточной аттестации. Настенный экран для проектора, Проектор EPSON EB-W12 LCD projector-1шт Монитор Acer AL 1717 FS-1шт, Рабочая станция Intel Pentium4-1 шт Акустический комплект-1комп. Столы-парты-18 шт., Стулья – 36 шт., Стол преподавателя - 1 шт., Стул мягкий-1шт. Radmin Server 3.4 - № 09/12 от 27.01.12 г - Бессрочно Windows 7 Prof - № 09/12 от 27.01.12 г - Бессрочно RollBack Rx Professional - № 09/12 от 27.01.12 г - Бессрочно Microsoft Office Prof 2013 - № 14/15 от 13.03.15 г. - Бессрочно Информационно-правовая база “КонсультантПлюс” - № 481180/19 от 28.12.18 - 1 год Kaspersky Endpoint Security для Windows - № 58370/ЕКТ2780 от 16.10.17 г. - 2 года Adobe Acrobat Reader - Бесплатное ПО (Proprietary) - Бессрочно Google Chrome - Бесплатное ПО (Proprietary) - Бессрочно Mozilla Firefox - Бесплатное ПО (Proprietary) - Бессрочно Far Manager 2 - Свободное ПО (BSDL) - Бессрочно 7-Zip - Свободное ПО (GNU LGPL) - Бессрочно Учебная аудитория,119 Для самостоятельной работы, проведения занятий лекционного и семинарского типа, текущего контроля и промежуточной аттестации Столы-парты-21 шт., Стулья деревянные – 42 шт., Стол преподавателя -1 шт., Стул мягкий-1шт. Шкаф для документов-1шт</p>
Практические занятия и семинары	<p>Учебная аудитория 125 с мультимедийным оборудованием. Для самостоятельной работы, проведения занятий лекционного и семинарского типа, текущего контроля и промежуточной аттестации. Настенный экран для проектора, Проектор EPSON EB-W12 LCD projector-1шт Монитор Acer AL 1717 FS-1шт, Рабочая станция Intel Pentium4-1 шт Акустический комплект-1комп. Столы-парты-18 шт., Стулья – 36 шт., Стол преподавателя - 1 шт., Стул мягкий-1шт. Radmin Server 3.4 - № 09/12 от 27.01.12 г - Бессрочно Windows 7 Prof - № 09/12 от 27.01.12 г - Бессрочно RollBack Rx Professional - № 09/12 от 27.01.12 г - Бессрочно Microsoft Office Prof 2013 - № 14/15 от 13.03.15 г. - Бессрочно Информационно-правовая база “КонсультантПлюс” - № 481180/19 от 28.12.18 - 1 год Kaspersky Endpoint Security для Windows - № 58370/ЕКТ2780 от 16.10.17 г. - 2 года Adobe Acrobat Reader - Бесплатное ПО (Proprietary) - Бессрочно Google Chrome - Бесплатное ПО (Proprietary) - Бессрочно Mozilla Firefox - Бесплатное ПО (Proprietary) - Бессрочно Far Manager 2 - Свободное ПО (BSDL) - Бессрочно 7-Zip - Свободное ПО (GNU LGPL) - Бессрочно Учебная аудитория,119 Для самостоятельной работы, проведения занятий лекционного и семинарского типа, текущего контроля и промежуточной аттестации Столы-парты-21 шт., Стулья деревянные – 42 шт., Стол преподавателя -1 шт., Стул мягкий-1шт. Шкаф для документов-1шт</p>