

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Саратовский государственный технический университет имени Гагарина Ю.А.»

**Кафедра « Экономическая безопасность и управление
инновациями»**

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

по дисциплине

« С.1.1.19 "Рынок ценных бумаг" »

для специальности

38.05.01 «Экономическая безопасность»

Специализация №1 "Экономико-правовое обеспечение экономической
безопасности"

форма обучения – очная
курс – 4
семестр – 7
зачетных единиц – 4
часов в неделю – 4
всего часов – 144
в том числе:
лекции – 28
коллоквиумы – 8
практические занятия – 36
лабораторные занятия – нет
самостоятельная работа – 72
зачет – нет
экзамен – 7 семестр
РГР – нет
курсовая работа – нет
курсовой проект – нет

Цели и задачи дисциплины

Цель преподавания дисциплины С.1.1.19 «Рынок ценных бумаг» – сформировать у будущих специалистов систему знаний в области функционирования рынка ценных бумаг, а также умений и навыков, позволяющих самостоятельно принимать решения в конкретной экономической среде.

Задачи изучения дисциплины:

- изучение основных категорий рынка ценных бумаг, его структуры и принципов функционирования;
- изучение инфраструктуры рынка ценных бумаг, состава участников, целей и задач их деятельности;
- овладение основами финансовых расчетов по различным видам ценных бумаг: оценка доходности, ликвидности, риска и других характеристик;
- изучение основных законодательных и нормативных актов, работы фондового рынка, сферы и возможности применения конкретных видов ценных бумаг в финансово-хозяйственной деятельности предприятия;
- анализ и прогнозирование тенденций развития рынка ценных бумаг в РФ;
- освоение существующих методик формирования и управления портфелем ценных бумаг.

2. Место дисциплины в структуре ОПОП ВО

Дисциплина С.1.1.19 «Рынок ценных бумаг» входит в Блок С.1 Дисциплины (модули) С.1.1 Базовая часть и тесно связана с дисциплинами С.1.1.14 «Деньги, кредит, банки», С.1.1.15 «Финансы», С.1.2.3. «Финансовая математика». Дисциплина С.1.1.19 «Рынок ценных бумаг» имеет логическую и содержательно-методическую взаимосвязь с дисциплиной С.1.1.22 «Экономическая безопасность».

Теоретические знания и практические навыки, полученные студентами при изучении дисциплины, должны быть использованы в процессе изучения последующих дисциплин по учебному плану, при подготовке курсовых работ и выпускной квалификационной работы, выполнении научных студенческих работ.

3. Требования к результатам освоения дисциплины

Изучение дисциплины направлено на формирование следующих компетенций:

Профессиональные компетенции:

- способен на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитывать экономические показатели, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов (ПК-3);
- способен проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности (ПК-32).

Компетенция	Студент должен:		
	Знать	Уметь	Владеть
ПК-3	- типовые методики и действующую	- применять типовые методики и	- навыками применения типовых

	нормативно-правовую базу по расчету экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов	действующую нормативно-правовую базу по расчету экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов	методик и действующей нормативно-правовой базы по расчету экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов
ПК-32	- методы проведения анализа и оценки возможных экономических рисков на рынке ценных бумаг; - методы составления и обоснования прогнозов динамики развития основных угроз экономической безопасности на рынке ценных бумаг	- применять методы проведения анализа и оценки возможных экономических рисков на рынке ценных бумаг; - применять методы составления и обоснования прогнозов динамики развития основных угроз экономической безопасности на рынке ценных бумаг	- навыками применения методов анализа и оценки возможных экономических рисков на рынке ценных бумаг; - навыками применения методов составления и обоснования прогнозов динамики развития основных угроз экономической безопасности на рынке ценных бумаг

Студент должен знать:

- предметную область, содержание, терминологию рынка ценных бумаг;
- современное законодательство, нормативные документы и методические материалы, регулирующие выпуск и обращение отдельных видов ценных бумаг;
- основные направления профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг и нормативно-правовые основы их регулирования;
- принципы организации торговли на фондовой бирже и особенности функционирования ведущих российских и зарубежных фондовых бирж;
- современные информационные технологии, включая информационно-аналитические системы, профессиональные базы данных и др.

Студент должен уметь:

- анализировать информационные и статистические материалы для оценки и прогнозирования состояния рынка ценных бумаг, используя фундаментальный и технический анализ;
- управлять портфелем ценных бумаг, оценивать его доходность и риски;
- использовать современные методики оценки рыночной стоимости и доходности отдельных видов ценных бумаг.

Студент должен владеть:

- навыками рефлексии и адекватного оценивания своих образовательных результатов;
- ключевыми понятиями, отражающими характер рынка ценных бумаг;

- методиками оценки и управления рисками на рынке ценных бумаг;
- навыками оценки эффективности финансовой деятельности компаний-эмитентов;
- технологией проведения фундаментального и технического анализа рынка ценных бумаг;
- современными методами сбора, анализа и обработки информации на рынке ценных бумаг.

4. Распределение трудоемкости (час.) дисциплины по темам и видам занятий

№ мо-ду-ля	№ неде-ли	№ те-мы	Наименование темы	Часы: Из них в интерактивной форме					
				Всего	Лек-ции	Колок-виум	Лабора-торные занятия	Практи-ческие занятия	СРС
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
1	1-3	1	Сущность ценных бумаг. Основные виды ЦБ.	14	6			2	6
	4,5	2	Основные понятия финансового и фондового рынков.	10	4			2	4
	6	3	Участники РЦБ	8	2			2	6
	7-8	4	Фондовая биржа и организаторы внебиржевого рынка	9	3			2	4
	8-9	5	Регулирование РЦБ	9	2			2	5
	9-10	6	Акции и операции с ними	12	3			4	5
	11	7	Облигации и их виды	9	2			2	5
	12	8	Государственные ценные бумаги.	9		2		2	5
2	13	9	Эмиссия ценных бумаг	8	2			2	4
	14-	10	Вексель и операции с векселями.	9	1	2		2	4
	15-16	11	Вторичные ценные бумаги.	7	1			2	4
	16-17	12	Срочные контракты: форвардные и фьючерсные контракты.	13	1			4	8
	17	13	Вторичный рынок ценных бумаг.	8		2		2	4
	18	14	Тенденции развития российского и мирового финансовых рынков	7	1			2	4

	18	15	Виды рисков на РЦБ.	12		2		4	6
			ВСЕГО:	144	28	8		36	72

5. Содержание лекционного курса

№ темы	Всего часов	№ лекции	Тема лекции. Вопросы, отрабатываемые на лекции	Учебно-методическое обеспечение
1	6	1-3	Сущность ценных бумаг. Понятие ценных бумаг: юридический и экономический подход к ЦБ. История РЦБ в России. Основные виды ЦБ. Кругооборот ценной бумаги. Потребительная стоимость и качество ценной бумаги. Стоимость и цена ценной бумаги. Экономические реквизиты ценной бумаги. Номинал ценной бумаги. Система ценных бумаг. Экономически самостоятельные виды ЦБ. Сроки существования ЦБ. Принадлежность ЦБ..	1-3,5-6,8
2	4	4,5	Основные понятия финансового и фондового рынков. Определение рынка ЦБ и его виды. Место РЦБ. Функции РЦБ. Составные части РЦБ. Эмитенты и инвесторы. Первичные и вторичные рынки.	1-3,4-6,8
3	2	6	Участники РЦБ. Фондовые брокеры и дилеры: их права, функции, особенности допуска к торгам. Управляющие компании и деятельность на РЦБ. Коммерческие банки на РЦБ. Депозитарии, Регистраторы, расчетно-клиринговые организации.	1-3,5-6,8
4	3	7,8	Фондовая биржа и организаторы внебиржевого рынка. Задачи и функции фондовой биржи. Членство в фондовой бирже. Органы управления биржей. Отличие товарных и фондовых бирж. Характеристики биржевых товаров. Внебиржевые фондовые рынки. Организация деятельности фондовых бирж.	1-3,5-6,8
5	2	8-9	Регулирование РЦБ. Понятие, цели и принципы регулирования РЦБ. Государственное регулирование российского РЦБ. Саморегулируемые организации РЦБ. Выпуск и обращение ЦБ. Формы и задачи государственного регулирования РЦБ.	1-3,5-6,8
6	3	9-10	Акции и операции с ними. Общая характеристика. Виды акций. Дивиденды по акциям. И порядок их начисления. Стоимостная оценка акций. Виды цен по акциям. Доходность акций.	1-3,5-6,8
7	2	11	Облигации и их виды. Общая характеристика. Виды облигаций. Стоимостная оценка. Доход	1-3,5-6,8,10

			по облигации. Доходность облигаций.	
9	-	12	Эмиссия ценных бумаг. Понятие об эмиссии. Классификация эмиссии. Организация, порядок и процедура эмиссии ЦБ.	1-3,5-6,8
10	2	13	Вексель и операции с векселями. Возникновение, функции и виды векселей. Вексельное обращение в РФ.	1-3,5-6,8
12	1	14	Срочные контракты: форвардные и фьючерсные контракты. Форвардные, фьючерсные и опционные сделки. Производные ценные бумаги и техника их использования. Формирование портфеля ЦБ и управление им. Хеджирование портфеля ЦБ. Биржевые индексы. Типы портфелей ЦБ. Методы анализа РЦБ. Котировка ценных бумаг.	1-3,5-9
14	1	14	Тенденции развития российского и мирового финансовых рынков. Инвестиционные компании и фонды на РЦБ. Международный финансовый рынок как источник инвестиционных ресурсов. Информационное и техническое обеспечение функционирования РЦБ. Торговые системы.	1-6,8
ВСЕГО:	28	14		

6. Содержание коллоквиумов

№ темы	Всего часов	№ коллоквиума	Тема лекции. Вопросы, отрабатываемые на лекции	Учебно-методическое обеспечение
1	2	3	4	5
8	2	1	Государственные ценные бумаги. Государственный внутренний долг. Погашение и реструктуризация.	1-3,5-6,8
10	2	2	Вексель и операции с векселями. Особенности обращения векселя как ценной бумаги. Вексельные реквизиты.	1-3,5-6,8
13	2	3	Вторичные ценные бумаги. Внебиржевые торги и рынки. Брокерское обслуживание клиентов. Сущность обращения ЦБ.	1-3,5-6,8
14	2	4	Виды рисков на РЦБ. Понятие и виды рисков ЦБ. Хеджирование. Индексы Российского РЦБ. Фундаментальный анализ. Технический анализ. Основные графические методы технического анализа. Торговые системы. Виды рисков в операциях с ценными бумагами.	1-3,5-9
ВСЕГО:	8	4		

7. Перечень практических занятий

№ темы	Всего часов	№ занятия	Тема практического занятия. Вопросы, отрабатываемые на практическом занятии	Учебно-методическое обеспечение
1	2	3	4	5
1	2	1	Сущность ценных бумаг. Основные виды ЦБ. История возникновения ЦБ. Назначение ЦБ, их роль в инвестировании экономики. Классификация ЦБ. Органы, работающие с ЦБ в РФ.	1-3,5-6,8,11-12
2	2	2	Основные понятия финансового и фондового рынков. Изучение понятийного аппарата РЦБ.(эмитент, эмиссионное соглашение, Голубые фишки, Цены открытия и закрытия.	1-3,5-6,8,11-12
3	2	3	Участники РЦБ: брокеры и маклеры, их функции, права, обязанности. Особенности заключения договоров на клиентское обслуживание. Приказ брокеру. Право голоса.	1-3,5-6,8,11-12
4	2	4	Фондовая биржа и организаторы внебиржевого рынка. Отличие товарной и фондовой биржи. Понятие биржевой секции. Брокеры независимые, брокеры торгового зала. Брокерские кредиты.	1-3,5-6,8,11-12
5	2	5	Регулирование РЦБ. Элементы системы государственного регулирования РЦБ. Функции коммерческих банков и функции ЦБ РФ. На бирже. Экономическое и косвенное регулирование РЦБ. Функции органов гос. регулирования РЦБ.	1-3,5-6,8,11-12
6	4	6-7	Акции и операции с ними. Определение и расчет доходов по акциям. Особенности распределения прибыли на дивиденды по различным акциям. Решение задач на определение дохода и доходности по акциям.	1-3,5-6,8,11-12
7	2	8	Облигации и их виды. Расчет показателей доходности по разным видам акций. Решение задач. Операции работы банков с облигациями.	1-3,5-6,8,11-12
8	2	9	Государственные ценные бумаги. Виды ассоциаций участников РЦБ. Порядок включение ЦБ в рыночный процесс. Налогообложение операций с ЦБ в РФ. Модели формирования портфеля ЦБ.	1-3,5-6,8,11-12
9	2	10	Эмиссия ценных бумаг. Рынок ссудных капиталов и его составляющие. Проспект эмиссии. Операции на открытом рынке.	1-3,5-6,8,11-12

			Особенности обращение отдельных видов ЦБ.	
10	2	11	Вексель и операции с векселями. Расчет параметров по векселям разного рода и вида. Учет и переучет векселей.	1-3,5-6,8,11-12
11	2	12	Вторичные ценные бумаги. Вторичные долговые обязательства. Фондовые warrants. Виды депозитар-ных расписок и работа с ними.	1-3,5-6,8,11-12
12	4	13-14	Срочные контракты: форвардные и фьючерсные контракты. Инструменты срочного рынка. Классификации опционов и операции с ними. Валютные фьючерсы. Долгосрочные процентные фьючерсы. Диверсификация портфеля ЦБ.	1-3,5-6,8,11-12
13	2	15	Вторичный рынок ценных бумаг. Коммерческие банки на РЦБ. Внебиржевой и биржевой вторичный рынок. Страхование производных ЦБ.	1-3,5-6,8,11-12
14	2	16	Тенденции развития российского и мирового финансовых рынков. Налогообложение ЦБ. Котировка ЦБ.	1-3,5-6,8,11-12
15	4	17-18	Виды рисков на РЦБ. Определение и принципы технического анализа ЦБ. Индекс Доу-Джонса. Тактика использования портфеля ЦБ.	1-3,5-6,8,11-12
ВСЕГО	36	18		

8. Перечень лабораторных работ

№ темы	Всего часов	Наименование лабораторной работы. Задания, вопросы, отрабатываемые на лабораторном занятии	Учебно-методическое обеспечение
1	2	4	3
		НЕТ	

Задания для самостоятельной работы студентов

№ темы	Всего часов	Вопросы для самостоятельного изучения (задания)	Учебно-методическое обеспечение
1	2	3	4
1	6	Изучение разделов курса: Сущность ценных бумаг. Основные виды ЦБ.	1-3,5-6,8,13-27
2	4	Изучение разделов курса: Фондовая биржа и организаторы вне-биржевого рынка	1-3,5-6,8,13-27
3	6	Изучение разделов курса: Регулирование РЦБ	1-3,5-6,8,13-27

4	4	Изучение разделов курса: Срочные контракты: форвардные и фьючерсные контракты.	1-3,5-6,8,13-27
5	5	Изучение разделов курса: Виды рисков на РЦБ.	1-3,5-6,8,13-27
6	5	Изучение разделов курса: Акции и операции с ними	1-3,5-6,8,13-27
7	5	Изучение разделов курса: Облигации и их виды	1-3,5-6,8,13-27
8	5	Изучение разделов курса: Государственные ценные бумаги.	1-3,5-6,8,13-27
9	4	Изучение разделов курса: Эмиссия ценных бумаг.	1-3,5-6,8,13-27
10	4	Изучение разделов курса: Вексель и операции с векселями.	1-3,5-6,8,13-27
11	4	Изучение разделов курса: Вторичные ценные бумаги.	1-3,5-6,8,13-27
12	8	Изучение разделов курса: Тенденции развития российского и мирового финансовых рынков	1-3,5-6,8,13-27
13	4	Изучение разделов курса: Характеристики вторичного рынка ценных бумаг.	1-3,5-6,8,13-27
14	4	Изучение разделов курса: Виды рисков на РЦБ.	1-3,5-6,8,13-27
15	6	Изучение разделов курса: Тенденции развития российского и мирового финансовых рынков	1-3,5-6,8,13-27
		Подготовка к экзамену.	
ВСЕГО:	72		

Виды СРС

Изучение данной дисциплины предполагает выполнение следующих видов самостоятельной работы студентов:

- выполнение тестовых заданий;
- выполнение курсовой работы по индивидуальному заданию.
- изучение основной и дополнительной литературы.

Контроль и оценка результатов самостоятельной работы студентов предусматривает:

- самоконтроль – регулярная подготовка к занятиям;
- контроль со стороны преподавателя – текущий (еженедельно в течение семестра – посещения лекций и практических занятий, устный опрос, выполнения заданий на практических занятиях, тестирование);
- отчет по докладам (презентациям) студентов.

График контроля СРС

Контроль СРС проводится следующими мероприятиями:

- опрос студентов по темам курса на практических занятиях;
- проверка курсовой работы в период сессии.

ГРАФИК КОНТРОЛЯ СРС

№ не де ли	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	
	В К	О, Д П Д З	О, Д П Д З	О, Д П Д З	О, Д П, Т, Д З	О, Д П Д З	О, Д П Д З	О, Т	А	О, Д П Д З	О, Д П Д З	О, Д П Д З	О, Д П Д З	О, Д П Д З, Т	О, Д П Д З	О, Д П Д З		Т	З

* О-устный опрос, А-межсессионная аттестация, ДЗ-домашнее задание, ДП-доклад, презентация, Т-тестирование, З-зачет

10. Расчетно-графическая работа

нет

11. Контрольная работа

нет

12. Курсовой проект

нет

13. Курсовая работа

13. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине (модулю)

Для аттестации обучающихся на соответствие их персональных достижений поэтапным требованиям освоения дисциплины «Рынок ценных бумаг» (текущий контроль успеваемости и промежуточная аттестация) применяется фонды оценочных средств, включающие типовые задания, задачи, контрольные работы, тесты и методы контроля, позволяющие оценить знания, умения и уровень приобретенных компетенций.

Контрольные задания по дисциплине скомпонованы в виде вопросов для зачета и тестовых заданий.

Ответы на вопросы для зачета и решение тестовых заданий предполагают выполнение студентами простых действий по изложению знаний понятий, определений, терминов, методов, факторов, законов, формул и т.п.

Критерии оценки:

- за выполненное тестовое задание: правильно, неправильно;

- за ответы по вопросам для зачета: зачтено, не зачтено.

Перечень компетенций считается сформированным:

➤ на 50 %, если студент получил по дисциплине «зачет» и ответил правильно на 60% вопросов «тестов» (1 уровень - пороговый);

➤ на 80 %, если студент получил по дисциплине «зачет» и ответил правильно на 80% вопросов «тестов» (2 уровень - продвинутый);

на 100%, если студент получил по дисциплине «зачет» и ответил правильно на 100% вопросов «тестов» (3 уровень - превосходный).

Этап формирования компетенций	Перечень компетенций	Форма контроля	Фонд оценочных средств
1 этап 1-8 неделя	ПК 3, ПК 32	Межсессионная аттестация (Атт/Не атт.)	Устный опрос, решение задач, подготовка презентаций, посещаемость и тестовые задания, выполнение СРС.
2 этап 9-18 неделя	ПК 3, ПК 32	Итоговая аттестация (зачет «зачтено/незачтено»)	Оценивается в виде устного опроса, и тестовых заданий

УРОВНИ ОСВОЕНИЯ КОМПОНЕТ КОМПЕТЕНЦИИ ПК-3

в рамках дисциплины «Рынок ценных бумаг»:

способен на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитывать экономические показатели, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов

Ступени уровней освоения компетенции	Отличительные признаки
Пороговый (удовлетворительный)	<p>Знает: в общем типовые методики и действующую нормативно-правовую базу по расчету экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов.</p> <p>Умеет: частично применять типовые методики и действующую нормативно-правовую базу по расчету экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов.</p> <p>Владеет: частично навыками применения типовых методик и действующей нормативно-правовой базы по расчету экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов.</p>
Продвинутый (хорошо)	<p>Знает: типовые методики и действующую нормативно-правовую базу по расчету экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов.</p> <p>Умеет: применять типовые методики и действующую нормативно-правовую базу по расчету экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов.</p> <p>Владеет: хорошими навыками применения типовых методик и действующей нормативно-правовой базы по расчету экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов.</p>

Высокий (отлично)	<p>Знает: отлично типовые методики и действующую нормативно-правовую базу по расчету экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов.</p> <p>Умеет: свободно применять типовые методики и действующую нормативно-правовую базу по расчету экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов.</p> <p>Владеет: отличными навыками применения типовых методик и действующей нормативно-правовой базы по расчету экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов.</p>
----------------------	---

УРОВНИ ОСВОЕНИЯ КОМПОНЕТ КОМПЕТЕНЦИИ ПК-32

в рамках дисциплины «Рынок ценных бумаг»:

способен проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности

Ступени уровней освоения компетенции	Отличительные признаки
Пороговый (удовлетворительный)	<p>Знает: в общем методы проведения анализа и оценки возможных экономических рисков на рынке ценных бумаг; методы составления и обоснования прогнозов динамики развития основных угроз экономической безопасности на рынке ценных бумаг.</p> <p>Умеет: не в полном объеме применять методы проведения анализа и оценки возможных экономических рисков на рынке ценных бумаг; методы составления и обоснования прогнозов динамики развития основных угроз экономической безопасности на рынке ценных бумаг.</p> <p>Владеет: частично навыками применения методов анализа и оценки возможных экономических рисков на рынке ценных бумаг; навыками применения методов составления и обоснования прогнозов динамики развития основных угроз экономической безопасности на рынке ценных бумаг.</p>
Продвинутый (хорошо)	<p>Знает: методы проведения анализа и оценки возможных экономических рисков на рынке ценных бумаг; методы составления и обоснования прогнозов динамики развития основных угроз экономической безопасности на рынке ценных бумаг.</p> <p>Умеет: применять методы проведения анализа и оценки возможных экономических рисков на рынке ценных бумаг; методы составления и обоснования прогнозов динамики развития основных угроз экономической безопасности на рынке ценных бумаг.</p> <p>Владеет: хорошими навыками применения методов анализа и оценки возможных экономических рисков на рынке ценных бумаг; навыками применения методов составления и обоснования прогнозов динамики развития основных угроз</p>

	экономической безопасности на рынке ценных бумаг.
Высокий (отлично)	<p>Знает: отлично методы проведения анализа и оценки возможных экономических рисков на рынке ценных бумаг; методы составления и обоснования прогнозов динамики развития основных угроз экономической безопасности на рынке ценных бумаг.</p> <p>Умеет: свободно применять методы проведения анализа и оценки возможных экономических рисков на рынке ценных бумаг; методы составления и обоснования прогнозов динамики развития основных угроз экономической безопасности на рынке ценных бумаг.</p> <p>Владеет: отличными навыками применения методов анализа и оценки возможных экономических рисков на рынке ценных бумаг; навыками применения методов составления и обоснования прогнозов динамики развития основных угроз экономической безопасности на рынке ценных бумаг.</p>

Тестовые задания по дисциплине

1. Рынок ценных бумаг является частью рынка
 - 1) финансового
 - 2) денежного
 - 3) капиталов
 - 4) реальных активов
 - 5) банковских кредитов
2. Секьюритизация – это ...
 - 1) защита ценных бумаг от подделки
 - 2) выпуск ценных бумаг под залог каких-либо активов
 - 3) защита инвестора от процентного риска
3. Положения, характеризующие юридические особенности ценных бумаг.
 - 1) Для осуществления закреплённых в ценной бумаге прав необходимо доказательство права на саму ценную бумагу
 - 2) Ценной бумагой может быть удостоверен любой набор прав, определённый эмитентом
 - 3) Ценные бумаги удостоверяют субъективные права
 - 4) Статус ценной бумаги имеет любой документ, соответствующий определению ст. 142 ГК РФ
4. Срочные ценные бумаги – это бумаги ...
 - 1) оплаченные в течение ближайших двух дней после заключения контракта на их покупку
 - 2) оплата которых будет осуществляться через определенное время в будущем
 - 3) выпущенные на определенный срок
 - 4) гасимые
5. Ликвидность ценной бумаги – это ее способность ...
 - 1) приносить доход
 - 2) обращаться на рынке диктуется
 - 3) быстро и с минимальными издержками продаваться и покупаться по равновесной рыночной цене
6. Права, удостоверяемые ценными бумагами, могут принадлежать:
 - 1) Лицу, указанному в ценной бумаге
 - 2) Организации, осуществляющей доверительное управление ценной бумагой
 - 3) Названному в ценной бумаге лицу, которое может само осуществлять эти права или

назначать своим приказом другое лицо

4) предъявителю ценной бумаги

7. Положения, характеризующие экономические особенности ценных бумаг.

1) Ликвидность ценных бумаг определяется рынком и не зависит от обращаемости

2) Надёжность ценных бумаг определяется риском потери вложенных средств

3) Текущая доходность не может быть отрицательной величиной

4) Курсовая доходность не может быть отрицательной величиной

5) Общая доходность может иметь положительное, нулевое и отрицательное значение

8. Положения, характеризующие ценные бумаги в зависимости от вида их базовых активов.

1) Производные финансовые инструменты закрепляют совокупность имущественных и неимущественных прав на любые базовые активы

2) Основные ценные бумаги соответствуют определению ст. 142 ГК РФ

3) Первичные ценные бумаги закрепляют права на базовые активы, в число которых не входят сами ценные бумаги

9. Положения, относящиеся к функциям рынка ценных бумаг.

1) Перераспределение прав собственности на базовые активы

2) Обеспечение предприятий средствами производства

3) Возможность сохранения и увеличения свободных средств инвесторов

4) Сбыт продукции производственных предприятий

10. Первичный рынок ценных бумаг – это рынок, на котором ...

1) первичные дилеры торгуют государственными ценными бумагами

2) эмитент впервые представляет свои ценные бумаги

3) инвестор впервые выходит на фондовый рынок

11. Рынок ценных бумаг классифицируется по видам ценных бумаг и срокам их обращения на ...

1) первичный и вторичный рынок

2) биржевой и внебиржевой рынок

3) денежный рынок и рынок капитала

4) спотовый и срочный рынок

12. Положения, характеризующие рынок ценных бумаг в зависимости от его организованности.

1) Каждый организованный рынок ценных бумаг является биржевым

2) Организованный рынок образуют только лицензированные профессиональные участники рынка ценных бумаг

3) Внебиржевой рынок может быть только неорганизованным

4) Главная задача биржевого рынка – формирование равновесных рыночных цен

5) Неорганизованный рынок образуют и лицензированные, и нелицензированные участники рынка ценных бумаг

13. Ценные бумаги, которые принято относить к инструментам денежного рынка

1) Привилегированные акции

2) Векселя

3) Депозитные сертификаты

4) Среднесрочные облигации

14. Виды рынков ценных бумаг по видам ценных бумаг и срокам их обращения

1) Первичный и вторичный рынок

2) Биржевой и внебиржевой рынок

3) Денежный рынок и рынок капитала

4) Спотовый и срочный рынок

15. Фьючерсные контракты обращаются

1) только на бирже

- 2) только на внебиржевом рынке
 - 3) как на биржевом, так и на внебиржевом рынке
16. Уступка прав требования по именованным депозитам осуществляется посредством
- 1) бланкового индоссамент
 - 2) простого вручения
 - 3) цессией
 - 4) записью в реестре владельцев именованных ценных бумаг
 - 5) именованным индоссаментом
17. В Российской Федерации обязываться векселем могут
- 1) только юридические лица
 - 2) только физические лица
 - 3) юридические и физические лица
18. По российскому законодательству на предъявителя могут быть выписаны
- 1) вексель
 - 2) чек
 - 3) простое складское свидетельство
 - 4) двойное складское свидетельство
 - 5) коносамент
19. Инвестиционный пай предоставляет инвесторам право
- 1) получать дивиденды
 - 2) получать проценты
 - 3) требовать выкупа пая у управляющей компании
 - 4) участвовать в управлении инвестиционным фондом
20. В техническом анализе используются
- 1) трендовые методы
 - 2) финансовый анализ эмитента
 - 3) осцилляторы
 - 4) макроэкономический анализ
 - 5) скользящие средние
22. Главным и последним плательщиком по простому векселю является
- 1) векселедатель
 - 2) акцептант
 - 3) авалист
 - 4) последний индоссант
 - 5) лицо, указанное в векселе в качестве плательщика
23. В Российской Федерации государственное регулирование рынка ценных бумаг осуществляется путем
- 1) установления обязательных требований к деятельности на рынке ценных бумаг и стандартов ее осуществления
 - 2) государственной регистрации выпусков ценных бумаг
 - 3) лицензирования профессиональной деятельности
 - 4) создания системы защиты прав инвесторов на рынке ценных бумаг
 - 5) запрещение деятельности на рынке ценных бумаг в качестве профессиональных участников лицам, не имеющим лицензии
24. Обыкновенная акция дает право
- 1) голоса на общем собрании акционеров
 - 2) вернуть вклад в уставный капитал акционерного общества
 - 3) получить часть всех активов общества при его ликвидации
 - 4) на часть чистой прибыли общества
 - 5) получать информацию о финансовом состоянии общества
25. Эмиссионная цена облигации может быть
- 1) равна номиналу

- 2) ниже номинала
 - 3) выше номинала
26. Акцепт необходим для
- 1) переводного векселя
 - 2) простого векселя
 - 3) чека
 - 4) депозитного сертификата
27. Выставлять котировки ценных бумаг имеют право
- 1) фондовые биржи
 - 2) дилеры
 - 3) брокеры
 - 4) расчетные депозитарии
 - 5) внебиржевые организаторы торговли
29. При покупке колл-опциона
- 1) держатель опциона играет на повышение, а надписатель – на понижение
 - 2) держатель опциона играет на понижение, а надписатель – на повышение
 - 3) держатель и надписатель играют на повышение
 - 4) держатель и надписатель играют на понижение
29. Конвертируемые облигации – это облигации, которые
- 1) могут быть обменены на акции
 - 2) обеспечивают получение дохода в свободно конвертируемой валюте
 - 3) обеспечивают индексацию номинала в соответствии с изменениями курса национальной валюты к свободно конвертируемой валюте
30. По российскому законодательству на предъявителя могут быть выписаны
- 1) вексель
 - 2) чек
 - 3) банковская сберегательная книжка
 - 4) складское свидетельство
 - 5) закладная
31. На российских фондовых биржах сделки заключать могут
- 1) любые продавцы и покупатели ценных бумаг, включенных в число обращающихся на данной бирже
 - 2) любые профессиональные участники рынка ценных бумаг
 - 3) только банки – профессиональные участники рынка ценных бумаг
 - 4) только брокеры, дилеры и управляющие
32. Андеррайтер ценных бумаг выполняет функцию
- 1) поддержки курса ценной бумаги
 - 2) гарантирования выполнения обязательств по ценным бумагам
 - 3) выкупа всего или части выпуска
 - 4) подготовки проспекта ценных бумаг
 - 5) спекулятивной игры на вторичном рынке в пользу эмитента
33. Отдельные выпуски эмиссионных ценных бумаг от процедуры государственной регистрации освобождаются
- 1) могут
 - 2) не могут
 - 3) могут, если они размещаются по закрытой подписки
 - 4) могут, если не требуется регистрация проспекта эмиссии
34. Что относится к операциям на рынке ценных бумаг?
- 1) сплит;
 - 2) спред;
 - 3) рендит.

35. Установленная законом последовательность действий эмитента по размещению эмиссионных ценных бумаг— это:

- 1) эмиссия,
- 2) сплит;
- 3) клиринг.

36. Листинг — это:

- 1) список членов фондовой биржи,
- 2) котировка акций,
- 3) включение ценных бумаг в котировальный список.

37. Что такое «эмиссионный доход» акционерного общества?

- 1) разница между номинальной стоимостью акции и ценой ее фактической продажи на вторичном рынке;
- 2) доход от продажи акций при первичной эмиссии по ценам выше номинала
- 3) доход от продажи акций, который получает посредник, осуществляющий размещение акций на основе договора с эмитентом

38. Делистинг — это:

- 1) включение ценных бумаг в котировальный список;
- 2) исключение ценных бумаг из котировального списка
- 3) список членов фондовой биржи

39. Отчуждение эмитентом ценных бумаг их первым владельцам путем заключения гражданско-правовых сделок — это

- 1) эмиссия
- 2) размещение ценных бумаг;
- 3) клиринг

40. Операция по обмену ценных бумаг, ведущая к получению иных прав и возможностей, — это:

- 1) конвертация
- 2) обращение
- 3) клиринг

Типовые задания

1. Составьте список факторов, влияющих на рынок ценных бумаг.
2. Объясните отличительные особенности различных видов ценных бумаг.
3. Приведите примеры эффективного и неэффективного портфеля ценных бумаг.
4. Систематизируйте этапы развития рынка ценных бумаг.
5. Покажите взаимосвязь первичного и вторичного рынка ценных бумаг.
6. Разработайте план эмиссии акций на предприятии.
7. Обоснуйте выбор источников и средств сбора информации на рынке ценных бумаг.
8. Проведите анализ рисков на рынке ценных бумаг с точки зрения экономической безопасности.
9. Оцените значимость рынка ценных бумаг для экономической безопасности.
10. Подготовьте аналитический отчет о динамике фондовых индексов.

Критерии оценки

Итоговая оценка знаний по дисциплине «Рынок ценных бумаг» выставляется в ходе экзамена. При этом используется следующие критерии:

Оценка «отлично»:

1. Студент выполнил в полном объеме и в установленные сроки все задания по учебному курсу в рамках программы дисциплины.

2. В процессе ответа на экзаменационные вопросы демонстрирует глубокое понимание сущностных основ, понятий и характера работы финансовых методов.

3. Студент свободно и полно формулирует основные понятия и определения дисциплины «Рынок ценных бумаг». Делает самостоятельные и обоснованные выводы.

4. Студент свободно формулирует ответы на все дополнительные вопросы по дисциплине.

Оценка «хорошо» :

1. Студент выполнил основной объем и в установленные строки задания по учебному курсу в рамках программы дисциплины.

2. Студент формулирует основные понятия и определения дисциплины «Рынок ценных бумаг». Умеет делать выводы.

3. Студент формулирует ответы на дополнительные вопросы по дисциплине.

Оценка «удовлетворительно» :

1. Студент выполнил основные задания по учебному плану в рамках программы дисциплины.

2. Студент формулирует основные понятия и определения дисциплины «Рынок ценных бумаг».

Вопросы для зачета

нет

Вопросы для экзамена

1. Сущность рынка ценных бумаг и его место в экономической системе страны.
2. Сущность, функции и виды рынков ценных бумаг.
3. Основные участники рынка ценных бумаг.
4. Понятие и сущность ценных бумаг.
5. Классификация ценных бумаг.
6. Ценные бумаги с фиксированным доходом.
7. Акции и их отличия от других ценных бумаг.
8. Основные стоимостные характеристики акций.
9. Сущность облигаций и их отличие от других ценных бумаг.
10. Доходы, получаемые по акциям и облигациям.
11. Доходность акций и облигаций.
12. Текущая стоимость облигаций.
13. Производные ценные бумаги: понятие и виды.
14. Вексель: сущность, виды, оценка.
15. Депозитные и сберегательные сертификаты.
16. Опционы и варранты: их сущность, сходства и различия.
17. Понятие и виды государственных ценных бумаг.
18. Виды государственных ценных бумаг на российском рынке.
19. Муниципальные ценные бумаги.
20. Фьючерсы: сущность, основные черты, направления использования.
21. Форвардные контракты: сущность, основные черты и направления их использования.
22. Типы опционов, их характеристики.
23. Первичный рынок ценных бумаг.
24. Инвестиционные компании на первичном рынке.

25. Эмиссия ценных бумаг.
26. Андеррайтинг: понятие, виды и его функции.
27. Вторичный рынок ценных бумаг.
28. Организованный внебиржевой рынок ценных бумаг.
29. Неорганизованный внебиржевой рынок ценных бумаг.
30. Фондовая биржа, понятие и признаки классической фондовой биржи.
31. Листинг и делистинг на фондовой бирже.
32. Организационная структура фондовой биржи.
33. Торговая система биржевого рынка.
34. Профессиональные участники рынка ценных бумаг.
35. Депозитарно-регистраторский механизм на рынке ценных бумаг.
36. Биржевые индексы.
37. Понятие фондовой сделки.
38. Виды фондовых сделок и их сущность.
39. Короткие продажи ценных бумаг.
40. Сущность покупки ценных бумаг с маржей.
41. Государственное регулирование рынка ценных бумаг.
42. Механизм принятия решений на рынке.
43. Сущность фундаментального анализа.
44. Назначение, роль и задачи технического анализа.
45. Рынок ценных бумаг в России: его история, настоящее и будущее.

14. Образовательные технологии

В целях реализации задач, поставленных в рамках изучения дисциплины «Рынок ценных бумаг», настоящей рабочей программой предусмотрено использование в учебном процессе следующих образовательных технологий:

- мультимедиа-технологии (презентационный материал, видеоматериалы), как демонстративное средство для представления и изучения материала;
- средства контроля знаний (тестирование);
- групповая работа (тренинги, групповое решение задач);
- игровые технологии (решение кейсов, разбор типовых ситуаций);

В соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки реализация компетентностного подхода должна предусматривать широкое использование в учебном процессе активных и интерактивных форм проведения занятий.

15. ПЕРЕЧЕНЬ УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (позиции раздела нумеруются сквозной нумерацией и на них осуществляются ссылки из 5-13 разделов)

1. *Обязательные издания. Библиотека 1 печатное издание на 2-х студентов + электронная библиотека*
1. Асаул, А. Н. Основы бизнеса на рынке ценных бумаг [Текст] : учебник / Асаул А. Н. - Санкт-Петербург : Институт проблем экономического возрождения, 2013. - 202 с. Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/18202>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю

2. Кузнецов Б.Т. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс]: учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальности «Финансы и кредит»/ Кузнецов Б.Т.— Электрон. текстовые данные.— М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2012.— 288 с.
Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/8577>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю
3. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс] : учебник / В.А. Лялин, П.В.Воробьев. - 2-е изд., перераб. и доп. - М. : Проспект, 2015.— 400 с.
Режим доступа: <http://www.studentlibrary.ru/book/ISBN9785392163915.html>

2. *Дополнительные издания. Библиотека 1 печатное издание на 4-х студентов + электронная библиотека*

4. Алиев А.Т. Управление инвестиционным портфелем [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Алиев А.Т., Сомик К.В.— Электрон. текстовые данные.— М.: Дашков и К, 2015.— 159 с.
Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/52274>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю
5. Бабенчук К.А. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Бабенчук К.А.— Электрон. текстовые данные.— Самара: Самарский государственный архитектурно-строительный университет, ЭБС АСВ, 2012.— 90 с.
Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/20510>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю
6. Галанов, В. А. Рынок ценных бумаг : учебник / В. А. Галанов ; Рос. экон. акад. им. Г. В. Плеханова (Москва). - М. : ИНФРА-М, 2007. - 379 с. : ил. ; 22 см. - Библиогр.: с. 378. - Гриф: допущено М-вом образования и науки РФ в качестве учебника для студ. вузов, обучающихся по спец. 080105 "Финансы и кредит", 080109 "Бухгалтерский учет, анализ и аудит", 080102 "Мировая экономика". - ISBN 978-5-16-0028 69-9
Экземпляров всего: 50
7. Одинцов, А. А. Экономическая и информационная безопасность предпринимательства : учеб. пособие / А. А. Одинцов. - 2-е изд., испр. и доп. - М. : ИЦ "Академия", 2008. - 336 с.
Экземпляров всего: 20
8. Правовое регулирование рынка ценных бумаг [Электронный ресурс] : учебник / Селивановский А.С. - М. : ИД Высшей школы экономики, 2014. - (Учебники Высшей школы экономики). — 580 с.
Режим доступа: <http://www.studentlibrary.ru/book/ISBN9785759810834.html>
9. Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент : учеб. / А. Н. Фомичев. - 2-е изд. - М. : ИТК "Дашков и К", 2009. - 376 с.
Экземпляров всего: 10
10. Фрэнк Дж. Фабозци Рынок облигаций [Электронный ресурс]: анализ и стратегии/ Фрэнк Дж. Фабозци— Электрон. текстовые данные.— М.: Альпина Паблишер, 2016.— 950 с.
Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/41375>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю
11. Янукян, М. Г. Практикум по рынку ценных бумаг : учеб. пособие / М. Г. Янукян. - 2-е изд., доп. и перераб. - СПб. [и др.] : Питер, 2009. - 224 с. : ил. ; 21 см. - (Учебное пособие). - Библиогр.: с. 214-216 (45 назв.) . - Гриф: рек. УМО по образов. в обл. финансов, учета и мировой экономики в качестве учеб. пособия для студ., обучающихся по спец. "Финансы и кредит".
Экземпляры всего: 15

3. *Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)*

12. Методические указания к практическим занятиям, выполнению РГР и СРС для обучающихся по освоению дисциплины «Рынок ценных бумаг» размещены в ИОС СГТУ имени Гагарина Ю.А.

4. *ПЕРИОДИЧЕСКИЕ ИЗДАНИЯ*

Журналы:

13. Деньги и кредит: теоретический, научно-практический журнал / Гл ред. В.С. Палевич. – Москва: ООО «Полиграфический комплекс ТОЧКА», (2012-2016), № 1 – 12. - ISSN 0130-3090
Режим доступа: http://elibrary.ru/title_about.asp?id=8647
14. Управление риском : аналит. журн. / Гл ред. Р.Т. Юлдашев.- М. : ООО "Анкил". - (2012-2016), № 1 – 4. - ISSN 1684-6303
Режим доступа: http://elibrary.ru/title_about.asp?id=9195
15. Экономика и управление: российский научный журнал / Гл ред. В.А. Гневко. – С/Пб: Издательство Санкт-Петербургского Университета, (2012-2016), № 1 – 12. - ISSN 1998-1627
Режим доступа: http://elibrary.ru/title_about.asp?id=9270

5. Интернет-ресурсы

16. Центральный Банк РФ <http://www.cbr.ru>
17. Правительство Российской Федерации <http://www.pravitelstvo.gov.ru/>
18. Министерство финансов РФ <http://minfin.ru/ru/>
19. Федеральная служба государственной статистики <http://www.gks.ru/>
20. ММВБ — Московская межбанковская валютная биржа <http://www.micex.ru/>
21. МФБ - Московская фондовая биржа <http://www.mse.ru/>
22. Фондовая биржа Санкт-Петербург — Некоммерческое партнерство «Фондовая биржа Санкт-Петербург» <http://www.spbex.ru/np/main.stm>
23. РТС (Российская Торговая Система) <http://www.rts.ru/>
24. НАУФОР - Национальная Ассоциация Участников Фондового Рынка <http://www.naufor.ru/>

6. Источники ИОС

25. Лекции, презентации, учебные пособия, глоссарий, методические указания к практическим занятиям, лабораторным работам и СРС размещены в ИОС СГТУ имени Гагарина Ю.А.
https://portal.sstu.ru/Fakult/FEM/PEI/ekb1o_b046/default.aspx

7. Профессиональные Базы Данных

26. Информационная справочная система «Гарант»
<http://www.garant.ru/?gclid=CNXC1YnHjMcCFUKWtAodQpEFHg>
27. Информационная справочная система «КонсультантПлюс»
http://www.consultant.ru/cabinet/archive/fd/?utm_campaign=attract_readers&utm_source=google.adwords&utm_medium=cpc&utm_term=nov09&utm_content=13&gclid=CJTC763HjMcCFeLacgodzVQFdQ

8. *Печатные и электронные образовательные ресурсы в формах адаптированных для студентов с ограниченными возможностями здоровья (для групп и потоков с такими студентами)*

Не предусмотрены

9. *Ресурсы материально-технического и учебно-методического обеспечения, предоставляемые организациями-участниками образовательного процесса (сетевая форма, филиал кафедры на предприятии)*

Не предусмотрены

16. Материально-техническое обеспечение дисциплины

№ п/п	Наименование дисциплины (модуля), практик в соответствии с учебным планом	Наименование специальных* помещений и помещений для самостоятельной работы	Оснащенность специальных помещений и помещений для самостоятельной работы	Перечень лицензионного программного обеспечения. Реквизиты подтверждающего документа
	С.1.1.19 Рынок ценных бумаг	Учебная аудитория для проведения занятий лекционного и семинарского типа, компьютерный класс (центр (класс) деловых игр), библиотека Аудитория для лабораторных занятий	Столы и стулья Компьютер M3N78-EMH HDMI/4800+ Телевизор тип 2 ЖК LED 47"(119 см) Philips 47PFS7309/60 Проектор Acer PD-527D , экран для проектора Projecta Compact Electrol. Библиотечно-информационная система Компьютеры с подключением к сети «Интернет», интерактивная доска прямой проекции TRIUMPH BOARD TOUCH 78 (ТВ 781690) , экран Projecta Compact Electrol, доступ в электронную информационно-образовательную среду	Windows XP (младше Windows 7) Microsoft Open License 42214052 от 25 мая 2007 года Windows 7 номера лицензий Microsoft Open License 47795069, 47732637, 61260085 Kaspersky Endpoint Security для Windows номер лицензии: 1150-140620-13222 Microsoft Office Профессиональный плюс 2007 номер лицензии Microsoft Open License 42214052 от 25 мая 2007 года

Для проведения лекций используется лекционная аудитория, оснащенная мультимедийным оборудованием. Для проведения практических занятий используется компьютерный класс с выходом в сеть Интернет, в электронно-библиотечную систему технического ВУЗа, в ЭБС «IPRbooks», оснащенными электронными учебными пособиями и тестами. В аудитории имеется необходимое программное обеспечение.

Для оформления письменных работ, презентаций к докладу имеются пакеты программ Microsoft Office (Excel, Word, Power Point, Acrobat Reader), Internet Explorer.

Информационное и учебно-методическое обеспечение образовательной деятельности по дисциплине «Рынок ценных бумаг» включает электронно-библиотечную систему и электронную информационно-образовательную среду СГТУ имени Гагарина Ю.А., использование наглядных пособий.