

Документ подписан простой электронной подписью.

Информация о владельце:

ФИО: Кандрашина Елена Александровна

Должность: И.о. ректора ФГАОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 15.06.2022 13:54:39

Уникальный программный ключ:

2db64eb9605ce27edd3b8e8fdd32c70e0674ddd2

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный экономический университет»

Институт Институт национальной и мировой экономики

Кафедра Экономической теории

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета

(протокол № 9 от 31 мая 2022 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Наименование дисциплины Б1.В.10 Рынок ценных бумаг

Основная профессиональная образовательная программа 38.03.01 Экономика программа Ценные бумаги и финансовые технологии

Квалификация (степень) выпускника Бакалавр

Самара 2022

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный экономический университет»**

Институт Институт национальной и мировой экономики
Кафедра Экономической теории

АННОТАЦИЯ

Наименование дисциплины Б1.В.10 Рынок ценных бумаг

Основная профессиональная образовательная программа 38.03.01 Экономика программа Ценные бумаги и финансовые технологии

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный экономический университет»**

Институт Институт национальной и мировой экономики
Кафедра Экономической теории

УТВЕРЖДЕНО
Ученым советом Университета
(протокол № 9 от 31 мая 2022 г.)

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ
ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ**

Наименование дисциплины	Б1.В.10 Рынок ценных бумаг
Основная профессиональная образовательная программа	38.03.01 Экономика программа Ценные бумаги и финансовые технологии

Содержание (рабочая программа)

Стр.

- 1 Место дисциплины в структуре ОП
- 2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 3 Объем и виды учебной работы
- 4 Содержание дисциплины
- 5 Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины
- 6 Фонд оценочных средств по дисциплине

Содержание (ФОС)

Стр.

- 6.1 Контрольные мероприятия по дисциплине
- 6.2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 6.3 Паспорт оценочных материалов
- 6.4 Оценочные материалы для текущего контроля
- 6.5 Оценочные материалы для промежуточной аттестации
- 6.6 Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

Целью изучения дисциплины является формирование результатов обучения, обеспечивающих достижение планируемых результатов освоения образовательной программы.

1. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Рынок ценных бумаг входит в часть, формируемая участниками образовательных отношений блока Б1. Дисциплины (модули)

Последующие дисциплины по связям компетенций: Конкуренция и монополия на финансовых рынках, Основы финансовой политики и макрорегулирования, Корпоративное дело, Производные финансовые инструменты, Практикум по рынку ценных бумаг, Практикум по валютному рынку, Зарубежные фондовые рынки, Теория факторных доходов, Профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг, Портфельное инвестирование, Биржевое дело

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Изучение дисциплины Рынок ценных бумаг в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-1 - Способен, используя отечественные и зарубежные источники информации, в том числе информацию, содержащуюся в отчетности организаций - участников рынка ценных бумаг, осуществить мониторинг рынка банковских услуг, иностранной валюты, рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-1	ПК-1.1 Знать методологические основы системного анализа, процедуру системного анализа, навыками поиска необходимой информации и проведения сравнительного анализа экономического состояния рынка банковских услуг иностранной валюты, рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов	ПК-1.2 Уметь собирать, анализировать и интерпретировать необходимую информацию, содержащуюся в различных формах отчетности и прочих отечественных и зарубежных источниках, определять внешние и внутренние факторы системы, проводить качественный анализ результатов прогноза, использовать источники экономической, социальной, управленческой информации, представлять результаты аналитической и исследовательской	ПК-1.3 Владеть (иметь навыки) навыками сбора и обработки необходимых данных, навыками анализа интерпретации и мониторинга информации, содержащейся в различных отечественных и зарубежных источниках о состоянии рынка банковских услуг иностранной валюты, рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов

		работы в виде выступления, доклада, информационного обзора, аналитического отчета, статьи	
--	--	---	--

ПК-2 - Способен на основе типовых методик осуществить расчет цен валюты, ценных бумаг, фондовых индексов и производных финансовых инструментов и совершать сделки с валютой, ценными бумагами и производными финансовыми инструментами

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-2	ПК-2.1 Знать особенности функционирования современных финансовых рынков, методики расчета стоимости ценных бумаг, производных финансовых инструментов, кросс-курсов валют	ПК-2.2. Уметь прогнозировать курсы ценных бумаг, ПФИ и валют на основе графиков, осуществлять анализ факторов, влияющих на курсы валют, ценных бумаг и ПФИ	ПК-2.3 Владеть (иметь навыки) способностью рассчитать основные показатели, характеризующие состояние хозяйствующих субъектов, влияющих на цену финансовых активов, а также совершать сделки в биржевом терминале

ПК-3 - Способен определить инвестиционный профиль участника рынка ценных бумаг, подобрать в соответствии с установленным профилем поставщиков финансовых услуг и проконсультировать по разному типу финансовых продуктов, обращающихся на банковском, валютном рынках и рынке ценных бумаг и производных финансовых инструментов

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-3	ПК-3.1 Знать методы определения инвестиционного профиля, методики составления инвестиционных рекомендации, осуществления подбора продуктов в портфель с учетом риск-профиля клиентов	ПК-3.2 Уметь использовать в профессиональной деятельности инструментарий по оценке инвестиционного профиля, составлять рекомендаций по формированию портфеля с учетом риск-профиля клиента, оценивать эффективность инвестиционных стратегий	ПК-3.3 Владеть (иметь навыки) способностью подбора инвестиционных продуктов в портфель с целью повышения его доходности

3. Объем и виды учебной работы

Учебным планом предусматриваются следующие виды учебной работы по дисциплине:

Очная форма обучения

Виды учебной работы	Всего час/ з.е.	
	Сем 5	Сем 6

Контактная работа, в том числе:	72.15/2	77.3/2.15
Занятия лекционного типа	36/1	36/1
Занятия семинарского типа	36/1	36/1
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.15/0	3.3/0.09
Групповая контактная работа (ГКР)	/0	2/0.06
Самостоятельная работа, в том числе:	17.85/0.5	32.7/0.91
Курсовой проект		+
Промежуточная аттестация	18/0.5	34/0.94
Вид промежуточной аттестации: Экзамен, Зачет	Зач	Экз
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы Зачетные единицы	108 3	144 4

4. Содержание дисциплины

4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Рынок ценных бумаг представлен в таблице.

Разделы, темы дисциплины и виды занятий Очная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контактная работа				Самостоятельная работа	Планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по образовательной программе
		Лекции	Занятия семинарского типа	ИКР	ГКР		
			Практич. занятия				
1.	Рынок ценных бумаг, основные понятия и его участники	18	18			10	ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3
2.	Ценные бумаги, их виды. Размещение и обращение ценных бумаг	18	18			15	ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3
3.	Фундаментальный анализ: понятие, назначение, уровни	18	18			10	ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1,

							ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3
4.	Фундаментальный анализ эмитентов и активов	18	18			15,55	ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3
	Выполнение курсового проекта			3			
	Контроль	52					
	Итого	72	72	3.45	2	50.55	

4.2 Содержание разделов и тем

4.2.1 Контактная работа

Тематика занятий лекционного типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия лекционного типа*	Тематика занятия лекционного типа
1.	Рынок ценных бумаг, основные понятия и его участники	лекция	Роль и значение рынка ценных бумаг. Структура рынка ценных бумаг
		лекция	Эмитенты и инвесторы
		лекция	Профессиональные посредники на рынке ценных бумаг. Брокеры. Дилеры. Форекс-дилеры. Доверительные управляющие.
		лекция	Профессиональная рыночная инфраструктура: депозитарии, регистраторы, репозитарии. Инвестиционные советники
		лекция	Профессиональная рыночная инфраструктура: клиринговые организации
		лекция	Организаторы торговли. Фондовая биржа. Модели ценообразования
		лекция	Российские и зарубежные фондовые площадки
		лекция	Государственное регулирование рынка ценных бумаг
		лекция	Саморегулируемые организации на рынке

			ценных бумаг
2.	Ценные бумаги, их виды. Размещение и обращение ценных бумаг	лекция	Акции
		лекция	Облигации
		лекция	Векселя
		лекция	Другие основные ценные бумаги
		лекция	Коллективное инвестирование и его формы. Инвестиционные паи
		лекция	Вторичные ценные бумаги
		лекция	Производные финансовые инструменты
		лекция	Эмиссия ценных бумаг
		лекция	Биржевое и внебиржевое размещение ценных бумаг. IPO. Отличия ICO от IPO.
3.	Фундаментальный анализ: понятие, назначение, уровни	лекция	Основные подходы к изучению динамики рынка.
		лекция	Методика проведения фундаментального анализа рынка ценных бумаг.
		лекция	Экономический и отраслевой анализ. Рыночный анализ активов.
4.	Фундаментальный анализ эмитентов и активов	лекция	Финансовый анализ деятельности предприятия.
		лекция	Рыночные характеристики акций. Финансовые вычисления по акциям.
		лекция	Фундаментальный анализ облигаций. Финансовые вычисления по облигациям.

*лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся

Тематика занятий семинарского типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия семинарского типа**	Тематика занятия семинарского типа
1.	Рынок ценных бумаг, основные понятия и его участники	практическое занятие	Роль и значение рынка ценных бумаг. Структура рынка ценных бумаг
		практическое занятие	Эмитенты и инвесторы
		практическое занятие	Профессиональные посредники на рынке ценных бумаг. Брокеры. Дилеры. Форекс-дилеры. Доверительные управляющие.
		практическое занятие	Профессиональная рыночная

			инфраструктура: депозитарии, регистраторы, репозитарии. Инвестиционные советники
		практическое занятие	Профессиональная рыночная инфраструктура: клиринговые организации
		практическое занятие	Организаторы торговли. Фондовая биржа. Модели ценообразования
		практическое занятие	Российские и зарубежные фондовые площадки
		практическое занятие	Государственное регулирование рынка ценных бумаг
		практическое занятие	Саморегулируемые организации на рынке ценных бумаг
2.	Ценные бумаги, их виды. Размещение и обращение ценных бумаг	практическое занятие	Акции
		практическое занятие	Облигации
		практическое занятие	Векселя
		практическое занятие	Другие основные ценные бумаги
		практическое занятие	Коллективное инвестирование и его формы. Инвестиционные паи
		практическое занятие	Вторичные ценные бумаги
		практическое занятие	Производные финансовые инструменты
		практическое занятие	Эмиссия ценных бумаг
		практическое занятие	Биржевое и внебиржевое размещение ценных бумаг. IPO. Отличия ICO от IPO.
3.	Фундаментальный анализ: понятие, назначение, уровни	практическое занятие	Основные подходы к изучению динамики рынка.
		практическое занятие	Методика проведения фундаментального анализа рынка ценных бумаг.
		практическое занятие	Экономический и отраслевой анализ. Рыночный анализ активов.
4.	Фундаментальный анализ эмитентов и активов	практическое занятие	Финансовый анализ деятельности предприятия.
		практическое занятие	Рыночные характеристики акций. Финансовые вычисления по акциям.
		практическое занятие	Фундаментальный анализ облигаций. Финансовые вычисления по облигациям.

** семинары, практические занятия, практикумы, лабораторные работы, коллоквиумы и иные аналогичные занятия

Иная контактная работа

При проведении учебных занятий СГЭУ обеспечивает развитие у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств (включая при необходимости проведение интерактивных лекций, групповых дискуссий, ролевых игр, тренингов, анализ ситуаций и имитационных моделей, преподавание дисциплин (модулей) в форме курсов, составленных на основе результатов научных исследований, проводимых организацией, в том числе с учетом региональных особенностей профессиональной деятельности выпускников и потребностей работодателей).

Формы и методы проведения иной контактной работы приведены в Методических указаниях по основной профессиональной образовательной программе.

4.2.2 Самостоятельная работа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид самостоятельной работы ***
1.	Рынок ценных бумаг, основные понятия и его участники	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование
2.	Ценные бумаги, их виды. Размещение и обращение ценных бумаг	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование
3.	Фундаментальный анализ: понятие, назначение, уровни	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование
4.	Фундаментальный анализ эмитентов и активов	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование

*** самостоятельная работа в семестре, написание курсовых работ, докладов, выполнение контрольных работ

5. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

5.1 Литература:

Основная литература

1. Рынок ценных бумаг : учебник для вузов / Н. И. Берзон [и др.]. — 5-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 514 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-11196-5. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/449663>

Дополнительная литература

1. Михайленко, М. Н. Рынок ценных бумаг : учебник и практикум для вузов / М. Н. Михайленко. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 326 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-04961-9. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/468907>

2. Кузьмина О. Ю. Мировой рынок ценных бумаг [Электронный ресурс] : учебное пособие / М. Е. Коновалова. - Самара : Изд-во Самар. гос. экон. ун-та, 2017. - 53 с. - ISBN 978-5-94622-781-0. <http://lib1.sseu.ru/MegaPro/Web>

3. Кузьмина О. Ю. Институты коллективного инвестирования [Электронный ресурс] : учебное пособие / М. Е. Коновалова. - Самара : Изд-во Самар. гос. экон. ун-та, 2017. - 69 с. - ISBN 978-5-94622-786-5. <http://lib1.sseu.ru/MegaPro/Web>

4. Коновалова М. Е. Российские государственные ценные бумаги [Электронный ресурс] : учебное пособие / О. Ю. Кузьмина. - Самара : Изд-во самар. гос. экон. ун-та, 2017. - 59 с. - ISBN 978-5-94622-780-3. <http://lib1.sseu.ru/MegaPro/Web>

5. Казакова, Н. А. Финансовый анализ в 2 ч. Часть 1 : учебник и практикум для вузов / Н. А. Казакова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 297 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-08792-5. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/475006>

6. Казакова, Н. А. Финансовый анализ в 2 ч. Часть 2 : учебник и практикум для вузов / Н. А. Казакова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 209 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-08793-2. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/475007>

Литература для самостоятельного изучения

1. Никитина Н. А. Публичные экономические интересы на рынке ценных бумаг: неюрисдикционные формы защиты [Электронный ресурс] : монография / под ред. В. В. Болговой. - Самара : Самар. гос. экон. ун-т., 2015. - 168 с. - ISBN 978-5-94622-579-3. <http://lib1.sseu.ru/MegaPro/Web>"

5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения

1. Microsoft Windows 10 Education / Microsoft Windows 7 / Windows Vista Business
2. Office 365 ProPlus, Microsoft Office 2019, Microsoft Office 2016 Professional Plus (Word, Excel, Access, PowerPoint, Outlook, OneNote, Publisher) / Microsoft Office 2007 (Word, Excel, Access, PowerPoint)

5.3 Современные профессиональные базы данных, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Профессиональная база данных «Информационные системы Министерства экономического развития Российской Федерации в сети Интернет» (Портал «Официальная Россия» - <http://www.gov.ru/>)

2. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/ru/>)

3. Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики - <http://www.gks.ru/>)

5.4. Информационно-справочные системы, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. справочно-правовая система «Консультант Плюс»
2. справочно-правовая система «ГАРАНТ-Максимум»

5.5. Специальные помещения

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран
Учебные аудитории для проведения практических занятий (занятий семинарского типа)	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ

Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для самостоятельной работы	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для хранения и профилактического обслуживания оборудования	Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования

6. Фонд оценочных средств по дисциплине Рынок ценных бумаг:

6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

Вид контроля	Форма контроля	Отметить нужное знаком « + »
Текущий контроль	Эссе	+
	Обзор источников	+
	Аналитическое исследование	+
	Тестирование	+
	Оценка курсовых проектов	+
Промежуточный контроль	Зачет	+
	Экзамен	+

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования, утвержденными Ученым советом ФГАОУ ВО СГЭУ, протокол № 16 от 20.05.2021; Положением о балльно-рейтинговой системе оценки успеваемости обучающихся по основным образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры в федеральном государственном автономном образовательном учреждении высшего образования «Самарский государственный экономический университет», утвержденным Ученым советом ФГАОУ ВО СГЭУ, протокол № 16 от 20.05.2021 г.

6.2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-1 - Способен, используя отечественные и зарубежные источники информации, в том числе информацию, содержащуюся в отчетности организаций - участников рынка ценных бумаг, осуществить мониторинг рынка банковских услуг, иностранной валюты, рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ПК-1.1 Знать	ПК-1.2 Уметь	ПК-1.3 Владеть (иметь навыки)
Пороговый	источники информации о состоянии рынка банковских услуг иностранной валюты, рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов	собирать, необходимую информацию, содержащуюся в различных формах отчетности и прочих отечественных и зарубежных источниках, использовать источники экономической, социальной, управленческой информации	использования источников экономической, социальной и управленческой информации
Стандартный	методологические основы системного анализа и мониторинга финансовых рынков	представлять результаты аналитической и исследовательской работы в виде, информационного обзора	системного анализа финансовых рынков, мониторинга рынка банковских услуг, иностранной валюты, рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов
Повышенный	методы анализа и интерпретации информации, содержащейся в отчетности участников фондового рынка, способы применения результатов анализа и интерпретации отчетности о финансово-хозяйственной	анализировать данные о финансово-хозяйственной деятельности компаний-участников рынка ценных бумаг, а также о состоянии рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов в целом	способностью интерпретировать и анализировать данные о финансово-хозяйственной деятельности компаний-участников рынка ценных бумаг, а также о состоянии рынка ценных бумаг и производных финансовых

	деятельности участников фондового рынка		инструментов в целом
--	---	--	----------------------

ПК-2 – Способен на основе типовых методик осуществить расчет цен валюты, ценных бумаг, фондовых индексов и производных финансовых инструментов и совершать сделки с валютой, ценными бумагами и производными финансовыми инструментами

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ПК-2.1 Знать	ПК-2.2 Уметь	ПК-2.3 Владеть (иметь навыки)
Пороговый	механизмы совершения сделок с ценными бумагами и валютой	сопоставлять различные индикаторы рынка для определения направлений их последующего движения	навыками осуществления различных видов сделок с ценными бумагами, валютой и фондовыми индексами
Стандартный	способы применения выводов, полученных на основе анализа, для совершения сделок на финансовых рынках	пользоваться программными продуктами для совершения операций с финансовыми инструментами	инструментарием оценок эффективности работы с ценными бумагами, валютой и производными финансовыми инструментами
Повышенный	методики технического анализа и способы интерпретации его данных для использования в профессиональной деятельности	пользоваться программными продуктами для совершения операций с финансовыми инструментами	навыками применения соответствующих инструментов для осуществления наиболее эффективных сделок с ценными бумагами, валютой и производными финансовыми инструментами

ПК-3 - Способен определить инвестиционный профиль участника рынка ценных бумаг, подобрать в соответствии с установленным профилем поставщиков финансовых услуг и проконсультировать по разному типу финансовых продуктов, обращающихся на банковском, валютном рынках и рынке ценных бумаг и производных финансовых инструментов

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ПК-3.1 Знать	ПК-3.2 Уметь	ПК-3.3 Владеть (иметь навыки)
Пороговый	сущность и принципы построения инвестиционных портфелей	рассчитать ожидаемую доходность и риск инвестиционного портфеля	способами анализа различных финансовых инструментов
Стандартный	типологию и структуру инвестиционного портфеля	с помощью финансовых технологий определить инвестиционный профиль участника рынка ценных бумаг	методологией анализа различных финансовых рынков с помощью финансовых технологий и финансовых инструментов

Повышенный	основные виды финансовых технологий применяемых для анализа финансовых рынков и инструментов	подобрать в соответствии с установленным инвестиционным профилем поставщиков финансовых продуктов, используя финансовые технологии и финансовые инструменты	навыками прогнозирования развития финансовых технологий и финансовых инструментов
------------	--	---	---

6.3. Паспорт оценочных материалов

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контролируемые планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по программе	Вид контроля/используемые оценочные средства	
			Текущий	Промежуточный
1.	Рынок ценных бумаг, основные понятия и его участники	ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3	Эссе, аналитическое исследование, обзор источников, тестирование, оценка курсовых работ	Зачет, экзамен
2.	Ценные бумаги, их виды. Размещение и обращение ценных бумаг	ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3	Эссе, аналитическое исследование, обзор источников, тестирование, оценка курсовых работ	Зачет, экзамен
3.	Фундаментальный анализ: понятие, назначение, уровни	ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3	Эссе, аналитическое исследование, обзор источников, тестирование, оценка курсовых работ	Зачет, экзамен
4.	Фундаментальный анализ эмитентов и активов	ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3	Эссе, аналитическое исследование, обзор источников, тестирование, оценка курсовых работ	Зачет, экзамен

6.4. Оценочные материалы для текущего контроля

Задания и требования для выполнения эссе по дисциплине для оценки сформированности компетенций размещены в ЭИОС СГЭУ, <https://lms2.sseu.ru/course/view.php?id=23209>

Задания и требования для выполнения аналитического исследования по дисциплине для оценки сформированности компетенций размещены в ЭИОС СГЭУ, <https://lms2.sseu.ru/course/view.php?id=23209>

Задания и требования для выполнения обзор источников по дисциплине для оценки сформированности компетенций размещены в ЭИОС СГЭУ, <https://lms2.sseu.ru/course/view.php?id=23209>

Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций (min 20, max 50 + ссылку на ЭИОС с тестами)

<https://lms2.sseu.ru/course/view.php?id=23209>

<https://lms2.sseu.ru/enrol/index.php?id=23267>

Примерная тематика курсовых проектов

1. Российский рынок корпоративных облигаций и его структурная сбалансированность
2. Субфедеральные и муниципальные займы: опыт обращения и перспективы развития
3. Российский рынок акций в условиях внешних шоков
4. Формирование инвестиционного портфеля на рынке ценных бумаг и оценка его эффективности
5. Российский рынок секьюритизации ипотечных активов: состояние и перспективы развития
6. Коммерческий банк как участник рынка ценных бумаг
7. Государство на рынке ценных бумаг
8. Инвестиционные компании на российском рынке ценных бумаг
9. Привлечение розничных инвесторов на фондовый рынок посредством ИИС
10. Российский рынок коллективных инвестиций: современное состояние и перспективы развития
11. Фондовая биржа и ее роль в условиях рыночной экономики
12. Зарубежные IPO российских компаний: архитектура рынка и организация выхода
13. Профессиональные участники рынка ценных бумаг: количественная и качественная структура деятельности на фондовом рынке
14. Качество корпоративного управления и его влияние на инвестиционную привлекательность эмитента
15. Дивидендная политика компании как фактор ее инвестиционной привлекательности
16. Ключевые тенденции развития мирового рынка ценных бумаг
17. Фондовые кризисы и их идентификация
18. Эффективность деятельности саморегулируемых организаций на рынке ценных бумаг
19. Российский рынок слияний и поглощений в нефтегазовой отрасли
20. Цифровые финансовые активы: экономическая сущность и технологическое содержание
21. Криптовалютный рынок: риски и новые возможности
22. Крауд-технологии как инструмент развития инвестиционного рынка
23. Цифровая трансформация рынка ценных бумаг
24. Новые финансовые инструменты на российском фондовом рынке
25. Организация финансирования венчурного капитала на рынке ценных бумаг

6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме зачета

Раздел дисциплины	Вопросы
Рынок ценных бумаг, основные понятия и его участники	<ol style="list-style-type: none"> 1. Рынок ценных бумаг как составная часть финансового рынка. 2. Рынок ценных бумаг: понятие, функции, структура и виды. 3. Эмитенты на рынке ценных бумаг. 4. Инвесторы на рынке ценных бумаг. 5. Коллективное инвестирование. Паевые инвестиционные фонды (ПИФы), акционерные инвестиционные фонды (АИФы), негосударственные пенсионные фонды (НПФы) 6. Брокерская деятельность: виды, брокерские счета, приказы брокеру. 7. Дилерская деятельность. 8. деятельность форекс-дилера. 9. Репозитарная деятельность 10. инвестиционный советник и его функционал. 11. Деятельность по управлению ценными бумагами. 12. Клиринговая деятельность. 13. Деятельность по ведению реестра. 14. Депозитарная деятельность: виды депозитариев, виды счетов депо. 15. Деятельность по организации торговли на фондовом рынке. 16. Фондовая биржа: понятие, классификация. Методы организации биржевой торговли. Организационная структура фондовой биржи. 17. Фондовые индексы: принципы построения, мировые и российские фондовые индексы. 18. Регулирование рынка ценных бумаг: основные элементы системы регулирования и органы регулирования фондового рынка. Саморегулируемые организации рынка ценных бумаг.
Ценные бумаги, их виды. Размещение и обращение ценных бумаг	<ol style="list-style-type: none"> 19. Ценная бумага: понятие, основные свойства. 20. Классификация ценных бумаг. 21. Акция: понятие и фундаментальные свойства. Дивиденд. 22. Виды акций. 23. Стоимостная оценка акции. 24. Доходность акций. 25. Сплит и консолидация акций. 26. Облигация: понятие и фундаментальные свойства. Купон и дисконт. 27. Виды облигаций. 28. Стоимостная оценка и доходность облигаций. 29. Государственные ценные бумаги: ГКО, ОФЗ, ОСЗ, КО, ОВВЗ, золотые сертификаты. 30. Вексель, понятие, виды. 31. Операции с векселями. 32. Преимущественные права. 33. Депозитарные расписки: понятие, виды, организация выпуска. 34. Варранты. 35. Чек, коносамент, банковские сертификаты, закладная. 36. Основная характеристика производных финансовых инструментов. 37. Форвардный контракт: общая характеристика, определение форвардной цены. Пример торговли. 38. Операции РЕПО и обратное РЕПО. 39. Своп: понятие, виды. Пример получения выгоды в результате заключения процентного свопа. 40. Фьючерсный контракт: понятие. Фьючерсная цена. Базис. Фьючерсные стратегии. 41. Опционные контракты: понятие, виды. Стоимость опциона. Организация опционной

	<p>торговли.</p> <p>42. Эмиссия ценных бумаг и ее этапы.</p> <p>43. Процедура размещения ценных бумаг. Отличия процедуры IPO и от PO. Достоинства и недостатки процедуры IPO. Сравнительная характеристика биржевого и внебиржевого размещения.</p> <p>44. Фундаментальный и технический анализ рынка ценных бумаг.</p> <p>45. Фундаментальный анализ.</p> <p>46. Технический анализ. Основные графические и количественные методы технического анализа.</p> <p>47. Торговые системы.</p> <p>48. Теории движения цен.</p> <p>49. Понятие портфеля ценных бумаг. Модели формирования портфеля ценных бумаг.</p> <p>50. Управление портфелем ценных бумаг</p>
--	---

Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме экзамена

Раздел дисциплины	Вопросы
Фундаментальный анализ: понятие, назначение, уровни	<ol style="list-style-type: none"> 1. Основные подходы к изучению динамики фондового рынка: основные принципы, области применения. 2. Сравнительная характеристика технического и фундаментального анализа. 3. Теория эффективности рынка. Информационная и операционная эффективность рынка. Формы эффективности 4. Гипотеза "свободного блуждания", ее связь с теорией эффективности рынка, с техническим и фундаментальным анализом. 5. Теория рефлексивности Дж. Сороса. 6. Психологический анализ рынка. 7. Биржевые индексы. 8. Влияние информации на рыночную котировку акций. 9. Понятие фундаментального анализа. 10. Методы, области применения фундаментального анализа. 11. Процесс фундаментального анализа: экономический, отраслевой анализ и анализ предприятия. 12. Рыночный анализ активов. 13. Альфа- и бета-коэффициенты. 14. Показатели оценки инвестиционной привлекательности акций.
Фундаментальный анализ эмитентов и активов	<ol style="list-style-type: none"> 15. Показатели оценки стоимости компании. 16. Показатели рентабельности компании. 17. Показатели финансовой устойчивости компании. 18. Показатели темпов роста компании. 19. Анализ отчета о прибылях и убытках компании. 20. Анализ отчета о движении денежных средств компании. 21. Анализ статей балансового отчета компании. 22. Индексы акций. 23. Налогообложение операций с акциями. 24. Фундаментальный анализ облигаций. 25. Факторы, влияющие на курсовую стоимость облигаций. 26. Определение курсовой стоимости и доходности облигаций. 27. Рейтинг облигаций. 28. Рейтинговые агентства. 29. Этапы рейтинговых процедур. 30. Индексы облигаций. 31. Налогообложение операций с облигациями. 32. Дюрация и иммунизация облигаций.

6.6. Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

Шкала и критерии оценивания

Оценка	Критерии оценивания для мероприятий контроля с применением 2-х балльной системы
«зачтено»	Повышенный ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3 Стандартный ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3 Пороговый ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3
«не зачтено»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне

Оценка	Критерии оценивания для мероприятий контроля с применением 4-х балльной системы
«отлично»	Повышенный ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3
«хорошо»	Стандартный ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3
«удовлетворительно»	Пороговый П ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3
«неудовлетворительно»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне