

Министерство образования и науки Российской Федерации  
филиал федерального государственного бюджетного образовательного учреждения  
высшего образования  
«Кубанский государственный университет»  
в г. Армавире



УТВЕРЖДАЮ:

Проректор по работе с филиалами

Евдокимов А.А.

» 08 2016г.

## РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.16 Биржевое дело

Направление подготовки: 38.03.02 Менеджмент

Направленность (профиль): Финансовый менеджмент

Форма обучения: заочная

Квалификация (степень) выпускника: бакалавр

Краснодар 2016

Рабочая программа дисциплины составлена в соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент

Программу составила:  
Доцент кафедры экономики и менеджмента,  
канд. экон. наук, доц.  
«29» августа 2016 г.

М. Г. Матевосян



Рабочая программа дисциплины утверждена на заседании кафедры экономики и менеджмента (выпускающей)  
Протокол № 1 «29» августа 2016 г.  
Заведующий кафедрой,  
канд. экон. наук, доц.

С.Г. Косенко



Утверждена на заседании учебно-методической комиссии кафедры экономики и менеджмента  
Протокол № 1 «29» августа 2016 г.  
Председатель УМК кафедры  
экономики и менеджмента,  
канд. экон. наук, доц.

В.И. Путьлин



Рецензенты:

Иманова М. Г., канд. экон. наук, доцент кафедры экономики и менеджмента филиала ФГБОУ ВО «Кубанский государственный университет» в г. Тихорецке

Вахрушева Л.А., Армавирское ОСБ (на правах управления) Краснодарское ОСБ 8619 доп. офис 0592, руководитель СДД 8619/0592

Лист изменений к рабочей программе учебной дисциплины  
«Биржевое дело»

Содержание изменений	№ протокола заседания кафедры, дата	ФИО / подпись зав. кафедрой
В соответствии с выходом нового приказа от 05.04.2017 №301 «Об утверждении Порядка организации и осуществлении образовательной деятельности по образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры» была актуализирована рабочая программа	№1 от 28.08.2017	Косенко С.Г. 

## 1 Цели и задачи изучения дисциплины

### 1.1 Цель освоения дисциплины

Целью освоения дисциплины «Биржевое дело» является овладение студентами теоретическими и практическими навыками биржевого дела.

### 1.2 Задачи дисциплины:

- ознакомление с деятельностью бирж на рынке и их основными видами;
- исследование истории развития биржевой торговли в России и за рубежом и ее основных тенденций;
- изучение механизма регулирования биржевой деятельности;
- анализ деятельности товарных бирж и выявление их экономической роли;
- освоение технологии формирования цепочки заказа от покупателя к продавцу на бирже;
- ознакомление с функциями и задачами биржевых посредников.

### 1.3 Место дисциплины в структуре образовательной программы.

Дисциплина **Б1.В.16 «Биржевое дело»** относится к вариативной части Блока 1 «Дисциплины (модули)» учебного плана.

Дисциплина «Биржевое дело» является общим теоретическим и методологическим для всех экономических дисциплин, входящих в учебный план по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент.

### 1.4 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Изучение данной учебной дисциплины направлено на формирование у обучающихся профессиональных компетенций. (ПК)

№ п.п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	уметь	владеть
1	<b>ПК-4</b>	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	систему показателей и методы анализа финансовой отчетности организации-эмитента; критерии оптимальности и инвестиционных решений.	применять методы анализа финансовой отчетности эмитента для оценки стоимости выпущенных им ценных бумаг.	навыками фундаментального анализа, на основе которых принимаются обоснованные инвестиционные решения.

		мировых рынках в условиях глобализации			
2	<b>ПК-10</b>	владением навыками количественного и качественного анализа информации при принятии управленческих решений, построения экономических, финансовых и организационно-управленческих моделей путем их адаптации к конкретным задачам управления	финансовые модели оценки и прогнозирования стоимости ценных бумаг.	применять методы анализа для прогнозирования и оценки результатов операций с ценными бумагами.	навыками оценки и прогнозирования стоимости ценных бумаг.

## 2. Структура и содержание дисциплины

### 2.1 Распределение трудоёмкости дисциплины по видам работ

Общая трудоёмкость дисциплины составляет 2 зач.ед. (72 часов), их распределение по видам работ представлено в таблице (для студентов ЗФО).

Вид учебной работы	Всего часов	Курс			
		5			
Контактная работа, в том числе	14,2	14,2			
<b>Аудиторные занятия (всего)</b>	<b>14</b>	<b>14</b>			
В том числе:					
Занятия лекционного типа	6	6			
Занятия семинарского типа (семинары, практические занятия)	8	8			
<b>Иная контактная работа</b>	<b>0,2</b>	<b>0,2</b>			
Контроль самостоятельной работы (КСР)					
Промежуточная аттестация (ИКР)	0,2	0,2			
<b>Самостоятельная работа (всего)</b>	<b>54</b>	<b>54</b>			
В том числе:					
<i>Курсовая работа</i>	-				
Проработка учебного (теоретического) материала	11	11			
Анализ научно-методической литературы	10	10			
Реферат, эссе	13	13			
Подготовка к текущему контролю	20	20			
<b>Контроль:</b>	<b>3,8</b>	<b>3,8</b>			
Подготовка к зачету					
<b>Промежуточная аттестации (зачет)</b>					
Общая трудоемкость, час	<b>72</b>	<b>72</b>			
В том числе контактная работа	<b>14,2</b>	<b>14,2</b>			
зач. ед	<b>2</b>	<b>2</b>			

### 2.2 Структура дисциплины.

Разделы видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины.  
Разделы дисциплины, изучаемые на 5 курсе (заочная форма).

№ п/п	Наименование раздела	Количество часов				
		Всего часов	Аудиторная работа			Внеаудиторная (самост- оятельная работа)
			Л	ПЗ	ЛР	
1	Раздел 1. Исторический аспект биржевой торговли					
2	Тема 1. Тенденции развития биржевой торговли.	9	2	-	-	7
3	Тема 2. Понятие биржи: классификация бирж.	8	-	2	-	6
4	Раздел 2. Организационно-правовой аспект биржевой торговли					
5	Тема 3 Биржевой товар: понятие, классификация	9	2	-	-	7
6	Тема 4 Участники и инфраструктура биржевой торговли	8	-	2	-	6
7	Тема 5 Основы технологии биржевой торговли	9	-	2	-	7
8	Тема 6 Основы ценообразования на биржевые инструменты	11	2	2	-	7
	<b>Итого</b>		<b>6</b>	<b>8</b>	<b>-</b>	<b>54</b>

Примечание: Л – лекции; ПЗ – практические занятия (семинары); ЛР – лабораторные работы; СРС – самостоятельная работа студентов.

## 2.3 Содержание разделов дисциплины:

### 2.3.1 Занятия лекционного типа

№	Наименование темы	Содержание раздела	Форма текущего контроля
1	Исторический аспект биржевой торговли	Тема 1. Тенденции развития биржевой торговли.	Реферат (Р), Эссе (Э)
		Тема 2. Понятие биржи: классификация бирж.	Реферат (Р), Эссе (Э)
2	Организационно-правовой аспект биржевой торговли	Тема 3 Биржевой товар: понятие, классификация	Реферат (Р), Эссе (Э)
		Тема 4 Участники и инфраструктура биржевой торговли	Реферат (Р), Эссе (Э)

	Тема 5 Основы технологии биржевой торговли	Реферат (Р), Эссе (Э)
	Тема 6 Основы ценообразования на биржевые инструменты	Реферат (Р), Эссе (Э)

### 2.3.2 Занятия семинарского типа

№	Наименование темы	Содержание раздела	Форма текущего контроля
	Исторический аспект биржевой торговли	Тема 1. Тенденции развития биржевой торговли.	Тестирование (т), Ситуационные задания (С 3)
		Тема 2. Понятие биржи: классификация бирж.	Тестирование (т), Ситуационные задания (С 3))
4	Организационно-правовой аспект биржевой торговли	Тема 3 Биржевой товар: понятие, классификация	Тестирование (т), Ситуационные задания (С 3)
		Тема 4 Участники и инфраструктура биржевой торговли	Тестирование (т), Ситуационные задания (С 3)
		Тема 5 Основы технологии биржевой торговли	Тестирование (т), Ситуационные задания (С 3)
		Тема 6 Основы ценообразования на биржевые инструменты	Тестирование (т), Ситуационные задания (С 3)

### 2.3.3 Лабораторные занятия.

Лабораторные занятия учебным планом не предусмотрены.

### 2.3.4 Примерная тематика курсовых работ

Курсовые работы учебным планом не предусмотрены.

### 2.4 Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

№	Вид СРС	Перечень учебно-методического обеспечения дисциплины по выполнению самостоятельной работы
1	2	3
1	Проработка учебного	Методические рекомендации по организации

	(теоретического) материала	самостоятельной работы обучающихся (рассмотрены и утверждены на заседании кафедры экономики и менеджмента филиала ФГБОУ ВО «Кубанский государственный университет» в г. Армавире 28 августа 2017 г., протокол №1);
2	Анализ научно-методической литературы	Методические рекомендации по организации самостоятельной работы обучающихся (рассмотрены и утверждены на заседании кафедры экономики и менеджмента филиала ФГБОУ ВО «Кубанский государственный университет» в г. Армавире 28 августа 2017 г., протокол №1); Основная и дополнительная литература по дисциплине.
3	Подготовка рефератов, эссе	Методические рекомендации по подготовке, написанию и порядку оформления рефератов и эссе (рассмотрены и утверждены на заседании кафедры экономики и менеджмента филиала ФГБОУ ВО «Кубанский государственный университет» в г. Армавире 28 августа 2017 г., протокол №1);

Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся из числа инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья (ОВЗ) предоставляются в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

Для лиц с нарушениями зрения:

- в печатной форме увеличенным шрифтом,
- в форме электронного документа.

Для лиц с нарушениями слуха:

- в печатной форме,
- в форме электронного документа.

Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

- в печатной форме,
- в форме электронного документа.

Данный перечень может быть конкретизирован в зависимости от контингента обучающихся.

### **3. Образовательные технологии.**

Интерактивные занятия учебным планом не предусмотрены.

### **4. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации**

#### **4.1 Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля.**

#### **Примерные тестовые задания**

1 Контракт на продажу – это:

- 1) Европейский опцион.
- 2) Опцион колл.
- 3) Опцион пут.
- 4) Опцион стеллаж.

2 Какая профессиональная деятельность на фондовом рынке называется депозитарной?

- 1) Оказание услуг по ведению реестра владельцев ценных бумаг.

- 2) Оказание услуг по хранению сертификатов ценных бумаг и/или учету прав на ценные бумаги.
- 3) Оказание услуг по доверительному управлению ценными бумагами для клиентов.
- 4) Предоставление кредитов на покупку ценных бумаг.

3 Какая профессиональная деятельность на фондовом рынке признается брокерской?

- 1) Совершение гражданско-правовых сделок с ценными бумагами на основании договора поручения.
- 2) Совершение гражданско-правовых сделок с ценными бумагами на основании договора займа.
- 3) Совершение гражданско-правовых сделок с ценными бумагами на основании договора комиссии.
- 4) Совершение гражданско-правовых сделок с ценными бумагами на основании договора поручения и договора комиссии.

4 Контракт на покупку – это:

- 1) Европейский опцион.
- 2) Опцион колл.
- 3) Опцион пут.
- 4) Опцион стеллаж.

5 Какая деятельность признается деятельностью по организации торговли на рынке ценных бумаг?

- 1) Предоставление любых услуг профессиональным участникам рынка ценных бумаг.
- 2) Предоставление услуг, непосредственно способствующих заключению гражданско-правовых сделок с ценными бумагами между участниками рынка ценных бумаг.
- 3) Только деятельность фондовой биржи.
- 4) Только сочетание деятельности фондовой биржи, депозитарной деятельности и клиринга.

6 Лицо, пользующееся услугами депозитариями по хранению ценных бумаг и/или учету прав на ценные бумаги, именуется ...

7 Какая профессиональная деятельность на фондовом рынке признается дилерской?

- 1) Покупка ценных бумаг от своего имени и за свой счет с целью формирования долгосрочного инвестиционного портфеля.
- 2) Совершение любых гражданско-правовых сделок с ценными бумагами, не противоречащих законодательству.
- 3) Совершение сделок купли-продажи ценных бумаг от имени и за счет клиента путем публичного объявления цен покупки и/или продажи.
- 4) Совершение сделок купли-продажи ценных бумаг от своего имени и за свой счет путем публичного объявления цен покупки и/или продажи.

8 В чем заключается отличие индоссамента от цессии?

- 1) Не подлежит обратной регрессии.
- 2) Подлежит обратной регрессии.
- 3) Нет правильных ответов.
- 4) Подлежит обратной регрессии при определенных условиях.

9 Купонная ставка по облигации со сроком погашения 1 год составляет 50 %. Номинальная стоимость облигации 1 тыс. р., рыночная

1,1 тыс. р. Какова цена сделки купли-продажи данной облигации?

10 Предприятие получило доход от переоценки ГКО по средневзвешенной рыночной цене. Эта сумма:

- 1) Не облагается налогом на прибыль.
- 2) облагается налогом на прибыль.
- 3) облагается налогом на прибыль только при покупке ГКО на вторичном рынке.
- 4) Нет правильных ответов.

11 Фондовая биржа создается в форме:

- 1) ОАО.
- 2) ЗАО.
- 3) Некоммерческого партнерства.
- 4) Саморегулируемой организации.

12 По каким ценным бумагам налогооблагаемая прибыль уменьшается на разницу между полученным и уплаченным накопленным купонным доходом?

- 1) ГКО.
- 2) ОФЗ и ОСЗ.
- 3) Депозитный сертификат.
- 4) Вексель.

13 Могут ли ценные бумаги, не прошедшие листинг, быть объектом сделок на фондовой бирже?

- 1) Да, в порядке, предусмотренном ее внутренними документами.
- 2) Да.
- 3) Нет.
- 4) Иной вариант ответа.

14 Дилерами на рынке ГКО могут быть.

- 1) Банки.
- 2) Инвестиционные институты.
- 3) Небанковские учреждения, имеющие лицензию на право осуществления деятельности на рынке ценных бумаг.
- 4) Профессиональные участники рынка ценных бумаг, удовлетворяющие определенным минимальным требованиям.

15 Какое количество предлагаемых к выпуску ОФЗ должно быть продано в период размещения, чтобы выпуск можно было считать состоявшимся?

- 1) Не менее 10%.
- 2) Не менее 20%.
- 3) Не менее 25%.
- 4) Не менее 30%.

16 Какие виды деятельности не являются видами профессиональной деятельности на фондовом рынке?

- 1) Дилерская деятельность.
- 2) Деятельность по управлению ценными бумагами.
- 3) Деятельность инвестиционного консультанта.
- 4) Брокерская деятельность.

17 ОФЗ является:

- 1) Именными купонными долгосрочными государственными ценными бумагами.

- 2) Именными купонными среднесрочными государственными ценными бумагами.
- 3) Предъявительскими купонными долгосрочными государственными ценными бумагами.
- 4) Предъявительскими купонными среднесрочными государственными ценными бумагами.

### **Примерные ситуационные задания**

#### **Задача 1.**

Бескупонная облигация со сроком обращения 180 дней была приобретена на аукционе в ходе первичного размещения по цене 68,15%. Спустя некоторое время, облигация была продана по цене 73,53%. Причем, доходность к аукциону по результатам этой сделки оказалась в два раза меньше доходности к погашению. Рассчитайте, через сколько дней после проведения аукциона была совершена указанная сделка купли-продажи.

#### **Задача 2.**

Индекс закрытия биржи "М" был равен 98,44. На следующий день в связи со значительным ростом котировок ценных бумаг после расчета индекса открытия торги были приостановлены. Определите минимальное возможное значение индекса открытия при заданных условиях?

#### **Задача 3.**

Индекс закрытия биржи "М" был равен 99,32. На следующий день в связи со значительным ростом котировок ценных бумаг после расчета индекса открытия торги были приостановлены. Определите минимальное возможное значение индекса открытия при заданных условиях?

#### **Задача 4.**

Индекс закрытия биржи "М" был равен 97, 62 На следующий день в связи со значительным ростом котировок ценных бумаг после расчета индекса открытия торги были приостановлены. Определите минимальное возможное значение индекса открытия при заданных условиях?

#### **Задача 5.**

Инвестор владеет облигацией, номинальная стоимость которой равна 20 000 р., а срок погашения истекает через 3 года. Купонные выплаты производятся 2 раза в год и годовой процент купонных выплат составляет 8%. Действующая цена облигации равна 22 000р. Если ставка дисконта оценивается в 8%, то следует ли инвестору приобретать облигацию?

#### **Задача 6.**

Облигация продается по цене 10000 рублей. Номинальная цена облигации 5 000 рублей. Определить размер премии (ажио) в денежном исчислении и пунктах, если 1 пункт равен 1% номинальной стоимости облигации.

#### **Задача 7.**

Инвестор имеет возможность приобрести две ценные бумаги: одну стоимостью - 18 тыс. р., другую - 20 тыс. р. По окончании холдингового периода первая ценная бумага обеспечивает конечную сумму денег – 19,5 тыс. р., а вторая – 21,6 тыс. р. Определить норму отдачи от каждой ценной бумаги в денежном и процентном исчислении. Какая ценная бумага в данном случае будет предпочтительней?

#### **Задача 8.**

Облигация "А", со сроком погашения - 1 год, размещается с дисконтом, равным 15%. Облигация "В", со сроком погашения - 2 года и при купонной ставке - 7%, имеет рыночную цену, равную 90%. Облигация "С", со сроком погашения - 3 года и купонной ставкой, равной 6%, размещается по номиналу. Определите, покупка какой облигации принесет ее владельцу наибольшую доходность за первый год?

#### **Задача 9.**

Инвестор купил простой вексель, составленный 1 февраля 2015 г., со сроком платежа 1 февраля 2016 г. Вексельная сумма – 200 000 рублей, предусмотрено начисление 10% годовых по векселю, проценты начисляются от даты составления. Какую сумму имеет право требовать инвестор от векселедателя 1 февраля 2016 г.?

#### **Задача 10.**

Вексель номинальной стоимостью 150 тыс. рублей учтен банком за 90 дней до его погашения по учетной ставке 8%. Через 10 дней банк переучел его вдругом банке по учетной ставке 5%. Определить эффективность этой сделки.

#### **Задача 11.**

Депозитный сертификат был куплен за 6 месяцев до погашения по цене 10 000 р., а продан за два месяца до погашения по цене 10 400 р. Доход от этой операции для держателя сертификата составил 1 400 р. и был извлечен за 4 месяца. Определить доходность от этой операции в процентах.

#### **Задача 12.**

Депозитный сертификат номинальной стоимостью 100 000 р. и доходностью 10% , срок обращения которого 181 день, приобретен инвестором через 80 дней после его выпуска за 103600 рублей. Через 30 дней после приобретения депозитный сертификат был продан инвестором за 104500 р. Определите доходность этой сделки.

#### **Задача 13.**

Северный торговый банк выпустил сберегательный сертификат серии «В» на 6 месяцев номиналом 10 000 р., которые продаются по цене 8 500 р. При погашении данного сертификата выплачивается сумма 10 000 р. Чему равен доход за 6 месяцев, за 1 год?

### **Примерные темы рефератов**

1. Формирование рынка ценных бумаг в царской России.
2. Ценные бумаги в условиях СССР и возрождение рынка ценных бумаг в Российской Федерации.
3. Акции: деноминация и консолидация.
4. Контрольный пакет акций.
5. Кредитные рейтинги.
6. Российские еврооблигации.
7. Облигации государственного сберегательного займа.
8. Казначейские обязательства (КО).
9. Облигации внутреннего валютного займа.
10. Золотые сертификаты Министерства финансов РФ выпуска 1993 года.
11. Нерезиденты на рынке ГКО.
12. Операции коммерческого банка с векселями.
13. Особенности вексельного обращения в России.
14. "Грубая неосторожность" и другие риски в вексельном обращении.
15. Жилищный сертификат.

16. Особенности обращения сертификатов Сберегательного займа.
17. Особенности инвестирования и производные ценные бумаги на фондовом рынке США.
18. Производные инструменты на финансовом рынке России.
19. Опцион как инструмент для частных инвестиций.
20. Механизм биржевых операций.
21. Первичные дилеры на рынке Государственных ценных бумаг.
22. Перспективы развития инфраструктуры рынка ценных бумаг.
23. Депозитарный учет операций ценными бумагами.
24. Вторичная эмиссия: риск эмитента и инвестора.
25. Индексы рынка ценных бумаг Российской Федерации.
26. Коммерческие банки на рынка ценных бумаг.
27. Инвестиционные компании и фонды на рынке ценных бумаг.
28. Страхование финансовых рисков по ценным бумагам.
29. Международный финансовый рынок и международный рынок ценных бумаг.
30. Классификация ценных бумаг с точки зрения временных и пространственных характеристик.

### **Примерные темы эссе**

1. Классификация ценных бумаг с точки зрения рыночных характеристик.
2. Классификация акций.
3. Классификация облигаций.
4. Дивидендные выплаты по акциям.
5. Дисконт и процентный доход по облигациям.
6. Облигации федерального займа с переменным купоном (ОФЗ-ПК).
7. Нерезиденты на рынке ГКО.
8. Депозитные и сберегательные сертификаты.
9. Чеки.
10. Виды фьючерсных и опционных контрактов на фондовом рынке.
11. Ценообразование на производные ценные бумаги.
12. Стратегия торговли фьючерсными контрактами и биржевыми опционами.
13. Вторичная эмиссия: риск эмитента и инвестора.
14. Механизм биржевых операций.
15. Первичные дилеры на рынке Государственных ценных бумаг.
16. Перспективы развития инфраструктуры рынка ценных бумаг.
17. Депозитарный учет операций с ценными бумагами.
18. Фундаментальный и технический анализ инвестиционных свойств ценных бумаг.
19. Рейтинг ценных бумаг.
20. Виды рисков на рынке ценных бумаг.
21. Этика фондового рынка.
22. Раскрытие информации на рынке ценных бумаг.
23. Инвестиционный капитал. Характеристика. Источники. Цели инвестирования.
24. Основные юридические и экономические характеристики ценных бумаг.
25. Классификация ценных бумаг (пространственные и рыночные характеристики).
26. Общая характеристика участников рынка ценных бумаг.
27. Эмитенты. Классификация эмитентов. Эмиссионные операции.
28. Инвесторы. Классификация инвесторов. Инвестиционные операции.
29. Профессионалы фондового рынка.

30. Инфраструктура фондового рынка. (Организации, обслуживающие рынок ценных бумаг).

#### 4.2 Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации

##### Примерный перечень вопросов для подготовки к зачету

- 1 Биржевая торговля, как основа биржевой деятельности.
- 2 Функции брокерских фирм.
- 3 Функции биржи.
- 4 Виды сделок на фондовой бирже.
- 5 Виды бирж.
- 6 Механизм заключения сделок с валютой.
- 7 История развития биржевой торговли.
- 8 Организация биржевой торговли ценными бумагами.
- 9 Регулирование биржевой деятельности.
- 10 Виды валютных сделок.
- 11 Лицензирование биржевой деятельности.
- 12 Ценные бумаги как биржевой товар.
- 13 Органы управления биржей.
- 14 Этапы расчетно-клирингового процесса на фондовой бирже.
- 15 Участники биржевой торговли.
- 16 Порядок заключения сделок на товарной бирже.
- 17 Биржевой товар.
- 18 Биржи реального товара.
- 19 Товарная биржа.
- 20 Основные направления развития систем клиринга и расчетов.
- 21 Опцион. Виды опционов.
- 22 Хеджирование.
- 23 Фондовая биржа.
- 24 Сущность и функции систем клиринга и расчетов.
- 25 Виды сделок на товарной бирже
- 26 Валютная биржа.
- 27 Основные виды рисков.
- 28 Фьючерсные биржи.
- 29 Ценообразование на биржевых рынках.
- 30 Порядок заключения и исполнения сделок на куплю-продажу фьючерсных контрактов.
- 31 Биржевая спекуляция.
- 32 Процедура листинга. Делистинг.
- 33 Материально-техническая обеспеченность бирж.
- 34 Биржевые посредники.
- 35 Взаимосвязь и различия форвардного и фьючерсного контрактов.
- 36 Члены биржи, их права и обязанности.
- 37 Экономика брокерской деятельности (доходы и расходы брокеров).
- 38 Субъекты рынка ценных бумаг.
- 39 Механизм биржевой фьючерсной торговли.
- 40 ММВБ, ее цели и функции.
- 41 Организация валютной биржи.
- 42 Котирование цен.
- 43 Сущность биржевой сделки на фондовой бирже.
- 44 Сделки с реальным товаром на товарной бирже.

- 45 Права и обязанности брокеров.
- 46 Сделки без реального товара на товарной бирже.
- 47 Выборные органы биржи.
- 48 Учредители и члены биржи.
- 49 Биржевая сделка. Условия содержания сделки.
- 50 Содержание заявки на куплю-продажу ценных бумаг.

#### **Уровень требований и критерии оценок на зачете**

Оценка «зачтено» выставляется, если компетенции ПК-4, ПК-10 полностью освоены, обучающийся владеет материалом, отвечает на основные и дополнительные вопросы.

Оценка «не зачтено» выставляется, если компетенции ПК-4, ПК-10 не освоены, обучающийся не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки.

Оценочные средства для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья выбираются с учетом их индивидуальных психофизических особенностей.

- при необходимости инвалидам и лицам с ограниченными возможностями здоровья предоставляется дополнительное время для подготовки ответа на зачете;

- при проведении процедуры оценивания результатов обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья предусматривается использование технических средств, необходимых им в связи с их индивидуальными особенностями;

- при необходимости для обучающихся с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов процедура оценивания результатов обучения по дисциплине может проводиться в несколько этапов.

Процедура оценивания результатов обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья по дисциплине предусматривает предоставление информации в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

Для лиц с нарушениями зрения:

- в печатной форме увеличенным шрифтом,
- в форме электронного документа.

Для лиц с нарушениями слуха:

- в печатной форме,
- в форме электронного документа.

Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

- в печатной форме,
- в форме электронного документа.

Данный перечень может быть конкретизирован в зависимости от контингента обучающихся.

## **5. Перечень основной и дополнительной учебной литературы для освоения дисциплины**

### **5.1 Основная литература:**

1. Соколов, Ю. А. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс]: учебник для прикладного бакалавриата / Ю. А. Соколов. — М. : Издательство Юрайт, 2017. — 384 с. — 498 с. - URL: <https://biblio-online.ru/viewer/rynok-cennyh-bumag-399088#page/1>

### **5.2 Дополнительная литература:**

1. Чалдаева, Л. А. Биржевое дело: учебник для бакалавров / Л. А. Чалдаева, Т. К. Блохина, А. Б. Шемякин; отв. ред. Л. А. Чалдаева. — М.: Издательство Юрайт, 2016. — 372 с. — (Серия: Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-9916-3078-8. URL: <https://biblio-online.ru/book/71C04730-144E-4376-B2A7-A613BB16DD74/birzhevoe-delo>

### 5.3. Периодические издания:

1. «Биржевое дело».
2. «Экономист».
3. «Менеджмент».

### 6. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины.

1. ЭБС «Университетская библиотека ONLINE». – URL: [www.biblioclub.ru](http://www.biblioclub.ru)
2. ЭБС издательства «Лань». – URL: <https://e.lanbook.com>
3. ЭБС «Юрайт». – URL: <http://www.biblio-online.ru/>
4. Электронный каталог Научной библиотеки КубГУ. – URL: <http://212.192.134.46/MegaPro/Catalog/Home/Index>
5. Аналитическая и цитатная база «Web of Science (WoS)». – URL: <http://apps.webofknowledge.com>.
6. Электронная библиотека «Издательского дома «Гребенников» – URL: [www.grebennikon.ru](http://www.grebennikon.ru)
7. Научная электронная библиотека (НЭБ) «eLibrary.ru». – URL: <http://www.elibrary.ru>
8. Полнотекстовые архивы ведущих западных научных журналов на Российской платформе научных журналов НЭИКОН. - URL: <http://archive.neicon.ru>
9. Базы данных компании «Ист Вью». - URL: <http://dlib.eastview.com>
10. Университетская информационная система РОССИЯ (УИС Россия) - URL: <http://uisrussia.msu.ru>
11. «Электронная библиотека диссертаций» Российской Государственной Библиотеки (РГБ). - URL: <https://dvs.rsl.ru/>
12. Электронная коллекция Оксфордского Российского Фонда. - URL: <http://lib.myilibrary.com>
13. «Лекториум ТВ». - URL: <http://www.lektorium.tv/>
14. Национальная электронная библиотека «НЭБ». - URL: <http://нэб.рф/>
15. КиберЛенинка: научная электронная библиотека. – URL: <http://cyberleninka.ru/>
16. Единое окно доступа к образовательным ресурсам : федеральная ИС свободного доступа. – URL: <http://window.edu.ru>.
17. Официальный интернет-портал правовой информации. Государственная система правовой информации. – URL: <http://publication.pravo.gov.ru>
18. Справочно-правовая система «Консультант Плюс» - <http://www.consultant.ru>

### 7. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

По курсу предусмотрено проведение лекционных занятий, на которых дается основной систематизированный материал. Основной целью лекции является обеспечение теоретической основы обучения, развитие интереса к учебной деятельности и конкретной учебной дисциплине, формирование у обучающихся ориентиров для самостоятельной работы.

#### Подготовка к практическим занятиям.

Практические занятия ориентированы на работу с учебной и периодической литературой, знакомство с содержанием, принципами и инструментами осуществления и решением основных вопросов, приобретение навыков для самостоятельных оценок результатов оценки основных явлений дисциплины. К практическому занятию обучающийся должен ответить на основные контрольные вопросы изучаемой темы, подготовить эссе, решить тесты. Кроме того, следует изучить тему по конспекту лекций и

учебнику или учебным пособиям из списка литературы.

Тестирование по предложенным темам. Подготовка тестированию предполагает изучение материалов лекций, учебной литературы.

Написание эссе. Эссе – вид самостоятельной работы обучающихся, представляющий собой небольшое по объему и свободное по композиции сочинение на заданную тему, отражающее подчеркнута индивидуальную позицию автора. Рекомендуемый объем эссе – 2-3 печатные страницы.

Написание реферата – это вид самостоятельной работы обучающихся, содержащий информацию, дополняющую и развивающую основную тему, изучаемую на аудиторных занятиях. Ведущее место занимают темы, представляющие профессиональный интерес, несущие элемент новизны. Реферативные материалы должны представлять письменную модель первичного документа – научной работы, монографии, статьи. Реферат может включать обзор нескольких источников и служить основой для доклада на определённую тему на семинарах.

Выполнение ситуационных заданий – это задачи, позволяющие осваивать интеллектуальные операции последовательно в процессе работы с информацией: ознакомление - понимание - применение - анализ - синтез - оценка.

Ситуационные задачи позволяют интегрировать знания, полученные в процессе изучения разных дисциплин. При этом они могут предусматривать расширение образовательного пространства обучающегося. Решение ситуационных задач, базирующихся на привлечении обучающихся к активному разрешению учебных проблем, тождественных реальным жизненным, позволяет обучающемуся овладеть умениями быстро ориентироваться в разнообразной информации, самостоятельно и быстро отыскивать необходимые для решения проблемы сведения и, наконец, научиться активно, творчески пользоваться своими знаниями.

Предложенные расчетные задачи требуют логического размышления и предназначены для отработки практических навыков выполнения расчетов в процессе решения задач. При их выполнении необходимо проявить знания расчетных методик и формул.

Решение ситуационных задач может способствовать развитию навыков самоорганизации деятельности, формированию умения объяснять явления действительности, повышению уровня функциональной грамотности, формированию ключевых компетентностей, подготовке к профессиональному выбору, ориентации в ключевых проблемах современной жизни.

По результатам проверки ситуационных задач преподаватель указывает обучающемуся на ошибки и неточности

Самостоятельная работа обучающихся по дисциплине включает следующие виды работ:

- работа с лекционным материалом, предусматривающая проработку конспекта лекций и учебной литературы;
- выполнение домашнего задания, предусматривающих решение ситуационных задач, проверяемых в учебной группе на практических занятиях;
- изучение материала, вынесенного на самостоятельную проработку;
- подготовка к практическим занятиям;
- написание реферата или эссе по заданной проблеме.

Зачет. Обучающиеся обязаны сдать зачет в соответствии с расписанием и учебным планом. Зачет является формой контроля усвоения обучающимся учебной программы по дисциплине или ее части, выполнения реферативных работ, эссе, тестовых заданий, устного опроса, выполнение ситуационных заданий.

В освоении дисциплины инвалидами и лицами с ограниченными возможностями здоровья большое значение имеет индивидуальная учебная работа (консультации) –

дополнительное разъяснение учебного материала.

Индивидуальные консультации по предмету являются важным фактором, способствующим индивидуализации обучения и установлению воспитательного контакта между преподавателем и обучающимся инвалидом или лицом с ограниченными возможностями здоровья.

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

### **8.1 Перечень информационных технологий.**

– Предоставление доступа всем участникам образовательного процесса к корпоративной сети университета и глобальной сети Интернет.

– Предоставление доступа участникам образовательного процесса через сеть Интернет к справочно-поисковым информационным системам.

– Использование специализированного (Офисное ПО, графические, видео- и аудиоредакторы и пр.) программного обеспечения для подготовки тестовых, методических и учебных материалов.

– Использование офисного и мультимедийного программного обеспечения при проведении занятий и для самостоятельной подготовки обучающихся.

### **8.2 Перечень необходимого программного обеспечения.**

- Libre Office 5.0.6 (свободный офисный пакет);
- Gimp 2.6.16 (растровый графический редактор);
- Inkscape 0.91 (векторный графический редактор);
- Adobe Acrobat Reader, WinDjView, XnView (просмотр документов и рисунков);
- Mozilla FireFox, Adobe Flash Player, JRE. (Internet);
- 7-zip 9.15 (архиватор);
- Nod32 (антивирус);
- Notepad++ (текстовый редактор с подсветкой синтаксиса).

### **8.3 Перечень информационных справочных систем:**

1. Официальный интернет-портал правовой информации. Государственная система правовой информации. – URL: <http://publication.pravo.gov.ru>.

2. Официальная Россия. Сервер органов государственной власти Российской Федерации. – URL: <http://www.gov.ru>.

3. Справочно-правовая система «Консультант Плюс». – URL: <http://www.consultant.ru>.

4. Научная электронная библиотека (НЭБ) «eLibrary.ru». – URL: <http://www.elibrary.ru>

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

№	Вид работ	Материально-техническое обеспечение дисциплины и оснащенность
1.	Лекционные занятия	Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа
2.	Семинарские занятия	Учебные аудитории для проведения занятий семинарского типа
3.	Групповые (индивидуальные)	Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций

	консультации	
4.	Текущий контроль, промежуточная аттестация	Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации
5.	Самостоятельная работа	Кабинет для самостоятельной работы, оснащенный компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспеченный доступом в электронную информационно-образовательную среду университета.