

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Тамбовский государственный университет имени Г.Р. Державина»

Институт экономики, управления и сервиса

Кафедра стратегического развития и экономической безопасности

УТВЕРЖДАЮ:

Директор института



Е. Ю. Меркулова

«04» июля 2022 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

по дисциплине Б1.В.ДВ.07.2 Брокерская и трастовая деятельность коммерческого банка

Направление подготовки/специальность: 38.04.08 - Финансы и кредит

Профиль/направленность/специализация: Банковское дело

Уровень высшего образования: магистратура

Квалификация: Магистр

год набора: 2022

Тамбов, 2022

Автор программы:

Кандидат экономических наук, доцент Бурмистрова Алевтина Анатольевна

Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.04.08 - Финансы и кредит (уровень магистратуры) (приказ Министерства образования и науки РФ от «12» августа 2020 г. № 991).

Рабочая программа принята на заседании Кафедры стратегического развития и экономической безопасности «28» июня 2022 г. Протокол № 9

Рассмотрена и одобрена на заседании Ученого совета Института экономики, управления и сервиса, Протокол от «04» июля 2022 г. № 11.

СОДЕРЖАНИЕ

1. Цели и задачи дисциплины.....	4
2. Место дисциплины в структуре ОП Магистра.....	5
3. Объем и содержание дисциплины.....	5
4. Контроль знаний обучающихся и типовые оценочные средства.....	9
5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля).....	19
6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины.....	20
7. Материально-техническое обеспечение дисциплины, программное обеспечение, профессиональные базы данных и информационные справочные системы.....	21

1. Цели и задачи дисциплины

1.1 Цель дисциплины – формирование компетенций:

ПК-2 Способен осуществлять разработку финансового плана для клиента и целевого инвестиционного портфеля

1.2 Типы задач профессиональной деятельности, к которым готовятся обучающиеся в рамках освоения дисциплины:

- консалтинговый

1.3 Дисциплина ориентирована на подготовку обучающихся к профессиональной деятельности в сфере: 08 Финансы и экономика (в сфере управления денежными средствами, денежными потоками, финансами, осуществления финансового контроля, а также стратегического и текущего планирования деятельности в организациях реального сектора экономики, неправительственных и общественных организациях, органах государственной власти и местного самоуправления с учетом особенностей макроэкономической ситуации, перспектив развития цифровой экономики, рисков движения денежных средств, формирования и использования финансовых ресурсов для определения экономически рационального поведения в конкретных ситуациях)

1.4 В результате освоения дисциплины у обучающихся должны быть сформированы:

Обобщенные трудовые функции / трудовые функции / трудовые или профессиональные действия (при наличии профстандарта)	Код и наименование компетенции ФГОС ВО, необходимой для формирования трудового или профессионального действия	Индикаторы достижения компетенций
	ПК-2 Способен осуществлять разработку финансового плана для клиента и целевого инвестиционного портфеля	Осуществляет выбор брокера и тарифов по брокерскому обслуживанию в интересах клиентов, а также осуществляет трастовое управление активами клиента

1.5 Согласование междисциплинарных связей дисциплин, обеспечивающих освоение компетенций:

ПК-2 Способен осуществлять разработку финансового плана для клиента и целевого инвестиционного портфеля

№ п/п	Наименование дисциплин, определяющих междисциплинарные связи	Форма обучения			
		Очная (семестр)		Заочная (семестр)	
		3	4	3	5
1	Инвестиционная деятельность коммерческого банка	+		+	
2	Инвестиционный портфель коммерческого банка	+		+	
3	Моделирование инвестиционного портфеля клиента	+		+	

4	Оценка инвестиционных рисков	+		+	
5	Практика по профилю профессиональной деятельности		+		+

2. Место дисциплины в структуре ОП магистратуры:

Дисциплина «Брокерская и трастовая деятельность коммерческого банка» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений, учебного плана ОП по направлению подготовки 38.04.08 - Финансы и кредит.

Дисциплина «Брокерская и трастовая деятельность коммерческого банка» изучается в 3 семестре.

3. Объем и содержание дисциплины

3.1. Объем дисциплины: 3 з.е.

Очная: 3 з.е.

Заочная: 3 з.е.

Вид учебной работы	Очная (всего часов)	Заочная (всего часов)
Общая трудоёмкость дисциплины	108	108
Контактная работа	32	10
Лекции (Лекции)	16	4
Практические (Практ. раб.)	16	6
Самостоятельная работа (СР)	76	94
Зачет	-	4

3.2. Содержание курса:

№ темы	Название раздела/темы	Вид учебной работы, час.						Формы текущего контроля
		Лекции		Практ. раб.		СР		
		О	З	О	З	О	З	
3 семестр								
1	Фундаментальные понятия рынка ценных бумаг и его роль в финансовой системе	2	-	2	1	14	18	Устный опрос; Подготовка реферата с презентацией
2	Банк на фондовой бирже. Биржевые индексы. Листинг. Интернет трейдинг.	4	1	2	2	14	18	Устный опрос; Тестирование; Подготовка реферата с презентацией
3	Регулированиеброк ерской деятельности банка. Информационно-п равовая инфраструктура.	2	1	4	1	16	18	Устный опрос

4	Технический и фундаментальный анализ рынка ценных бумаг. Оценка стоимости ценных бумаг.	2	1	2	1	16	20	Устный прос
5	Основы формирования и управления инвестиционным портфелем	6	1	6	1	16	20	Устный опрос; Подготовка реферата с презентацией

Тема 1. Фундаментальные понятия рынка ценных бумаг и его роль в финансовой системе (ПК-2)

Лекция.

Рынок ценных бумаг как механизм, обеспечивающий перераспределение сбережений в инвестиции. Определение инвестиций. Прямые и косвенные инвестиции. Место рынка ценных бумаг в системе финансовых рынков. Структура инвестиционного процесса. Рынок денег и рынок капиталов.

Инструменты инвестирования: облигации, акции, фьючерсы, опционы, варранты и права. Гибридные ценные бумаги – смешанные формы. Ценные бумаги денежного рынка. Международные ценные бумаги.

Механизм функционирования рынка ценных бумаг. Характеристика основных целей инвестирования: получение дохода и прирост капитала. Факторы, определяющие принятие инвестиционных решений: доходность инвестиций; ликвидность финансового инструмента; оценка риска. Инвестиции, обеспечивающие текущий доход, и инвестиции, обеспечивающие прирост капитала. Инвестиции с низким риском и высокой степенью риска. Взаимосвязь доходности, риска и ликвидности.

Особенности инвестирования на российском рынке ценных бумаг. Основные показатели, характеризующие состояние рынка ценных бумаг.

Практическое занятие.

1. Механизм функционирования рынка ценных бумаг.
2. Характеристика основных целей инвестирования: получение дохода и прирост капитала.
3. Факторы, определяющие принятие инвестиционных решений: доходность инвестиций; ликвидность финансового инструмента; оценка риска.
4. Инвестиции, обеспечивающие текущий доход, и инвестиции, обеспечивающие прирост капитала.
5. Инвестиции с низким риском и высокой степенью риска.

Задания для самостоятельной работы.

1. Рассмотреть рынок ценных бумаг как механизм, обеспечивающий перераспределение сбережений в инвестиции.
2. Рассмотреть сущность и виды инвестиций.
3. Рассмотреть прямые и косвенные инвестиции.
4. Изучить структура инвестиционного процесса.
5. Сравнить рынок денег и рынок капиталов.

Тема 2. Банк на фондовой бирже. Биржевые индексы. Листинг. Интернет трейдинг. (ПК-2)

Лекция.

Биржа, история ее возникновения, задачи и функции биржи, виды бирж. Биржа как организатор биржевой торговли. Законодательное регулирование биржевой деятельности и саморегулирование. Биржевой товар, требования, предъявляемые к биржевому товару, состав биржевого товара. Листинг ценных бумаг, порядок проведения.

Организация биржевого торга. Правила биржевого торга, характеристика основных участников биржевого торга. Торговые поручения клиентов и заявки на участие в торгах. Виды торговых поручений. Характеристика биржевых аукционов (открытые и закрытые, простые и двойные аукционы).

Внебиржевые системы торговли: РТС в России; NASDAQ в США.

Биржевые сделки. Критерии классификации. Содержание биржевой сделки. Виды сделок на фондовой бирже: кассовые и срочные сделки. Общая характеристика и виды кассовых сделок. Использование кассовых сделок биржевыми спекулянтами (быками и медведями). Общая характеристика и виды срочных сделок. Биржевая котировка. Сущность и значение биржевых котировок, методы установления и расчета биржевой цены, система передачи информации и публикация биржевых (котировальных) цен.

Практическое занятие.

1. Организация биржевого торга.
2. Правила биржевого торга, характеристика основных участников биржевого торга.
3. Торговые поручения клиентов и заявки на участие в торгах.
4. Виды торговых поручений.
5. Характеристика биржевых аукционов (открытые и закрытые, простые и двойные аукционы).

Задания для самостоятельной работы.

1. Изучите историю возникновения биржи, задачи и функции биржи, виды бирж.
2. Рассмотрите биржу как организатора биржевой торговли.
3. Изучите нормативно-правовые акты, регулирующие биржевую деятельность и саморегулирование.
4. Рассмотрите требования, предъявляемые к биржевому товару и состав биржевого товара.
5. Изучите листинг ценных бумаг, порядок проведения.

Тема 3. Регулирование брокерской деятельности банка. Информационно-правовая инфраструктура. (ПК-2)

Лекция.

Правовые основы регулирования рынка ценных бумаг. Особенности регулирования фондового рынка в США, Западной Европе, Азиатско-Тихоокеанском регионе.

Государственное регулирование рынка ценных бумаг в России: анализ нормативных актов и правового обеспечения. Антимонопольное регулирование сделок с ценными бумагами. Понятие «группа лиц» в антимонопольном законодательстве России.

Регулирующие функции государства на рынке ценных бумаг: российская и международная практика. Саморегулируемые организации. Сравнительная характеристика практики деятельности саморегулируемых организаций в России и в международной практике. Структура законодательства по ценным бумагам и его связи с другими видами законодательства, регулирующими финансовые рынки. Сравнительная характеристика важнейших положений законодательства по ценным бумагам в российской и международной практике.

Профессиональная этика участников фондового рынка. Основные этические принципы. Наиболее важные этические правила, используемые на российском рынке ценных бумаг и в международной практике: сравнительная характеристика.

Практическое занятие.

1. Регулирующие функции государства на рынке ценных бумаг: российская и международная практика.
2. Саморегулируемые организации.
3. Сравнительная характеристика практики деятельности саморегулируемых организаций в России и в международной практике.
4. Структура законодательства по ценным бумагам и его связи с другими видами законодательства, регулирующими финансовые рынки.

Задания для самостоятельной работы.

1. Изучите правовые основы регулирования рынка ценных бумаг.

2. Сравните регулирование фондового рынка в США, Западной Европе, Азиатско-Тихоокеанском регионе (данные оформите в виде таблицы).
3. Государственное регулирование рынка ценных бумаг в России: анализ нормативных актов и правового обеспечения.
4. Ознакомьтесь с антимонопольным регулированием сделок с ценными бумагами.
5. Сравнительная характеристика важнейших положений законодательства по ценным бумагам в российской и международной практике.

Тема 4. Технический и фундаментальный анализ рынка ценных бумаг. Оценка стоимости ценных бумаг. (ПК-2)

Лекция.

Фундаментальный анализ рынка: макроэкономические параметры, анализ отрасли, эмитента ценных бумаг, выявление внутренней стоимости ценной бумаги.

Технический анализ рынка: графики, тренды, поддержка и сопротивление, скользящие средние и т.д. Сравнительная характеристика приемов технического и фундаментального анализа для исследования различных рынков ценных бумаг.

Прогнозирование цены акций на рынке. Биржевые сделки как механизм реализации инвестиционной стратегии. Инвестиции, спекуляции, арбитраж. Понятие инсайдерских сделок, манипуляция.

Практическое занятие.

1. Сравнительная характеристика приемов технического и фундаментального анализа для исследования различных рынков ценных бумаг.
2. Прогнозирование цены акций на рынке.
3. Биржевые сделки как механизм реализации инвестиционной стратегии.

Задания для самостоятельной работы.

1. Рассмотрите сущность и алгоритм фундаментального анализа рынка: макроэкономические параметры, анализ отрасли, эмитента ценных бумаг, выявление внутренней стоимости ценной бумаги.
2. Изучите алгоритм технического анализа рынка: графики, тренды, поддержка и сопротивление, скользящие средние и т.д.
3. Составьте сравнительную таблицу приемов технического и фундаментального анализа для исследования различных рынков ценных бумаг.

Тема 5. Основы формирования и управления инвестиционным портфелем

(ПК-2)

Лекция.

Структура и классификация инвестиционных портфелей. Критерии эффективности инвестиционных портфелей. Портфельное инвестирование. Проблема выбора инвестиционного портфеля и порядок формирования портфеля ценных бумаг. Типы портфеля. Характеристика зарубежного опыта оформления портфелей ценных бумаг.

Активный и пассивный метод управления портфелем ценных бумаг, их отличия и достоинства. Понятие о систематическом и несистематическом рисках при формировании портфеля ценных бумаг, их состав и характеристика, возможность управления риском при портфельном инвестировании.

Практическое занятие.

1. Активный и пассивный метод управления портфелем ценных бумаг, их отличия и достоинства.
2. Понятие о систематическом и несистематическом рисках при формировании портфеля ценных бумаг, их состав и характеристика, возможность управления риском при портфельном инвестировании.

Задания для самостоятельной работы.

1. Рассмотрите структуру и классификацию инвестиционных портфелей.
2. Изучите критерии эффективности инвестиционных портфелей.
3. Ознакомьтесь с портфельным инвестированием.
4. Сравните существующие типы портфеля.
5. Проанализируйте зарубежный опыт оформления портфелей ценных бумаг.

4. Контроль знаний обучающихся и типовые оценочные средства

4.1. Распределение баллов:

3 семестр

- посещаемость – 10 баллов
- текущий контроль – 70 баллов
- контрольные срезы – 2 среза по 10 баллов каждый
- премиальные баллы – 20 баллов

Распределение баллов по заданиям:

№ те мы	Название темы / вид учебной работы	Формы текущего контроля / срезы	Мах. кол-во баллов	Методика проведения занятия и оценки
1.	Фундаментальные понятия рынка ценных бумаг и его роль в финансовой системе	Устный опрос	5	<p>Устный опрос может применяться в различных формах: фронтальный, индивидуальный, комбинированный. Основные качества устного ответа подлежащего оценке:</p> <ul style="list-style-type: none"> - правильность ответа по содержанию; - полнота и глубина ответа; - сознательность ответа; - логика изложения материала; - рациональность использованных приемов и способов решения поставленной учебной задачи; - своевременность и эффективность использования наглядных пособий и технических средств при ответе; - использование дополнительного материала; - рациональность использования времени, отведенного на задание. <p>5 баллов – студент умеет сопоставить полученную при подготовке к практическому занятию информацию, сравнивать разные точки зрения на анализируемую проблему, уметь четко формулировать свои вопросы и отвечать на задаваемые ему вопросы, вести дискуссию с использованием профессиональной терминологии</p> <p>4-3 балла - студент умеет применять полученную при подготовке к практическому занятию информацию, отвечать на большинство вопросов, вести дискуссию с использованием профессиональной терминологии.</p> <p>2-1 балл – студент владеет теоретическим материалом по теме практического занятия, иногда затрудняется при ответе на вопросы, не умеет сформулировать свою точку зрения на обсуждаемую проблему</p> <p>Если студент не владеет проблематикой практического занятия, не может отвечать на вопросы, зачитывает ответ по напечатанному тексту – ответ баллами не оценивается.</p>

		Подготов ка реферата с презентац ией	<p>9</p> <p>Устное выступление автора по результатам доклада/реферата сосредоточено на принципиальных вопросах, таких как: актуальность темы исследования; методологический аппарат и основные научные подходы (школы), занимавшиеся решением вопросов; новизна работы и основные выводы, сформулированные в ходе изучения материала.</p> <p>Презентация подготавливается по одному из вопросов практического занятия.</p> <p>8-9 баллов – студент грамотно выстраивает логику своего доклада по материалам реферата, раскрывает тему исследования, опираясь на результаты теоретических практических исследований последних 3-5 лет, демонстрирует оригинальные находки в решении проблемы, намечены перспективы исследования, продемонстрированы хорошие ораторские способности, выступление сопровождается презентацией полученных результатов. Грамотные ответы на дополнительные вопросы.</p> <p>Презентация соответствует теме, структура и оформление отвечает вышеперечисленным требованиям, студент свободно владеет материалом, демонстрирует глубокие, систематизированные знания, свободно отвечает на вопросы используя профессиональную терминологию</p> <p>на заданные вопросы</p> <p>4-7 баллов – логика выступления в отдельных местах нарушается, тема исследования раскрывается, опираясь на результаты теоретических исследований последних 10 лет, отсутствуют оригинальные находки в решении проблемы, перспективы исследования намечены пунктирно, продемонстрированы средние ораторские способности, выступление сопровождается презентацией полученных результатов, ответы на вопросы требуют уточнения.</p> <p>В структуре и оформлении презентации имеются недоработки, материал представлен в презентации не рационально, мало иллюстративного материала, студент владеет неполной информацией по теме, затрудняется с ответами на задаваемые вопросы</p> <p>1 -3 балла - представленные результаты в массе своей не новы, ответ представляет собой простое зачитывание текста, студент не может дать ответы на дополнительные вопросы.</p> <p>В структуре и оформлении презентации имеются значительные недоработки, материал представлен не по теме, сплошным текстом, мало иллюстративного материала, студент слабо владеет информацией по теме, при ответе использует заготовленный текст, не может отвечать на поставленные дополнительные вопросы</p>
--	--	---	---

2.	Банк на фондовой бирже. Биржевые индексы. Листинг. Интернет трейдинг.	Устный опрос	5	<p>Устный опрос может применяться в различных формах: фронтальный, индивидуальный, комбинированный. Основные качества устного ответа подлежащего оценке:</p> <ul style="list-style-type: none"> - правильность ответа по содержанию; - полнота и глубина ответа; - сознательность ответа; - логика изложения материала; - рациональность использованных приемов и способов решения поставленной учебной задачи; - своевременность и эффективность использования наглядных пособий и технических средств при ответе; - использование дополнительного материала; - рациональность использования времени, отведенного на задание. <p>5 баллов – студент умеет сопоставить полученную при подготовке к практическому занятию информацию, сравнивать разные точки зрения на анализируемую проблему, уметь четко формулировать свои вопросы и отвечать на задаваемые ему вопросы, вести дискуссию с использованием профессиональной терминологии</p> <p>4-3 балла - студент умеет применять полученную при подготовке к практическому занятию информацию, отвечать на большинство вопросов, вести дискуссию с использованием профессиональной терминологии.</p> <p>2-1 балл – студент владеет теоретическим материалом по теме практического занятия, иногда затрудняется при ответе на вопросы, не умеет сформулировать свою точку зрения на обсуждаемую проблему</p> <p>Если студент не владеет проблематикой практического занятия, не может отвечать на вопросы, зачитывает ответ по напечатанному тексту – ответ баллами не оценивается.</p>
		Тестирование(контрольный срез)	10	<p>Контрольный срез представляет собой тест.</p> <p>10-9 баллов – студент правильно отвечает на 90-100% вопросов в тесте</p> <p>7-8 балла – студент правильно отвечает на 70-89% вопросов в тесте</p> <p>5-6 балла – студент правильно отвечает на 50-69% вопросов в тесте.</p> <p>3-4 балла – студент правильно отвечает на 30-49% вопросов в тесте</p> <p>2-1 балл – студент правильно отвечает на 20-29% вопросов в тесте</p> <p>Менее 20% правильных ответов баллов не дает.</p>

		Подготов ка реферата с презентац ией	<p>9</p> <p>Устное выступление автора по результатам доклада/реферата сосредоточено на принципиальных вопросах, таких как: актуальность темы исследования; методологический аппарат и основные научные подходы (школы), занимавшиеся решением вопросов; новизна работы и основные выводы, сформулированные в ходе изучения материала.</p> <p>Презентация подготавливается по одному из вопросов практического занятия.</p> <p>8-9 баллов – студент грамотно выстраивает логику своего доклада по материалам реферата, раскрывает тему исследования, опираясь на результаты теоретических практических исследований последних 3-5 лет, демонстрирует оригинальные находки в решении проблемы, намечены перспективы исследования, продемонстрированы хорошие ораторские способности, выступление сопровождается презентацией полученных результатов. Грамотные ответы на дополнительные вопросы.</p> <p>Презентация соответствует теме, структура и оформление отвечает вышеперечисленным требованиям, студент свободно владеет материалом, демонстрирует глубокие, систематизированные знания, свободно отвечает на вопросы используя профессиональную терминологию</p> <p>на заданные вопросы</p> <p>4-7 баллов – логика выступления в отдельных местах нарушается, тема исследования раскрывается, опираясь на результаты теоретических исследований последних 10 лет, отсутствуют оригинальные находки в решении проблемы, перспективы исследования намечены пунктирно, продемонстрированы средние ораторские способности, выступление сопровождается презентацией полученных результатов, ответы на вопросы требуют уточнения.</p> <p>В структуре и оформлении презентации имеются недоработки, материал представлен в презентации не рационально, мало иллюстративного материала, студент владеет неполной информацией по теме, затрудняется с ответами на задаваемые вопросы</p> <p>1 -3 балла - представленные результаты в массе своей не новы, ответ представляет собой простое зачитывание текста, студент не может дать ответы на дополнительные вопросы.</p> <p>В структуре и оформлении презентации имеются значительные недоработки, материал представлен не по теме, сплошным текстом, мало иллюстративного материала, студент слабо владеет информацией по теме, при ответе использует заготовленный текст, не может отвечать на поставленные дополнительные вопросы</p>
--	--	---	---

3.	Регулирование брокерской деятельности банка. Информационн о-правовая инфраструктур а.	Устный опрос	17	<p>Устный опрос может применяться в различных формах: фронтальный, индивидуальный, комбинированный. Основные качества устного ответа подлежащего оценке:</p> <ul style="list-style-type: none"> - правильность ответа по содержанию; - полнота и глубина ответа; - сознательность ответа; - логика изложения материала; - рациональность использованных приемов и способов решения поставленной учебной задачи; - своевременность и эффективность использования наглядных пособий и технических средств при ответе; - использование дополнительного материала; - рациональность использования времени, отведенного на задание. <p>17 баллов – студент умеет сопоставить полученную при подготовке к практическому занятию информацию, сравнивать разные точки зрения на анализируемую проблему, уметь четко формулировать свои вопросы и отвечать на задаваемые ему вопросы, вести дискуссию с использованием профессиональной терминологии</p> <p>14-33 баллов - студент умеет применять полученную при подготовке к практическому занятию информацию, отвечать на большинство вопросов, вести дискуссию с использованием профессиональной терминологии.</p> <p>8 баллов – студент владеет теоретическим материалом по теме практического занятия, иногда затрудняется при ответе на вопросы, не умеет сформулировать свою точку зрения на обсуждаемую проблему</p> <p>Если студент не владеет проблематикой практического занятия, не может отвечать на вопросы, зачитывает ответ по напечатанному тексту – ответ баллами не оценивается.</p>
----	--	-----------------	----	---

4.	Технический и фундаментальный анализ рынка ценных бумаг. Оценка стоимости ценных бумаг.	Устный прос	20	<p>Устный опрос может применяться в различных формах: фронтальный, индивидуальный, комбинированный. Основные качества устного ответа подлежащего оценке:</p> <ul style="list-style-type: none"> - правильность ответа по содержанию; - полнота и глубина ответа; - сознательность ответа; - логика изложения материала; - рациональность использованных приемов и способов решения поставленной учебной задачи; - своевременность и эффективность использования наглядных пособий и технических средств при ответе; - использование дополнительного материала; - рациональность использования времени, отведенного на задание. <p>20 баллов – студент умеет сопоставить полученную при подготовке к практическому занятию информацию, сравнивать разные точки зрения на анализируемую проблему, уметь четко формулировать свои вопросы и отвечать на задаваемые ему вопросы, вести дискуссию с использованием профессиональной терминологии</p> <p>10 баллов - студент умеет применять полученную при подготовке к практическому занятию информацию, отвечать на большинство вопросов, вести дискуссию с использованием профессиональной терминологии.</p> <p>5 баллов – студент владеет теоретическим материалом по теме практического занятия, иногда затрудняется при ответе на вопросы, не умеет сформулировать свою точку зрения на обсуждаемую проблему</p> <p>Если студент не владеет проблематикой практического занятия, не может отвечать на вопросы, зачитывает ответ по напечатанному тексту – ответ баллами не оценивается.</p>
----	---	-------------	----	--

5.	Основы формирования и управления инвестиционными портфелем	Устный опрос(контрольный срез)	10	<p>Устный опрос может применяться в различных формах: фронтальный, индивидуальный, комбинированный. Основные качества устного ответа подлежащего оценке:</p> <ul style="list-style-type: none"> - правильность ответа по содержанию; - полнота и глубина ответа; - сознательность ответа; - логика изложения материала; - рациональность использованных приемов и способов решения поставленной учебной задачи; - своевременность и эффективность использования наглядных пособий и технических средств при ответе; - использование дополнительного материала; - рациональность использования времени, отведенного на задание. <p>10 баллов – студент умеет сопоставить полученную при подготовке к практическому занятию информацию, сравнивать разные точки зрения на анализируемую проблему, уметь четко формулировать свои вопросы и отвечать на задаваемые ему вопросы, вести дискуссию с использованием профессиональной терминологии</p> <p>4-3 балла - студент умеет применять полученную при подготовке к практическому занятию информацию, отвечать на большинство вопросов, вести дискуссию с использованием профессиональной терминологии.</p> <p>2-1 балл – студент владеет теоретическим материалом по теме практического занятия, иногда затрудняется при ответе на вопросы, не умеет сформулировать свою точку зрения на обсуждаемую проблему</p> <p>Если студент не владеет проблематикой практического занятия, не может отвечать на вопросы, зачитывает ответ по напечатанному тексту – ответ баллами не оценивается.</p>
----	--	---------------------------------------	----	--

		Подготов ка реферата с презентац ией	5	<p>Устное выступление автора по результатам доклада/реферата сосредоточено на принципиальных вопросах, таких как: актуальность темы исследования; методологический аппарат и основные научные подходы (школы), занимавшиеся решением вопросов; новизна работы и основные выводы, сформулированные в ходе изучения материала.</p> <p>Презентация подготавливается по одному из вопросов практического занятия.</p> <p>5 баллов – студент грамотно выстраивает логику своего доклада по материалам реферата, раскрывает тему исследования, опираясь на результаты теоретических и практических исследований последних 3-5 лет, демонстрирует оригинальные находки в решении проблемы, намечены перспективы исследования, продемонстрированы хорошие ораторские способности, выступление сопровождается презентацией полученных результатов. Грамотные ответы на дополнительные вопросы.</p> <p>Презентация соответствует теме, структура и оформление отвечает вышеперечисленным требованиям, студент свободно владеет материалом, демонстрирует глубокие, систематизированные знания, свободно отвечает на вопросы используя профессиональную терминологию</p> <p>на заданные вопросы</p> <p>3-4 балла – логика выступления в отдельных местах нарушается, тема исследования раскрывается, опираясь на результаты теоретических исследований последних 10 лет, отсутствуют оригинальные находки в решении проблемы, перспективы исследования намечены пунктирно, продемонстрированы средние ораторские способности, выступление сопровождается презентацией полученных результатов, ответы на вопросы требуют уточнения.</p> <p>В структуре и оформлении презентации имеются недоработки, материал представлен в презентации не рационально, мало иллюстративного материала, студент владеет неполной информацией по теме, затрудняется с ответами на задаваемые вопросы</p> <p>1 -2 балла - представленные результаты в массе своей не новы, ответ представляет собой простое зачитывание текста, студент не может дать ответы на дополнительные вопросы.</p> <p>В структуре и оформлении презентации имеются значительные недоработки, материал представлен не по теме, сплошным текстом, мало иллюстративного материала, студент слабо владеет информацией по теме, при ответе использует заготовленный текст, не может отвечать на поставленные дополнительные вопросы</p>
6.	Посещаемость		10	100%-я посещаемость занятий оценивается в 10 баллов, более 50% - оценивается в 5-9 баллов, менее 50% - 0 баллов
7.	Премияльные баллы		20	<p>Дополнительные премиальные баллы могут быть начислены:</p> <ul style="list-style-type: none"> - за проект, выполненный по заказу работодателя и реализованный на практике – 20 баллов; - постоянная активность во время практических занятий – 10 баллов; - полностью подготовленная к публикации статья по тематике в рамках дисциплины – 10 баллов; - участие с докладом во всероссийской олимпиаде по тематике изучаемой дисциплины – 20 баллов; - публикация статьи по тематике изучаемой дисциплины в сборнике студенческих работ / материалах всероссийской конференции / журнале из перечня ВАК – 10 / 15 / 20

8.	Индивидуальные задания, с помощью которых можно набрать дополнительные баллы	90	Добор: студент может предоставить все задания текущего контроля и контрольные срезы
9.	Итого за семестр	100	

Итоговая оценка по зачету выставляется в 100-балльной шкале и в традиционной четырехбалльной шкале. Перевод 100-балльной рейтинговой оценки по дисциплине в традиционную четырехбалльную осуществляется следующим образом:

100-балльная система	Традиционная система
50 - 100 баллов	Зачтено
0 - 49 баллов	Не зачтено

4.2 Типовые оценочные средства текущего контроля

Подготовка реферата с презентацией

Тема 1. Фундаментальные понятия рынка ценных бумаг и его роль в финансовой системе

1. Механизм функционирования рынка ценных бумаг.
2. Характеристика основных целей инвестирования: получение дохода и прирост капитала.
3. Факторы, определяющие принятие инвестиционных решений: доходность инвестиций; ликвидность финансового инструмента; оценка риска.
4. Инвестиции, обеспечивающие текущий доход, и инвестиции, обеспечивающие прирост капитала.
5. Инвестиции с низким риском и высокой степенью риска.
6. Взаимосвязь доходности, риска и ликвидности.

Тестирование

Тема 2. Банк на фондовой бирже. Биржевые индексы. Листинг. Интернет трейдинг.

1. Рынок ценных бумаг представляет собой:
 - место, где продаются и покупаются ценные бумаги;
 - совокупность экономических отношений, возникающих в процессе выпуска, обращения на вторичном рынке;
 - систему уполномоченных банков, осуществляющих операции с ценными бумагами;
 - финансовый механизм мобилизации денежных средств.
2. Основными задачами рынка ценных бумаг являются:
 - получение государством и финансово-экономическими структурами денежных средств, необходимых для долгосрочных инвестиций;
 - обеспечение перераспределения финансовых средств от одних предприятий или отраслей экономики к другим;
 - распределение капиталов между участниками рынка.
3. Акция является эмиссионной ценной бумагой:
 - да;
 - нет;
4. Облигация является эмиссионной ценной бумагой:
 - да;
 - нет.

4.3 Промежуточная аттестация по дисциплине проводится в форме зачета

Типовые вопросы зачета (ПК-2)

1. Вексельный рынок: сущность учета векселей; учетный процент и учетная ставка; субъекты вексельного рынка.
2. Депозиты (вклады) в системе ценных бумаг: основные виды. Депозитные сертификаты – виды, выпуск, право приобретения, сроки действия.
3. Казначейские обязательства: право их эмиссии, право их приобретения, достоинства и недостатки. Стоимость казначейских обязательств.
4. Облигации в системе ценных бумаг: сущность, достоинства и недостатки, виды облигаций по степени обеспечения залогом, по срокам выкупа, по особым условиям конверсии.
5. Эмиссия и продажа облигаций. Первичная продажа облигаций. Продажа облигаций на вторичном рынке. Доходность облигаций. Инвестиционная привлекательность облигаций.
6. Государственные облигации на российском фондовом рынке: долгосрочные, среднесрочные, краткосрочные.

Типовые задания для зачета (ПК-2)

1. Через 110 дней после выплаты последнего купона инвестор приобрел облигацию за 109% и через 62 дня после покупки продал ее за 115% (цены приведены с учетом накопленного купонного дохода). Величина объявленного полугодового купонного дохода составляет 9%. Определить общую доходность (в годовых процентах), которую обеспечила инвестору облигация и «чистые» цены покупки и продажи.
2. Облигации с переменным купоном продаются с дисконтом в 18%, срок их обращения 2 года. Купонный доход выплачивается по полугодиям и объявлен на первый год в размере 8%, на второй – 6% от номинала. Инвестор приобрел пакет облигаций при их первичном размещении эмитентом. Какую общую среднюю доходность (в годовых процентах) от владения этим пакетом ожидает инвестор, если он будет держать его до погашения? А если намерен продать после 1 года владения?
3. Инвестиционный фонд сформировал портфель из трех видов облигаций, купленных одновременно по рыночной цене (рыночная процентная ставка в момент покупки - 23%). Условия выпуска облигаций и их количество в портфеле приведены ниже:
 Вид облигации «А»:
 Номинал - 100
 Срок до погашения - 6 месяцев
 Периодичность выплаты дохода - Доход не выплачивается
 Ставка купона - Нет
 Приобретенное количество, шт. 1000
 Вид облигации «Б»:
 Номинал - 500
 Срок до погашения - 1 год
 Периодичность выплаты дохода - 2 раза в год
 Ставка купона - 30%
 Приобретенное количество, шт. 10000
 Вид облигации «В»:
 Номинал - 1000
 Срок до погашения - 2 года
 Периодичность выплаты дохода - 4 раза в год
 Ставка купона - 25%
 Приобретенное количество, шт. – 5000
 Через полгода все ценные бумаги были проданы по рыночной цене, рыночная ставка процента на момент продажи составляла 28%. Рассчитайте доходность портфеля (в годовых процентах). Используйте формулу рыночной цены облигации.

4.4. Шкала оценивания промежуточной аттестации

Оценка	Компетенции	Дескрипторы (уровни) – основные признаки освоения (показатели достижения результата)
«зачтено» (50 - 100 баллов)	ПК-2	Знает основы брокерской и трастовой деятельности в РФ. Умеет выбирать брокерский тариф в интересах клиента с учетом его потребностей. Владеет навыками трастового управления активами клиента
«не зачтено» (0 - 49 баллов)	ПК-2	Отсутствуют знания о основах брокерской и трастовой деятельности в РФ. Не умеет выбрать брокерский тариф в интересах клиента с учетом его потребностей. Отсутствуют навыки трастового управления активами клиента

5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

5.1 Методические указания по организации самостоятельной работы обучающихся:

Приступая к изучению дисциплины, в первую очередь обучающимся необходимо ознакомиться содержанием рабочей программы дисциплины (РПД), которая определяет содержание, объем, а также порядок изучения и преподавания учебной дисциплины, ее раздела, части.

Для самостоятельной работы важное значение имеют разделы «Объем и содержание дисциплины», «Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины» и «Материально-техническое обеспечение дисциплины, программное обеспечение, профессиональные базы данных и информационные справочные системы».

В разделе «Объем и содержание дисциплины» указываются все разделы и темы изучаемой дисциплины, а также виды занятий и планируемый объем в академических часах.

В разделе «Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины» указана рекомендуемая основная и дополнительная литература.

В разделе «Материально-техническое обеспечение дисциплины, программное обеспечение, профессиональные базы данных и информационные справочные системы» содержится перечень профессиональных баз данных и информационных справочных систем, необходимых для освоения дисциплины.

5.2 Рекомендации обучающимся по работе с теоретическими материалами по дисциплине

При изучении и проработке теоретического материала необходимо:

- просмотреть еще раз презентацию лекции в системе MOODLe, повторить законспектированный на лекционном занятии материал и дополнить его с учетом рекомендованной дополнительной литературы;
- при самостоятельном изучении теоретической темы сделать конспект, используя рекомендованные в РПД источники, профессиональные базы данных и информационные справочные системы;
- ответить на вопросы для самостоятельной работы, по теме представленные в пункте 3.2 РПД.
- при подготовке к текущему контролю использовать материалы фонда оценочных средств (ФОС).

5.3 Рекомендации по работе с научной и учебной литературой

Работа с основной и дополнительной литературой является главной формой самостоятельной работы и необходима при подготовке к устному опросу на семинарских занятиях, к дебатам, тестированию, экзамену. Она включает проработку лекционного материала и рекомендованных источников и литературы по тематике лекций.

Конспект лекции должен содержать реферативную запись основных вопросов лекции, в том числе с опорой на размещенные в системе MOODLe презентации, основных источников и литературы по темам, выводы по каждому вопросу. Конспект может быть выполнен в рамках распечатки выдачи презентаций лекций или в отдельной тетради по предмету. Он должен быть аккуратным, хорошо читаемым, не содержать не относящуюся к теме информацию или рисунки.

Конспекты научной литературы при самостоятельной подготовке к занятиям должны содержать ответы на каждый поставленный в теме вопрос, иметь ссылку на источник информации с обязательным указанием автора, названия и года издания используемой научной литературы. Конспект может быть опорным (содержать лишь основные ключевые позиции), но при этом позволяющим дать полный ответ по вопросу, может быть подробным. Объем конспекта определяется самим студентом.

В процессе работы с основной и дополнительной литературой студент может:

- делать записи по ходу чтения в виде простого или развернутого плана (создавать перечень основных вопросов, рассмотренных в источнике);
- составлять тезисы (цитирование наиболее важных мест статьи или монографии, короткое изложение основных мыслей автора);
- готовить аннотации (краткое обобщение основных вопросов работы);
- создавать конспекты (развернутые тезисы).

5.4. Рекомендации по подготовке к отдельным заданиям текущего контроля

Собеседование предполагает организацию беседы преподавателя со студентами по вопросам практического занятия с целью более обстоятельного выявления их знаний по определенному разделу, теме, проблеме и т.п. Все члены группы могут участвовать в обсуждении, добавлять информацию, дискутировать, задавать вопросы и т.д.

Устный опрос может применяться в различных формах: фронтальный, индивидуальный, комбинированный. Основные качества устного ответа подлежащего оценке:

- правильность ответа по содержанию;
- полнота и глубина ответа;
- сознательность ответа;
- логика изложения материала;
- рациональность использованных приемов и способов решения поставленной учебной задачи;
- своевременность и эффективность использования наглядных пособий и технических средств при ответе;
- использование дополнительного материала;
- рациональность использования времени, отведенного на задание.

Устный опрос может сопровождаться презентацией, которая подготавливается по одному из вопросов практического занятия. При выступлении с презентацией необходимо обращать внимание на такие моменты как:

- содержание презентации: актуальность темы, полнота ее раскрытия, смысловое содержание, соответствие заявленной темы содержанию, соответствие методическим требованиям (цели, ссылки на ресурсы, соответствие содержания и литературы), практическая направленность, соответствие содержания заявленной форме, адекватность использования технических средств учебным задачам, последовательность и логичность презентуемого материала;
- оформление презентации: объем (оптимальное количество), дизайн (читаемость, наличие и соответствие графики и анимации, звуковое оформление, структурирование информации, соответствие заявленным требованиям), оригинальность оформления, эстетика, использование возможности программной среды, соответствие стандартам оформления;
- личностные качества: ораторские способности, соблюдение регламента, эмоциональность, умение ответить на вопросы, систематизированные, глубокие и полные знания по всем разделам программы;
- содержание выступления: логичность изложения материала, раскрытие темы, доступность изложения, эффективность применения средств ИКТ, способы и условия достижения результативности и эффективности для выполнения задач своей профессиональной или учебной деятельности, доказательность принимаемых решений, умение аргументировать свои заключения, выводы.

6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

6.1 Основная литература:

1. Чалдаева Л. А., Килячков А. А. Рынок ценных бумаг : Учебник для вузов. - пер. и доп; 7-е изд.. - Москва: Юрайт, 2020. - 381 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/449745>
2. Берзон Н. И., Аршавский А. Ю., Галанова А. В., Касаткин Д. М., Красильников А. С., Курочкин С. В., Меньшиков С. М., Столяров А. И. Рынок ценных бумаг : Учебник для вузов. - пер. и доп; 5-е изд.. - Москва: Юрайт, 2020. - 514 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/449663>
3. Михайленко М. Н. Рынок ценных бумаг : Учебник и практикум для вузов. - пер. и доп; 2-е изд.. - Москва: Юрайт, 2020. - 326 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/450543>

6.2 Дополнительная литература:

1. Газалиев М. М., Осипов В. А. Рынок ценных бумаг : учебное пособие. - Москва: Дашков и К°, 2018. - 160 с. - Текст : электронный // ЭБС «Университетская библиотека онлайн» [сайт]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=495766>
2. Алехин Б. И. Рынок ценных бумаг : Учебник и практикум для вузов. - испр. и доп; 2-е изд.. - Москва: Юрайт, 2020. - 497 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/452367>
3. Алиев, А. Р. Рынок ценных бумаг в России : учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальности «финансы и кредит». - 2020-10-10; Рынок ценных бумаг в России. - Москва: ЮНИТИ-ДАНА, 2017. - 199 с. - Текст : электронный // IPR BOOKS [сайт]. - URL: <http://www.iprbookshop.ru/71224.html>
4. Маренков Н. Л., Косаренко Н. Н. Рынок ценных бумаг в России : учебное пособие. - 5-е изд., стер.. - Москва: Флинта, 2016. - 122 с. - Текст : электронный // ЭБС «Университетская библиотека онлайн» [сайт]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=83213>
5. Горловская, И. Г. Профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг : учебное пособие и комплекс по использованию системы балльно-рейтинговой оценки успеваемости студентов (направление подготовки бакалавров 080100.62 «экономика», профиль 080100.04.62 «финансы и кредит»). - 2022-04-16; Профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг. - Омск: Омский государственный университет им. Ф.М. Достоевского, 2012. - 148 с. - Текст : электронный // IPR BOOKS [сайт]. - URL: <http://www.iprbookshop.ru/24925.html>

6.3 Иные источники:

1. Журнал «БИТ» - <http://bit.samag.ru/>
2. Журнал «Вопросы экономики» - <http://www.vopreco.ru>.
3. Журнал «Финансы» - <http://www.finance-journal.ru/>
4. Журнал «Финансы и кредит» - <http://www.fin-izdat.ru/journal/fc/>
5. Журнал «Экономист» - <http://www.economist.com.ru/>
6. Журнал «Экономический анализ: теория и практика» - <http://www.fin-izdat.ru/journal/analiz/>
7. Журнал РИСК - <http://www.risk-online.ru/>

7. Материально-техническое обеспечение дисциплины, программное обеспечение, профессиональные базы данных и информационные справочные системы

Для проведения занятий по дисциплине необходимо следующее материально-техническое обеспечение: учебные аудитории для проведения занятий лекционного и семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, помещения для самостоятельной работы.

Учебные аудитории и помещения для самостоятельной работы укомплектованы специализированной мебелью и техническими средствами обучения, служащими для представления учебной информации большой аудитории.

Помещения для самостоятельной работы укомплектованы компьютерной техникой с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду Университета.

Для проведения занятий лекционного типа используются наборы демонстрационного оборудования, обеспечивающие тематические иллюстрации (проектор, ноутбук, экран/ интерактивная доска).

Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение:

Kaspersky Endpoint Security для бизнеса - Стандартный Russian Edition. 1500-2499 Node 1 year Educational Renewal Licence

Операционная система Microsoft Windows 10

Microsoft Office Профессиональный плюс 2007

7-Zip 9.20

Adobe Reader XI (11.0.08) - Russian Adobe Systems Incorporated 10.11.2014 187,00 MB 11.0.08

Операционная система "Альт Образование"

Adobe Photoshop CS3

1С:Предприятие 8.2 (8.2.18.61) учебная

Электронный периодический справочник "Система ГАРАНТ"

LiteManager Pro - Server

CorelDRAW Graphics Suite X3

IBM SPSS Statistics 20

Oracle VM VirtualBox 3.2.10

Skype

Statistica Base 10 for Windows RU

Консультант Плюс

Альт-Инвест сумм

Операционная система Microsoft Windows XP SP3

Профессиональные базы данных и информационные справочные системы:

1. Электронный каталог Фундаментальной библиотеки ТГУ. – URL: <http://biblio.tsutmb.ru/elektronnyij-katalog>
2. ЭБС «Университетская библиотека онлайн» . – URL: <http://www.biblioclub.ru>
3. Справочная правовая система "Консультант плюс". – URL: <http://www.consultant.ru>
4. Цифровой образовательный ресурс IPR SMART. – URL: <http://www.iprbookshop.ru>
5. Web of Science: политематическая реферативно-библиографическая и наукометрическая база данных . – URL: <https://apps.webofknowledge.com>
6. Архив научных журналов зарубежных издательств. – URL: <https://arch.neicon.ru>
7. Научная электронная библиотека eLIBRARY.ru. – URL: <https://elibrary.ru>
8. Платформа Springer Link. – URL: <https://link.springer.com>
9. Юрайт: электронно-библиотечная система. – URL: <https://urait.ru>
10. Президентская библиотека имени Б.Н. Ельцина. – URL: <https://www.prilib.ru>
11. Scopus: база данных . – URL: <https://www.scopus.com>

Электронная информационно-образовательная среда

https://auth.tsutmb.ru/authorize?response_type=code&client_id=moodle&state=xyz

Взаимодействие преподавателя и студента в процессе обучения осуществляется посредством мультимедийных, гипертекстовых, сетевых, телекоммуникационных технологий, используемых в электронной информационно-образовательной среде университета.