МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тольяттинский государственный университет»

Б1.В.ДВ.04.02
(индекс дисциплины)

ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН
ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ

Сертификат: 017804780049AF848E43F1EC2D4B4CC120
Владелец: Искосков Максим Олегович
Действителен: с 10.11.2022 до 10.11.2023

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Анализ рынка ценных бумаг

(наименование дисциплины)

по направлению подготовки (специальности)
38.03.01 Экономика

направленность (профиль)/специализация
Финансовый менеджмент

Форма обучения: заочная

Год набора: 2020

Общая трудоемкость: 4 ЗЕ

Распределение часов дисциплины по курсам

Курс	5	**Итого**
Форма контроля / **Вид занятий**	зачет	
Лекции	4	4
Лабораторные		
Практические	8	8
Руководство: курсовые работы (проекты) / РГР		
Промежуточная аттестация	0,25	0,25
Контактная работа	12,25	12,25
Самостоятельная работа	128	128
Контроль	3,75	3,75
Итого	144	144

Рабочую программу составил(и):
старший преподаватель департамента бакалавриата (экономических и управленческих программ) Кирюшкина А.Н.

(должность, ученое звание, степень, Фамилия И.О.)

(должность, ученое звание, степень, Фамилия И.О.)

Рецензирование рабочей программы дисциплины:

[X] Отсутствует

[ ] Рецензент

(должность, ученое звание, степень, Фамилия И.О.)

Рабочая программа дисциплины составлена на основании ФГОС ВО и учебного плана направление подготовки 38.03.01 «Экономика», направленность (профиль): «Финансовый менеджмент».

Срок действия рабочей программы дисциплины до «31» августа 2025 г.

УТВЕРЖДЕНО

На заседании департамента бакалавриата (экономических и управленческих программ)

(протокол заседания № 1 от « 1 » сентября 2020 г.).

1. Цель освоения дисциплины

Цель освоения дисциплины – освоение студентами основных теоретических положений и практических навыков в области рынка ценных бумаг.

2. Место дисциплины в структуре ОПОП ВО

Дисциплины и практики, на освоении которых базируется данная дисциплина: Экономика, Ценные бумаги и производные финансовые инструменты, Управление инвестициями и др.

Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины необходимо как предшествующее: Производственная практика (преддипломная практика) и др.

3. Планируемые результаты обучения

Формируемые и контролируемые компетенции (код и наименование)	**Индикаторы достижения компетенций** (код и наименование)	**Планируемые результаты обучения**
ПК-12 Способен организовать сбор, обработку и анализ информации, в том числе с применением социологических, маркетинговых исследований	ПК-12.3. Способность организовать сбор, обработку и анализ данных фондового рынка для решения профессиональных задач	Знать: - методики и методы сбора, анализа и обработки данных фондового рынка для решения профессиональных задач
		Уметь: - осуществлять поиск информации и проводить анализ рынка ценных бумаг путем применения различных методов и методик для решения профессиональных задач
		Владеть: - навыками проведения технического и фундаментального анализа на рынке ценных бумаг для решения профессиональных задач
ПК-13 Способен мониторить информационные источники финансовой информации	ПК-13.6. Способность проводить мониторинг информационных источников с данными фондового рынка для решения профессиональных задач	Знать: - методы проведения мониторинга информационных источников с данными фондового рынка для решения профессиональных задач
		Уметь: - применять методы проведения мониторинга информационных источников с данными фондового рынка для решения профессиональных задач
		Владеть:

Формируемые и контролируемые компетенции (код и наименование)	**Индикаторы достижения компетенций** (код и наименование)	**Планируемые результаты обучения**
		- навыками применения методов проведения мониторинга информационных источников с данными фондового рынка для решения профессиональных задач
ПК-15 Способен организовать и поддерживать постоянные контакты с рейтинговыми агентствами, аналитиками, инвестиционными организациями, консалтинговыми организациями, аудиторскими организациями, оценочными фирмами, государственными и муниципальными органами управления, общественными организациями, средствами массовой информации, информационными, рекламными агентствами	ПК-15.5. Способность организовать и поддерживать постоянные контакты с инвестиционными организациями, консалтинговыми организациями и общественными организациями в области фондового рынка	Знать: - методы организации и поддержки постоянных контактов с инвестиционными организациями, консалтинговыми организациями и общественными организациями в области фондового рынка
		Уметь: - применять методы организации и поддержки постоянных контактов с инвестиционными организациями, консалтинговыми организациями и общественными организациями в области фондового рынка
		Владеть: - навыками применения методов организации и поддержки постоянных контактов с инвестиционными организациями, консалтинговыми организациями и общественными организациями в области фондового рынка

4. Структура и содержание дисциплины

Модуль (раздел)	Вид учебной работы	Наименование тем занятий (учебной работы)	Семестр	Объем, ч.	Баллы	Интерактив, ч.	Формы текущего контроля (наименование оценочного средства)
1	Лек	1. Фундаментальные понятия рынка ценных бумаг	9	2	8	-	Промежуточный тест 1
	Пр						
	Ср			15			
2	Лек	2. Регулирование рынка ценных бумаг	9		8	-	Промежуточный тест 2
	Пр						
	Ср			18			
3	Лек	3. Ценные бумаги: сущность, классификация и виды	9		8	-	Задание 1 Задание 2 Задание 3 Промежуточный тест 3
	Пр			6			
	Ср			25			
4	Лек	4. Эмитенты и инвесторы на рынке ценных бумаг	9	2	8	-	Задание 4 Промежуточный тест 4
	Пр						
	Ср			20			
5	Лек	5. Профессиональные участники рынка ценных бумаг	9		8	-	Промежуточный тест 5
	Пр						
	Ср			19			
6	Лек	6. Основные принципы брокерской деятельности	9		7	-	Промежуточный тест 6
	Пр			2			
	Ср			20			
7	Лек	7. Биржа как классический институт рыночной экономики	9		10	-	Промежуточный тест 7
	Пр						
	Ср			13			
Промежуточная аттестация				0,25			
Анкета					3		

Модуль (раздел)	Вид учебной работы	Наименование тем занятий (учебной работы)	Семестр	Объем, ч.	Баллы	Интерактив, ч.	Формы текущего контроля (наименование оценочного средства)
Контроль				3,75			
Итоговое тестирование					40		
			Итого:	**144**	**100**		

5. Образовательные технологии

С целью формирования компетенций у студентов в учебном процессе используется: дистанционные образовательные технологии.

6. Методические указания по освоению дисциплины

Дисциплина подразумевает аудио-/видео- лекции электронного учебника с консультацией преподавателя на форуме, а также выполнение практических заданий с консультацией преподавателя на форуме и через комментарии в заданиях.

Самостоятельная работа способствует формированию аналитического и творческого мышления, совершенствует способы организации учебной деятельности, воспитывает целеустремленность, систематичность и последовательность в работе студентов, развивает у них навык завершать начатую работу.

Виды самостоятельной работы студентов:

1. Самостоятельное изучение материалов электронного учебника с разделением на лекции и с тестами для самоконтроля по каждой лекции, анализ поведения обучающихся при помощи LRS-системы и Experience API, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга

2. Самостоятельное выполнение практических заданий, контроль смены IP-адресов, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга

3. Самостоятельное тестирование по банку тестовых заданий, анализ поведения тестирующихся при помощи LRS-системы и Experience API, контроль смены IP-адресов, удаленная аутентификация при помощи распознавания лиц, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга

В качестве необходимых материально-технических ресурсов применяется LMS-система на основе Moodle, компьютер, либо планшет, либо смартфон.

7. Оценочные средства

7.1. Паспорт оценочных средств

Семестр	Код контролируемой компетенции (или ее части)	Наименование оценочного средства
9	ПК-12	Промежуточный тест 1-7 Задание 1,2,3,4 Итоговое тестирование Вопросы к зачету
9	ПК-13	Промежуточный тест 1-7 Задание 1,2,3,4 Итоговое тестирование Вопросы к зачету
9	ПК-15	Промежуточный тест 1-7 Задание 1,2,3,4 Итоговое тестирование Вопросы к зачету

7.2. Типовые задания или иные материалы, необходимые для текущего контроля

7.2.1. Примерный перечень заданий промежуточных тестов, итогового тестирования

1 Укажите ценную бумагу, являющуюся инструментом товарного рынка:
А. Вексель
Б. Чек
В. Коносамент
Г. Опцион эмитента

2 Если права, удостоверенные ценной бумагой, могут принадлежать только названному в ценной бумаге лицу, ценная бумага называется:
А. Именной ценной бумагой
Б. Ордерной ценной бумагой
В. Ценной бумагой на предъявителя

3 Укажите долевые финансовые инструменты.
А. Акция, опцион эмитента, инвестиционный пай
Б. Вексель, акция, ипотечный сертификат участия
В. Ипотечный сертификат участия, акция, инвестиционный пай
Г. Опцион эмитента, ипотечный сертификат участия, акция

4 Основная цель стратегического инвестора заключается в следующем:
А. Расширение сферы влияния и участие в управлении предприятием
Б. Текущий доход от принадлежащих ценных бумаг
В. Максимальное получение курсовой разницы от каждой сделки
Г. Защита вложений от инфляции и получение гарантированного дохода при минимальном риске и низких затратах на управление

5 Листинг – это:
А. Включение фондовой биржей ценных бумаг в котировальный список
Б. Исключение фондовой биржей ценных бумаг из котировального списка

В. Регистрация организатором торговли заявок, поданных участниками торгов
Г. Регистрация сделок, совершенных на торгах у организатора торговли

6 Уставный капитал компании составляют 800 тыс. обыкновенных и 200 тыс. привилегированных акций. Чистая прибыль компании, подлежащая распределению в виде дивидендов, составила 10 млн. руб. Величина дивиденда по привилегированным акциям составляет 8 руб. на одну акцию. Рассчитайте значение показателя дивиденда на 1 обыкновенную акцию.

А. 10,5 руб.
Б. 25 руб.
В. 42 руб.
Г. 12,5 руб.

7 Уставный капитал компании составляют 1000 тыс. обыкновенных и 100 тыс. привилегированных акций. Чистая прибыль компании, подлежащая распределению в виде дивидендов, составила 10 млн. руб. Величина дивиденда по привилегированным акциям составляет 8 руб. на одну акцию. Рассчитайте значение показателя дивиденда на 1 обыкновенную акцию.

А. 8 руб.
Б. 9,2 руб.
В. 10 руб.
Г. 12,5 руб.

8 Уставный капитал компании составляют 1000 тыс. обыкновенных и 100 тыс. привилегированных акций. Чистая прибыль компании, подлежащая распределению в виде дивидендов, составила 10 млн. руб. Величина дивиденда по привилегированным акциям составляет 10 руб. на одну акцию. Рассчитайте значение показателя дивиденда на 1 обыкновенную акцию.

А. 9 руб.
Б. 10 руб.
В. 11 руб.
Г. 12 руб.

9 Уставный капитал компании составляют 900 тыс. обыкновенных и 200 тыс. привилегированных акций. Чистая прибыль компании, подлежащая распределению в виде дивидендов, составила 100 млн. руб. Величина дивиденда по привилегированным акциям составляет 50 руб. на одну акцию. Рассчитайте значение показателя дивиденда на 1 обыкновенную акцию.

А. 50 руб.
Б. 100 руб.
В. 150 руб.
Г. 200 руб.

10 Уставный капитал компании составляют 500 тыс. обыкновенных и 50 тыс. привилегированных акций. Чистая прибыль компании, подлежащая распределению в виде дивидендов, составила 20 млн. руб. Величина дивиденда по привилегированным акциям составляет 80 руб. на одну акцию. Рассчитайте значение показателя дивиденда на 1 обыкновенную акцию.

А. 8 руб.
Б. 16 руб.
В. 24 руб.
Г. 32 руб.

11 Одной из функций облигаций с точки зрения эмитента является:

А. Привлечения заемных средств

Б. Вложение с целью сохранения денежных средств

В. Средство залога

Г. Инструмент управления компанией

12 Номинальная стоимость всех выпущенных обществом облигаций

А. Не может превышать половину размера уставного капитала либо половину величины обеспечения, предоставленного обществу третьими лицами для цели выпуска облигаций

Б. Не может превышать размер уставного капитала общества либо величину обеспечения, предоставленного обществу третьими лицами для цели выпуска облигаций

В. Не может превышать размер уставного капитала общества более чем на 25%

Г. Не может превышать размер уставного капитала общества более чем на 50%

13 При распределении прибыли акционерного общества первыми получат доходы владельцы:

А. Облигаций

Б. Привилегированных акций

В. Обыкновенных акций

Г. Обыкновенных и привилегированных акций

14 Оговорка об отзыве:

А. Дает возможность эмитенту выкупить облигации обратно до наступления срока погашения, как правило, по цене, несколько выше номинальной

Б. Дает возможность эмитенту при отрицательной деятельности предприятия обнулить облигацию

В. Даёт возможность владельцу облигации увеличить срок до погашения

Г. Составляется при погашении облигации по окончании срока её действия

15 При повышении уровня рыночной процентной ставки рыночная цена облигации:

А. Повышается

Б. Снижается

В. Остаётся неизменной

Г. Приближается к номинальной стоимости

16 Вексель, выписанный от имени вымышленного или неплатежеспособного лица, называется:

А. Финансовый

Б. Коммерческий

В. Бронзовый

Г. Дружеский

17 Надпись на векселе, свидетельствующая о том, что трассат готов оплатить вексель:

А. Акцепт

Б. Аваль

В. Аллонж

Г. Купон

18 Денежные средства, требуемые управляющей компанией или агентом дополнительно к стоимости инвестиционных паёв при их выдаче:

А. Скидка
Б. Надбавка
В. Купон
Г. Дисконт

19 Размер надбавки не может превышать:
А. 1,5% от стоимости пая
Б. 3% от стоимости пая
В. 10% от стоимости пая
Г. 25% от стоимости пая

20 Размер скидки не может превышать:
А. 1,5% от стоимости пая
Б. 3% от стоимости пая
В. 10% от стоимости пая
Г. 25% от стоимости пая

21 Получение прибыли за счет разницы цен на одинаковые финансовые активы на различных рынках называется:
А. Спекуляция
Б. Хеджирование
В. Арбитраж
Г. Диверсификация

22 Страхование рисков получения убытков от изменения цен на финансовые активы, процентных ставок или валютных курсов посредством заключения срочных сделок называется:
А. Хеджирование
Б. Арбитраж
В. Секьюритизация
Г. Диверсификация

23 К производным финансовым инструментам относят:
А. Опционы
Б. Фьючерсы
В. Свопы
Г. Форварды
Д. Коносаменты
Е. Депозитные сертификаты

24 Укажите наиболее точное определение: «Срочный контракт - это...»:
А Соглашение о поставке в будущем предмета контракта на условиях, устанавливаемых в момент заключения контракта
Б. Соглашение о поставке предмета контракта, имеющее определенный срок действия с момента заключения контракта, но не более 1 месяца
В. Соглашение о поставке предмета контракта, условия исполнения которого будут установлены в будущем
Г. Соглашение, права и обязанности по которому возникают в момент заключения сделки

25 К финансовым фьючерсам не относят:
А. Индексные фьючерсы

Б. Товарные фьючерсы
В. Валютные фьючерсы
Г. Процентные фьючерсы

26 Финансовые фьючерсы являются в своём большинстве:
А. Поставочными
Б. Расчётными
В. Поддерживающими
Г. Вариационными

27 Сумма выигрыша или проигрыша, начисляемая по итогам торгов, называется:
А. Начальной маржой
Б. Дополнительной маржой
В. Вариационной маржой
Г. Залоговым обеспечением

28 Как называется противоположная операция по покупке/продаже аналогичного контракта, закрывающая позицию по фьючерсному контракту?
А. Хеджирование
Б. Оффсетная сделка
В. Бэквардейшн
Г. Контанго

29 Длинное хеджирование применяется для:
А. Страхования от падения цены базисного актива
Б. Страхования от роста цены базисного актива
В. Страхования крупных сделок
Г. Страхования в течение длительного времени

30 Выберите верное утверждение.
А. Фьючерсные контракты в большинстве случаев заканчиваются поставкой базового актива
Б. Гарантом по расчётам по фьючерсным контрактам выступает расчётная палата биржи
В. Товарные фьючерсы могут быть только поставочными
Г. Фьючерсная цена всегда выше цены базового актива на спотовом рынке

31 Какая из характеристик соответствует фьючерсным контрактам, а не форвардным?
А. Обращаются на внебиржевом рынке
Б. Носят стандартизированный характер
В. Имеют высокий риск контрагента
Г. В большинстве случаев заканчиваются поставкой базового актива

32 Что такое контанго?
А. Ситуация, когда фьючерсная цена ниже спот-цены базисного актива
Б. Ситуация, когда фьючерсная цена равна спот-цене базисного актива
В. Ситуация, когда фьючерсная цена выше спот-цены базисного актива

33 Что такое бэквордейшн?
А. Ситуация, когда фьючерсная цена ниже спот-цены базисного актива
Б. Ситуация, когда фьючерсная цена равна спот-цене базисного актива
В. Ситуация, когда фьючерсная цена выше спот-цены базисного актива

34 Соглашение о купле/продаже стандартизированного биржевого актива в определённое время в будущем по заранее фиксированной цене – это:

А. Фьючерс

Б. Форвард

В. Опцион

Г. Своп

35 Разница между фьючерсной ценой базового актива и его ценой на спотовом рынке называется:

А. Базис

Б. Вариационная маржа

В. Контанго

Г. Бэквордэйшн

36 Возвращаемый страховой взнос, взимаемый биржей при открытии позиции по фьючерсному контракту:

А. Начальная маржа

Б. Вариационная маржа

В. Дополнительная маржа

37 Для фьючерсных контрактов характерно следующее:

А. Биржевая процедура торгов

Б. Контракты не стандартизированы

В. Отсутствие гаранта

Г. Расчёт ежедневный

38 Фьючерс, по которому предусмотрена лишь выплата разницы между заложенной в срочный контракт стоимостью актива и его ценой на рынке в момент исполнения договора:

А. Расчётный

Б. Поставочный

В. Оффсетный

Г. Вариационный

39 Длинное хеджирование применяется для:

А. Страхования от падения цены базового актива

Б. Страхования от роста цены базового актива

В. Страхования опционными контрактами

40 Короткое хеджирование применяется для:

А. Страхования от падения цены базового актива

Б. Страхования от роста цены базового актива

В. Страхования опционными контрактами

41 Эквивалентные фьючерсам внебиржевые производные инструменты называются:

А. Варрантами

Б. Форвардами

В. Опционами

Г. Свопами

42 Укажите правильное утверждение о соотношении риска и дохода при инвестировании на финансовом рынке:

А. Чем ниже риск, тем выше должен быть ожидаемый доход

Б. Чем выше риск, тем выше должен быть ожидаемый доход

В. Чем выше доход, тем ниже должен быть предполагаемый риск

Г. Риск и доход не связаны между собой

43 Способ снижения совокупного риска портфеля финансовых активов (ценных бумаг), заключающийся в распределении инвестиций между различными активами, входящими в него, называется:

А. Диверсификация

Б. Секьюритизация

В. Арбитраж

Г. Коллективное инвестирование

44 Участники рынка, которые занимают позиции, исходя из ожидаемого движения цен в будущем, с целью извлечения прибыли из разницы в цене, называются:

А. Арбитражёры

Б. Хеджеры

В. Спекулянты

Г. Инвесторы

45 Какое из положений противоречит фундаментальному анализу:

А. Анализируемая компания в будущем будет действующим предприятием

Б. Предприятие имеет внутреннюю стоимость, которую можно определить путем анализа данных о компании

В. В каждый момент внутренняя стоимость предприятия совпадает с его рыночной стоимостью

Г. Внутренняя стоимость предприятия будет признана рынком в долгосрочной перспективе

46 Не является постулатом технического анализа:

А. История повторяется

Б. Возможно получение прибыли из разницы в ценах

В. Движение цен подчинено тенденциям

Г. Рынок учитывает все

47 Если каждый последующий пик и спад выше предыдущего, это:

А. Восходящая тенденция

Б. Нисходящая тенденция

В. Горизонтальная тенденция

Г. Промежуточная тенденция

48 Если каждый последующий пик и спад ниже предыдущего, это:

А. Восходящая тенденция

Б. Нисходящая тенденция

В. Горизонтальная тенденция

Г. Промежуточная тенденция

49 Почему средневзвешенный индекс считается наиболее репрезентативным?

А. Потому что усредняет движение рыночных цен всех акций, обращающихся на рынке

Б. Потому что акции, имеющие наибольшую рыночную стоимость, оказывают наиболее значительное воздействие на изменение индекса

В. Потому что акции, имеющие значительные колебания рыночных цен, оказывают наибольшее воздействие на изменение индекса

Г. Потому что акции компаний, имеющих наибольшую капитализацию, оказывают наиболее значительное воздействие на изменение индекса

50 Какая из перечисленных ниже фигур не относится к формациям продолжения?

А. Треугольник

Б. Флаг

В. Блюдце

Г. Клин

51 Клиент отдает брокеру приказ продать принадлежащие ему 100 акций компании по наилучшей цене. Данный приказ называется:

А. Тэйк-профит

Б. Стоп-приказ

В. Лимитный

Г. Рыночный

Краткое описание и регламент выполнения

Студент выполняет все предложенные задания, система выставляет за них баллы автоматически пропорционально правильным ответам.

Критерии оценки:

Формы текущего контроля	Критерии и нормы оценки
Промежуточный тест 1	Максимальное количество баллов - 8 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Промежуточный тест 2	Максимальное количество баллов - 8 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Промежуточный тест 3	Максимальное количество баллов - 8 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Промежуточный тест 4	Максимальное количество баллов - 8 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Промежуточный тест 5	Максимальное количество баллов - 8 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Промежуточный тест 6	Максимальное количество баллов - 7 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Промежуточный тест 7	Максимальное количество баллов - 10 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)

Итоговый тест	Максимальное количество баллов - 40 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)

7.2.2. Задания

Задание 1

Несколько предпринимателей решают создать акционерное общество. Предполагаемый размер уставного фонда вновь образуемого предприятия – 7 млн. руб. Первый учредитель внёс в общее дело 1,5 млн. руб., второй – 2 млн. руб., третий - 900 тыс. руб., четвёртый – 300 тыс. руб. Уставный фонд был поделён на 10 тыс. акций. Определить: 1) номинальную стоимость одной акции; 2) количество акций, которое нужно было продать сторонним покупателям, чтобы полностью сформировать уставный фонд. С момента создания акционерного общества прошло два года. Активы акционерного общества оцениваются в 9 млн. руб. По итогам года решено направить на выплату дивидендов 600 тыс. руб. из чистой прибыли. Определить: 3) балансовую стоимость одной акции; 4) величину дивиденда, приходящуюся на одну акцию.

Задание 2

Рассчитайте рыночную стоимость облигации номиналом 10 000 руб., ставкой купонного дохода 14% годовых (выплачивается ежеквартально) и сроком погашения 2 года, если ставка процента по вкладу в банке составляет 12% годовых.

Задание 3

Цена базового актива сегодня – 500 д. е. Хеджер-покупатель через полгода планирует купить базовый актив, но опасается роста его цены. С целью хеджирования риска хеджер-продавец приобрёл опцион «колл»: цена-страйк – 500 д. е., дата экспирации – через полгода, премия – 25 д. е. Определите финансовый результат хеджера, если через полгода цена базового актива составит: 450 , 480, 500, 540, 580 д.е. Сделайте выводы.

Задание 4

Проведите подробный фундаментальный анализ рынка акций выбранной компании. Проведите подробный технический анализ рынка акций выбранной компании.

Результаты анализа должны быть подкреплены фактическими данными. Приведите краткий обзор используемых инструментов анализа. При осуществлении технического анализа необходимо привести в выполненном задании все используемые графики.

Рекомендации.

Информацию о динамике курса акций рекомендуется брать с официального сайта https://www.finam.ru/

Краткое описание и регламент выполнения

Студент прикрепляет выполненные задания в системе ДОТ, преподаватель оценивает задания каждого студента индивидуально согласно критериям оценки.

В случае, если задание выполнено неверно, преподаватель может вернуть его на доработку.

Критерии оценки:

Формы текущего контроля	Критерии и нормы оценки
Задание 1	Зачтено - задание выполнено верно (допускаются небольшие недочеты) Незачтено - задание выполнено с допущением грубых ошибок
Задание 2	Зачтено - задание выполнено верно (допускаются небольшие недочеты) Незачтено - задание выполнено с допущением грубых ошибок
Задание 3	Зачтено - задание выполнено верно (допускаются небольшие недочеты) Незачтено - задание выполнено с допущением грубых ошибок
Задание 4	Зачтено - задание выполнено верно (допускаются небольшие недочеты) Незачтено - задание выполнено с допущением грубых ошибок

7.3. Оценочные средства для промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины

7.3.1. Вопросы к промежуточной аттестации

Семестр 9

№ п/п	Вопросы к зачету
1	Понятие рынка ценных бумаг, его место и функции в экономической системе
2	Основы функционирования и основные виды рынков ценных бумаг
3	Понятие ценной бумаги. Фундаментальные свойства ценных бумаг
4	Понятие ценной бумаги. Классификация ценных бумаг по различным признакам
5	Роль и функции эмитентов на рынке ценных бумаг
6	Инвесторы. Классификация инвесторов
7	Профессиональные участники рынка ценных бумаг
8	Регулирование рынка ценных бумаг и правовая инфраструктура.
9	Государство на рынке ценных бумаг
10	Саморегулируемые организации на рынке ценных бумаг
11	Акции: общая характеристика и виды
12	Акции. Виды стоимостей акций
13	Акции. Формирование дохода по акциям
14	Облигации: общая характеристика и виды
15	Облигации. Формирование дохода по облигациям
16	Оценка рыночной стоимости купонных, бескупонных и бессрочных облигаций
17	Виды доходностей облигаций и способы их расчёта
18	Вексель: сущность, виды, основная терминология
19	Вексель: реквизиты простого и переводного векселей
20	Инвестиционный пай: сущность и краткая характеристика
21	Товарораспорядительные ценные бумаги: виды и краткая характеристика
22	Ипотечные ценные бумаги: виды и краткая характеристика
23	Государственные ценные бумаги: сущность, виды
24	Фундаментальный анализ на рынке ценных бумаг
25	Технический анализ на рынке ценных бумаг. Постулаты технического анализа
26	Технический анализ на рынке ценных бумаг. Основы графического анализа
27	Технический анализ на рынке ценных бумаг. Модели разворота и продолжения тенденции
28	Фондовые индексы и рейтинги на рынке ценных бумаг
29	Анализ риска и доходности вложения в ценные бумаги
30	Анализ риска и доходности портфеля ценных бумаг
31	Место и роль рынка производных финансовых инструментов
32	Основные участники рынка деривативов: спекулянты, хеджеры, арбитражёры
33	Понятие фьючерсных и форвардных контрактов. Сравнительная характеристика
34	Ценообразование товарных фьючерсов и форвардов
35	Ценообразование финансовых фьючерсов и форвардов
36	Механизм выявления разниц в ценах по фьючерсным контрактам: механизм досрочного закрытия позиции; механизм расчетов (понятие и виды фьючерсной маржи; организация фьючерсных расчётов)
37	Механизм исполнения обязательств по фьючерсному контракту: механизм реальной поставки; механизм окончательных расчетов

№ п/п	Вопросы к зачету
38	Применение форвардных и фьючерсных контрактов как инструмента хеджирования рисков
39	Понятие, сущность, виды опционов
40	Ценообразование опционных контрактов
41	Построение, анализ и применение опционных стратегий. Базовые стратегии
42	Построение, анализ и применение опционных стратегий. Спрэды
43	Построение, анализ и применение опционных стратегий. Комбинационные стратегии
44	Построение, анализ и применение опционных стратегий. Сложные стратегии (бабочка, кондор)
45	Построение, анализ и применение опционных стратегий. Синтетические стратегии
46	Применение опционных контрактов как инструмента хеджирования рисков
47	Содержание понятия «своп контракт»
48	Процентные свопы. Понятие, применение. Модель сравнительных преимуществ
49	Валютные свопы. Понятие, применение. Модель сравнительных преимуществ
50	Свопы финансовых активов. Понятие, применение. Модель сравнительных преимуществ
51	Товарные свопы. Понятие, применение
52	Депозитарные расписки: понятие и виды
53	Депозитарные расписки: преимущества для инвестора и эмитента
54	Депозитарные расписки: механизм выпуска
55	Депозитарные расписки: механизм обращения (в том числе конвертации)
56	Место России на рынке АДР, ГДР, ЕДР
57	Российские депозитарные расписки: сущность, практика выпуска
58	Конвертируемые облигации: понятие, преимущества для инвестора и эмитента
59	Варранты как опцион эмитента
60	Структурированные финансовые продукты на рынке деривативов

7.3.2. Критерии и нормы оценки

Семестр	Форма проведения промежуточной аттестации	Критерии и нормы оценки	
9	Зачет (по накопительному рейтингу)	«зачтено»	Студент набрал от 55 до 100 баллов по накопительному рейтингу
		«не зачтено»	Студент набрал 54 и менее баллов по накопительному рейтингу

8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

8.1. Обязательная литература

№ п/п	Авторы, составители	Заглавие (заголовок)	Тип (учебник, учебное пособие, учебно-методическое пособие, практикум, др.)	Год издания	Количество в научной библиотеке / Наименование ЭБС
1	Выгодчикова, И. Ю.	Методы анализа рынка ценных бумаг	Учебное пособие	2019	ЭБС «IPRbooks»

8.2. Дополнительная литература

№ п/п	Авторы, составители	Заглавие (заголовок)	Тип (учебник, учебное пособие, учебно-методическое пособие, практикум, др.)	Год издания	Количество в научной библиотеке / Наименование ЭБС
1	Галанов, В. А	Производные финансовые инструменты	Учебник	2019	ЭБС «Znanium.com»
2	В. А. Зверев, А. В. Зверева, С. Г. Евсюков, А. В. Макеев	Рынок ценных бумаг	Учебник	2020	ЭБС «Znanium.com»

8.3. Перечень профессиональных баз данных и информационных справочных систем

– КонсультантПлюс — Режим доступа к журн.: http://www.consultant.ru/

– Гарант.РУ [Электронный ресурс] : информационно-правовой портал — Режим доступа к журн.: http://www.garant.ru/

– Scopus[Электронный ресурс] : реферативная база данных. – Netherlands: Elsevier, 2004– . – Режим доступа : scopus.com. – Загл. с экрана. – Яз. рус., англ.

– Elibrary[Электронный ресурс] : научная электронная библиотека. – Москва : НЭБ, 2000– . – Режим доступа : elibrary.ru. – Загл. с экрана. – Яз. рус., англ.

– Бухгалтерский учет. Налоги. Аудит Audit [Электронный ресурс] : информационно-правовой портал — Режим доступа к журн.: http://www.audit-it.ru/

8.4. Перечень программного обеспечения

№ п/п	Наименование ПО	Реквизиты договора (дата, номер, срок действия)
1	Windows	Договор № 690 от 19.05.2015г., срок действия - бессрочно
2	Office Standart	Договор № 690 от 19.05.2015г., срок действия - бессрочно; Договор № 727 от 20.07.2016г., срок действия - бессрочно

8.5. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине

№ п/п	Наименование оборудованных учебных кабинетов, лабораторий, мастерских и др. объектов для проведения практических и лабораторных занятий, помещений для самостоятельной работы обучающихся (номер аудитории)	Перечень основного оборудования
1	Аудитория вебконференций. Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа. Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа. Учебная аудитория для курсового проектирования (выполнения курсовых работ). Учебная аудитория для проведения групповых и индивидуальных консультаций Учебная аудитория для проведения занятий текущего контроля и промежуточной аттестации. (Э-705)	Стол преподавательский, экран телевизионный, роутер, стойка для телевизора, веб.камера, транспарант-перетяжка, ширма,наушники, компьютер с выходом в Интернет.
2	Аудитория вебконференций Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа. Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа. Учебная аудитория для курсового проектирования (выполнения курсовых работ). Учебная аудитория для проведения групповых и индивидуальных	Стол преподавательский, экран телевизионный, роутер, стойка для телевизора, веб.камера, транспарант-перетяжка, ширма,наушники, компьютер с выходом в Интернет.

№ п/п	Наименование оборудованных учебных кабинетов, лабораторий, мастерских и др. объектов для проведения практических и лабораторных занятий, помещений для самостоятельной работы обучающихся (номер аудитории)	Перечень основного оборудования
	консультаций. Учебная аудитория для проведения занятий текущего контроля и промежуточной аттестации. (Э-405)	
3	Помещение для самостоятельной работы студентов (Г-401)	Столы ученические, стулья ученические, ПК с выходом в сеть Интернет