

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

Б1.В.ДВ.06.02  
(индекс дисциплины)

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

Биржевая деятельность

(наименование дисциплины)

по направлению подготовки (специальности)  
38.03.01 Экономика

направленность (профиль)/специализация  
Финансовый менеджмент

Форма обучения: очно-заочная

Общая трудоемкость: 3 ЗЕ

**Распределение часов дисциплины по семестрам**

Семестр	5	Итого
Форма контроля	зачет	
Вид занятий		
Лекции	6	6
Лабораторные		
Практические		
Руководство: курсовые работы (проекты) / РГР		
Промежуточная аттестация	0,25	0,25
Контактная работа	6,25	6,25
Самостоятельная работа	101,75	101,75
Контроль		
<b>Итого</b>	<b>108</b>	<b>108</b>

Рабочую программу составил(и):

доцент, канд. экон. наук Анисимова Ю.А.

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

старший преподаватель института финансов, экономики и управления Кирюшкина А.Н.

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

Рецензирование рабочей программы дисциплины:

☒

Отсутствует

☐

Рецензент

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

Рабочая программа дисциплины составлена на основании ФГОС ВО и учебного плана специальности 38.03.01 Экономика

**Срок действия рабочей программы дисциплины до «31» августа 2031 г.**

УТВЕРЖДЕНО

На заседании института финансов, экономики и управления

(протокол заседания № 1 от «28» августа 2025 г.).

### 1. Цель освоения дисциплины

Цель освоения дисциплины - формирование современной системы знаний в области тенденций развития и анализа биржевой торговли, техники осуществления биржевых операций.

### 2. Место дисциплины в структуре ОПОП ВО

Дисциплины и практики, на освоении которых базируется данная дисциплина: «Инвестиционное моделирование», «Финансовые электронные системы» и др.

Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины необходимо как предшествующее: «Управление инвестициями», «Мировые финансовые рынки», «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-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-15.6 Способен организовать и поддерживать постоянные контакты с рейтинговыми агентствами, аналитиками, инвестиционными организациями	Знать: основные элементы и показатели биржевой деятельности
		Уметь: осуществлять поиск информации и организовать и поддерживать постоянные контакты с рейтинговыми агентствами, аналитиками, инвестиционными организациями
		Владеть: методами расчёта оценки биржевых показателей

#### 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)
Модуль 1.	Лек	1.Биржи: история развития и виды бирж 2. Товарные биржи и срочные биржи	5	2	3	–	Промежуточный тест 1
	Лек	3.Фондовые биржи 4. Валютные биржи	5	2	4	–	Промежуточный тест 2
Модуль 2.	Лек	5.Биржевая торговля и ее роль 6. Анализ биржевых котировок	5	2	3		Промежуточный тест 3
	Ср	Самостоятельная работа	5	101,75	60	–	Практические задания Учебник
	ПА	Промежуточная аттестация	5	0,25	–	–	
		Контроль	5	–	30	-	Итоговое тестирование Вопросы к зачету
Итого:				108	100		

## **5. Образовательные технологии**

С целью формирования компетенций у студентов в учебном процессе используются традиционные и дистанционные образовательные технологии.

## **6. Методические указания по освоению дисциплины**

Дисциплина предусматривает ознакомление с аудио-/видеолекциями электронного учебника, получение консультаций преподавателя на форуме и комментариев к выполненным практическим заданиям, а также:

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 не менее 600 вопросов, 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.

Для осуществления указанных видов работ необходимо следующее оборудование: LMS-система на основе Moodle, компьютер (либо планшет, либо смартфон).

При подготовке к ответам на тесты по темам курса и выполнению типовых заданий обучающемуся необходимо тщательно изучить предлагаемую литературу, нормативные правовые акты, учебный материал.

Обучающийся самостоятельно работает с дополнительной и основной литературой, нормативными актами, интернет-ресурсами.

При изучении дисциплины необходимо:

1. Изучить материалы темы, выполнить промежуточный тест по теме.
2. При необходимости задать вопросы преподавателю в форуме.
3. После изучения курса выполнить итоговый тест.
4. Разместить на личной странице курса выполненные задания практикума (при наличии) для проверки преподавателем.

### **Методические рекомендации для самостоятельной работы**

Самостоятельная работа – это планируемая работа, выполняемая по заданию и при методическом руководстве преподавателя, но без его непосредственного участия.

Самостоятельная работа выполняет ряд функций, среди которых особенно выделяются:

- развивающая (повышение культуры умственного труда, приобщение к творческим видам деятельности, обогащение интеллектуальных способностей обучающихся);
- ориентирующая и стимулирующая (процессу обучения придается ускорение и мотивация);
- воспитательная (формируются и развиваются профессиональные качества специалиста);
- исследовательская (новый уровень профессионально-творческого мышления);
- информационно-обучающая (учебная деятельность обучающихся на аудиторных занятиях).

Целью самостоятельных занятий является самостоятельное более глубокое изучение обучающимися отдельных вопросов курса с использованием рекомендуемой дополнительной литературы и других информационных источников.

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

*Виды самостоятельной работы:*

- повторение пройденного учебного материала, чтение рекомендованной литературы;
- подготовка к практическим занятиям (для очной и заочной формы обучения);
- работа с электронными источниками;
- подготовка к сдаче экзамена (зачета).

Изучение теоретического материала определяется рабочей учебной программой дисциплины, включенными в нее календарным планом изучения дисциплины и перечнем литературы; рекомендуется при подготовке к занятиям повторить материал предшествующих тем рабочего учебного плана, а также материал предшествующих учебных дисциплин, который служит базой изучаемого раздела данной дисциплины.

При подготовке к практическому занятию необходимо изучить материалы лекции, рекомендованную литературу. Изученный материал следует проанализировать в соответствии с планом занятия, затем проверить степень усвоения содержания вопросов.

При подготовке к экзамену (зачету) следует руководствоваться перечнем вопросов для подготовки к итоговому контролю по курсу. При этом необходимо уяснить суть основных понятий дисциплины.

Заданием самостоятельной работы являются:

- систематизация и закрепление полученных теоретических знаний и практических умений;
- углубление и расширение теоретических знаний;
- формирование умения использовать справочную литературу.

Самостоятельная работа, прежде всего, заключается в изучении литературы, дополняющей материал, излагаемый в лекционной части курса. Необходимо овладеть навыками библиографического поиска, в том числе в сетевых Интернет-ресурсах, научиться сопоставлять различные точки зрения и определять методы исследований.

Предполагается, что, прослушав лекцию, обучающийся должен ознакомиться с рекомендованной литературой из основного списка, затем обратиться к источникам, указанным в библиографических списках изученных книг, осуществит поиск и критическую оценку материала на сайтах Интернет, соберет необходимую информацию.

При работе с основной и дополнительной литературой целесообразно придерживаться такой последовательности:

- сначала прочитать весь заданный текст в быстром темпе. Цель такого чтения заключается в том, чтобы создать общее представление об изучаемом материале, понять общий смысл прочитанного;
- затем прочитать вторично, более медленно, чтобы в ходе чтения понять и запомнить смысл прочитанного.

## 7. Оценочные средства

### 7.1. Паспорт оценочных средств

Семестр	Код контролируемой компетенции (или ее части)	Наименование оценочного средства
5	ПК-15	Промежуточные тесты Вопросы для учебника Практические задания Итоговое тестирование <i>Вопросы к зачету № 1-60</i>

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

#### 7.2.1. Тестовые задания (Учебник, промежуточный тест, итоговый тест) (наименование оценочного средства)

##### Типовые примеры тестовых заданий

1. Первоначальная форма биржевой торговли:

- валютно-вексельная
- бартерная
- фьючерсная
- товарная

2. Первая российская регулярная биржа появилась в городе:

- Санкт - Петербург
- Великий Новгород
- Москва
- Тула
- Саратов

3. Год прохождения первых фьючерсных торгов на Московской товарной бирже:

- 1992
- 1995
- 1988
- 1999

4. Основные черты биржевой торговли:

- регулярность торговли в строго определенном месте
- унификация основных требований к качеству товара
- заключение сделок с поставкой товара, как со склада, так и в будущем
- спонтанность торговли
- стандартизированность цены на товары

5. Черты организованного рынка:

- существование утвержденных правил торговли, расчетов и поставок активов
- концентрация достаточного числа продавцов и покупателей во времени и пространстве
- государственное регулирование и саморегулирование

- правила торговли и расчетов устанавливают участники торговли индивидуально для каждого торга
- монопольное положение продавцов активов
- только государственное регулирование

#### 6. Государственное регулирование биржевой деятельности:

- обеспечивает равные права и безопасность для профессиональных участников и клиентов
- создает информационную систему о биржевом рынке
- носит запретительный характер
- вводит этические нормы поведения профессиональных участников биржевого рынка с помощью общественного контроля

#### 7. Элементы саморегулирования:

- разработка правил поведения самими профессиональными участниками конкретного биржевого рынка
- установление общественного контроля
- введение этических норм поведения профессиональных участников биржевого рынка с помощью общественного контроля
- контроль за обязательным раскрытием информации участниками рынка
- реализация государственной политики развития биржевого рынка

#### 8. Товары, реализуемые на товарной бирже:

- сельскохозяйственные
- лесные
- цветные металлы
- живой скот
- произведения искусства
- антиквариат

#### 9. Правила биржевой торговли включают:

- наименования товарных секций
- порядок регистрации и учета биржевых сделок
- перечень нарушений, за которые взыскиваются штрафы
- размер уставного капитала
- максимальное количество членов биржи
- порядок приема в члены биржи, приостановления и прекращения членства

#### 10. Положения устава товарной биржи:

- размер уставного капитала
- перечень и порядок формирования постоянных фондов
- порядок котировки цен биржевых товаров
- порядок проведения биржевых торгов

#### 11. Служащие товарной биржи:

- участвуют в деятельности биржи только на основании трудового контракта
- участвуют в биржевых сделках
- создают собственные брокерские фирмы
- участвуют в биржевой торговле в качестве независимых брокеров
- имеют право использовать служебную информацию в собственных интересах

#### 12. Органы управления товарной биржи:

- общее собрание учредителей и членов биржи

- биржевой комитет
- правление биржи
- расчетно-клиринговая палата
- отдел экономического анализа

13. Вид хеджирования, используемый для страхования товаров, для которых не существует фьючерсов:

- перекрестное
- прямое
- множественное
- полное
- частичное

14. Операции при коротком хеджировании:

- продажа фьючерсного контракта в данный момент
- продажа реального товара в будущем и одновременная покупка фьючерсного контракта
- продажа реального товара в будущем и одновременная продажа фьючерсного контракта
- покупка фьючерсного контракта в данный момент
- покупка реального товара в будущем и одновременная продажа фьючерсного контракта
- покупка реального товара в будущем и одновременная покупка фьючерсного контракта

15. Отличительная особенность форвардных контрактов:

- момент заключения сделки не совпадает с моментом ее выполнения
- цена определяется в момент исполнения сделки
- стандартизированы все параметры сделки, за исключением цены
- после заключения сделки покупатель приобретает право, а не обязанность исполнить сделку

16. Содержание фьючерсной сделки:

- взаимная передача прав и обязанностей в отношении стандартных контрактов на поставку биржевого товара
- плательщик премии получает право выбора между позицией покупателя и позицией продавца в договоре поставки
- один из участников получает право покупки или продажи определенной ценности по фиксированной цене в течение установленного периода, выплачивая другому участнику премию
- брокер на основе договора поручения обязан продать от имени и за счет клиента один товар и купить от имени и за счет клиента другой товар

17. Держатель короткой позиции фьючерсного контракта:

- продавец
- покупатель
- клиринговая палата
- маклер
- хеджер

18. Объекты торговли фондовых бирж:

- акции
- облигации
- валюта
- сырье
- предметы потребления

19. Основные черты фондовой биржи:

- функционирует как некоммерческая организация
- равноправными членами могут быть только профессиональные участники рынка ценных бумаг
- равноправными членами могут быть только юридические лица, с уставным капиталом более 1 миллиона рублей
- функционирует как коммерческая организация

20. Характеристика ценных бумаг как объекта гражданских прав:

- имеют свободный характер перехода от одного лица к другому
- имеют ограничения в обороте
- неликвидны
- удостоверяют неимущественные права владельца документа

21. Первичные ценные бумаги:

- акции
- облигации
- варранты на ценные бумаги
- депозитарные расписки
- фьючерсные контракты
- опционы

22. Вторичные ценные бумаги:

- варранты на ценные бумаги
- депозитарные расписки
- фьючерсные контракты
- опционы
- акции
- облигации

23. Вторичными ценными бумагами являются:

- ценные бумаги, основанные на активах, в число которых не входят сами ценные бумаги
- акции
- облигации
- ценные бумаги, выпускаемые на основе других ценных бумаг
- варранты на ценные бумаги
- депозитарная расписка

24. Характеристика доходности акций:

- выплата дивиденда по ним
- структура основных фондов акционерного общества
- соотношение основных и оборотных фондов акционерного общества
- количество акционеров
- соотношение простых и привилегированных акций у акционерного общества

25. Отличие простых акций от привилегированных:

- дивиденды зависят от прибыли акционерного общества
- дивиденды устанавливаются по фиксированной ставке
- они выпускаются с указанием номинала и размера дивиденда
- дивиденды выплачиваются в первоочередном порядке и не зависят от прибыли акционерного общества

- имеют преимущественное право на определенную долю активов акционерного общества при его ликвидации

26. Черты классической фондовой биржи:

- централизованный рынок с фиксированным местом торговли
- свободный допуск ценных бумаг любого типа к торгам на бирже
- децентрализация регистрации сделок и расчетов по ним
- отсутствие временного регламента торговли ценными бумагами и стандартных торговых процедур

27. Процедура допуска ценных бумаг к торговле на фондовой бирже:

- листинг
- андеррайтинг
- леверидж
- индоссамент

28. Валютный арбитраж, используемый для получения прибыли в виде разницы курсов на рынке иностранных валют:

- пространственный
- временной
- процентный
- лимитированный

29. Состояние торгов на валютной бирже, при котором объем заявок на продажу становится равным объему заявок на ее покупку:

- фиксинг
- базисное состояние
- клиринг
- стандартное состояние

30. Сделка между покупателем и продавцом валюты, которая дает право покупателю приобретать по определенному курсу сумму валюты в течение обусловленного времени за вознаграждение, уплачиваемое продавцу:

- валютный опцион
- операция "своп"
- сделка "spot"
- форвардная валютная сделка
- валютный фьючерс

31. Межбанковская операция, представляющая собой наличную покупку иностранной валюты в обмен на отечественную валюту с обязательством последующего выкупа:

- операция "своп"
- сделка "spot"
- форвардная валютная сделка
- валютный фьючерс

32. Продажа или покупка определенной суммы валюты с интервалом во времени между заключением и исполнением сделки по курсу дня заключения сделки:

- форвардная валютная сделка
- сделка "spot"
- операция "своп"
- валютный фьючерс

33. Обменный курс двух валют, установленный через курс каждой из них к третьей валюте:

- кросс - курс
- курс - нетто
- прямой курс
- обратный курс

34. Режим, при котором государство остается вне пределов валютного рынка, а валютный курс устанавливается за счет законов свободной конкуренции:

- свободный флотинг
- управляемый флотинг
- фиксинг
- золотой стандарт
- фиксированный валютный курс

35. Биржевая сделка:

- зарегистрированный биржевой договор, заключаемый участниками биржевой торговли в отношении биржевого товара в ходе биржевых торгов
- соглашение, достигнутое двумя и более учредителями биржи
- соглашение, достигнутое между полными и (или) неполными членами биржи
- договор, в отношении товара, допущенного к торгам на бирже

36. Сделки с немедленной поставкой:

- спот - сделки
- форвардные сделки
- сделки с залогом
- сделки с премией
- все сделки с реальным товаром

37. Биржевые спекулянты, играющие на повышении цен:

- быки
- медведи
- лисы
- волки
- буйволы

38. Фьючерсная начальная маржа:

- гарантийный взнос, цель которого обеспечить исполнение обязательств по фьючерсному контракту
- частичный платеж за купленный товар
- платеж за услуги, предоставляемые биржей
- платеж за услуги брокеров и маклеров биржи

39. Операция с опционами, подобная длинному хеджированию:

- покупка опционов на покупку
- покупка опционов на продажу
- продажа опционов на продажу
- продажа опционов на покупку

40. Получение прибыли за счет разницы цен на одинаковые финансовые активы на различных рынках называется:

- спекуляция

- хеджирование
- арбитраж
- диверсификация

41. Если каждый последующий пик и спад выше предыдущего, это:

- восходящая тенденция
- нисходящая тенденция
- горизонтальная тенденция
- промежуточная тенденция

42. Не является постулатом технического анализа:

- история повторяется
- технический анализ позволяет получать прибыль из разницы в ценах
- движение цен подчинено тенденциям
- рынок учитывает все

43. Какая из перечисленных ниже фигур не относится к формациям продолжения?

- треугольник
- флаг
- блюдце
- клин

44. Какие из указанных ниже линий выполняют функцию уровня поддержки?

- линия нисходящего тренда
- линия восходящего тренда
- нижняя граница ценового коридора
- верхняя граница ценового коридора
- линия шеи в формации "голова и плечи"
- линия шеи в формации "перевернутые голова и плечи"

45. Из нижеперечисленных укажите признак, наиболее характерный для недооцененных акций

- устойчивое снижение цен акций
- устойчивый рост цен акций
- небольшое количество заявок на покупку акций
- внутренняя стоимость акций больше их рыночной цены
- **Краткое описание и регламент выполнения**
- Обучающийся 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 – 3 б. (баллы обучающемуся начисляются автоматически пропорционально количеству правильных ответов на тестовые задания)
Промежуточный тест 2	Максимальное количество баллов – 4 б. (баллы обучающемуся начисляются автоматически пропорционально количеству правильных ответов на тестовые задания)

Формы текущего контроля	Критерии и нормы оценки
Промежуточный тест 3	Максимальное количество баллов – 3 б. (баллы обучающемуся начисляются автоматически пропорционально количеству правильных ответов на тестовые задания)
Учебник	Максимальное количество баллов – 5 б. (баллы обучающемуся начисляются автоматически пропорционально количеству правильных ответов на тестовые задания)
Итоговый тест	Максимальное количество баллов – 30 б. (баллы обучающемуся начисляются автоматически пропорционально количеству правильных ответов на тестовые задания)

-

-

- **7.2.2. Практические задания** \_\_\_\_\_  
 - (наименование оценочного средства)

**Задание, проверяемое вручную (практическое задание) 1**

1. Прогноз инвестора относительно возможных сценариев доходности  $r$  акций компаний А и В с учетом их вероятностей  $p$  в следующем периоде представлен в таблице:

	$r(B)=20\%$	$r(B)=30\%$
$r(A)=20\%$	$p1=25\%$	$P3=25\%$
$r(A)=50\%$	$p2=15\%$	$P4=35\%$

Определите ожидаемую доходность портфеля, если удельные веса акций А и В в портфеле составляют соответственно 40% и 60%.

2. Даны следующие вероятности роста доходности акций компаний «А», «В» и «С»:  $P(A)=0,4$ ;  $P(B)=0,65$ ;  $P(C)=0,9$ . Какова вероятность того, что доходность ни одной из трёх акций не вырастет?

**Задание, проверяемое вручную (практическое задание) 2**

1. Коэффициент бета для акции от 0 до 1. За неделю курсовая стоимость этой акции упала на 8%. Что стало с ценами акций в целом по рынку за эту неделю?

2. Клиент открыл у брокера маржинальный счет и приобрёл 200 акций компании Х по курсу 60\$ за акцию. Уровень первоначальной маржи, внесенной клиентом, составил 50%. Рассчитайте уровень маржи на счете клиента, если рыночная цена акций возросла до 65\$.

3. Клиент открыл у брокера маржинальный счет и приобрёл 30 акций компании Х по курсу 150\$ за акцию. Уровень первоначальной маржи, внесенной клиентом, составил 75%. При какой рыночной стоимости акций компании Х уровень маржи на счете клиента составит 60%?

**Задание, проверяемое вручную (практическое задание) 3**

1. Портфель состоит из двух активов А и В с удельными весами 0,55 и 0,45 соответственно. Риск (стандартное отклонение доходности) активов А и В равен 6 и 15, а коэффициент корреляции между доходностями равен -0,65. Рассчитайте величину риска по портфелю.

2. Инвестор купил европейский трехмесячный опцион колл на акцию с ценой исполнения 130 руб. за 7 руб. К моменту окончания контракта спотовая цена акции составила 133 руб. Определите финансовый результат операции для инвестора.

3. Инвестор продал европейский трехмесячный опцион пут на акцию с ценой исполнения 120 руб. за 6 руб. К моменту окончания контракта спотовая цена акции составила 118 руб. Определите финансовый результат операции для инвестора.

#### Задание, проверяемое вручну (практическое задание) 4

1. Отметьте напротив каждого высказывания: верно(В)/неверно(Н)

Фундаментальный анализ используется для выбора момента покупки	В/Н
Игрок, открывший короткую позицию, ожидает падения рыночной цены актива	
Технический анализ – это качественный и количественный анализ компании с целью определения стоимости самой компании и ее ценных бумаг	
Диверсификация ведет к снижению как системного, так и несистемного риска инвестиционного портфеля	
Акции роста – это акции компаний с высоким показателем Р/Е	
Чем выше риск вложения, тем выше потенциальный доход	
Графический анализ - один из методов технического анализа, который основывается на визуальном анализе графиков цен с помощью линий тренда, ценовых моделей, уровней поддержки и сопротивления и других инструментов	
К фигурам перелома тенденции относят «голова и плечи», «блюдец», «расширяющаяся формация», «двойная вершина»	
К недостаткам скользящей средней следует отнести систематическое запаздывание сигнала	
К относительным показателям риска относят среднеквадратическое отклонение	

2. Соотнесите понятия с их определениями

1. Технический анализ	А - Риск, не поддающийся диверсификации, обусловленный внешними причинами, не зависящими от конкретных ценных бумаг
2. Фундаментальный анализ	Б - Показатель состояния и динамики рынка ценных бумаг
3. Активное управление портфелем	В - Относительный показатель риска, характеризует риск на единицу ожидаемого результата
4. Пассивное управление портфелем	Г - Управление инвестиционным портфелем, характеризующееся постоянной ротацией ценных бумаг в зависимости от рыночной ситуации и ожиданий инвестора
5. Диверсификация	Д - Один из методов снижения рисков, который заключается в распределении капитала между различными объектами вложения, непосредственно не связанных между собой
6. Несистематический риск	Е - Оценка множества внешних и внутренних факторов, существенно влияющих на финансовую и хозяйственную деятельность компании, результаты которой находят отражение в рыночной стоимости ее ценных бумаг
7. Систематический риск	Ж - Подход к управлению портфелем, заключающийся в формировании хорошо диверсифицированного портфеля с низким уровнем риска и длительном удерживании его в неизменном состоянии
8. Фондовый индекс	З - Прогнозирование изменений цен в будущем на основе

	анализа изменений цен в прошлом
9. Стандартное отклонение	И- Абсолютный показатель риска
10. Коэффициент вариации	К- Диверсифицируемый риск, связанный с конкретными ценными бумагами

### Краткое описание и регламент выполнения

Обучающийся прикрепляет выполненные задания в системе ДОТ, преподаватель оценивает задания каждого обучающегося 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
Практические задания	<p>55 баллов – задание выполнено в полном объеме согласно инструкции, сделаны выводы</p> <p>50 баллов – задание выполнено в полном объеме, оформление полностью не соответствует требованиям (отсутствует титульный лист);</p> <p>45 баллов – задание выполнено в полном объеме согласно инструкции, отсутствуют выводы и оформление полностью не соответствует требованиям (отсутствует титульный лист);</p> <p>40 баллов – задание выполнено в полном объеме, есть ошибки в решении заданий</p> <p>35 балла - задание выполнено, ошибки в одном из заданий, оформление полностью не соответствует требованиям (отсутствует титульный лист и т.д.);</p> <p>30 баллов – задание выполнено, ошибки в двух заданиях, оформление полностью не соответствует требованиям (отсутствует титульный лист и т.д.);</p> <p>25 баллов - 30 баллов – задание выполнено, ошибки в трех заданиях, оформление полностью не соответствует требованиям (отсутствует титульный лист и т.д.);</p> <p>20 баллов – задание выполнено, ошибки в четырех заданиях, оформление полностью не соответствует требованиям (отсутствует титульный лист и т.д.);</p> <p>15 баллов – задание полностью не выполнено (2 задания) и ошибки в заданиях, оформление полностью не соответствует требованиям (отсутствует титульный лист и т.д.);</p> <p>10 баллов – задание выполнено 1 задание без ошибок; или задание полностью не выполнено (2 задания) с ошибками;</p> <p>5 баллов – задание выполнено 1 задание с ошибками, оформление полностью не соответствует требованиям (отсутствует титульный лист и т.д.);</p> <p>0 баллов – задание не выполнено или выполнено не верно</p>

### 7.3. Оценочные средства для промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины

#### 7.3.1. Вопросы к промежуточной аттестации

Семестр: 5

№ п/п	Вопросы к зачету
1.	Понятие организованного рынка
2.	Отличительные черты биржевой торговли
3.	Понятие биржи и история ее возникновения
4.	Эволюция биржевой торговли в России
5.	Функции современной биржи
6.	Виды бирж. Признаки классификации бирж
7.	Биржа и организация биржевой инфраструктуры
8.	Регулирование биржевой деятельности. Понятие, виды, состав цели и принципы
9.	Государственное регулирование биржевой деятельности
10.	Саморегулирование биржевого рынка. Внутрибиржевые нормативные акты
11.	Биржевой товар. Понятие и состав
12.	Характеристика биржевого товара на товарных биржах
13.	Ценные бумаги — биржевой товар
14.	Валюта как товар
15.	Рынок ценных бумаг
16.	Товарный рынок
17.	Валютный рынок
18.	Биржевые индексы
19.	Фундаментальный анализ в биржевой торговле. Сущность
20.	Основные направления (блоки) и инструментарий фундаментального анализа
21.	Технический анализ в биржевой торговле. Сущность
22.	Методы и модели технического анализа
23.	Учредители и члены биржи
24.	Органы управления биржей
25.	Брокерская деятельность
26.	Дилерская деятельность
27.	Правила биржевых торгов
28.	Участники биржевых торгов
29.	Допуск биржевого товара к торгам
30.	Торговые поручения и их виды
31.	Механизм ведения биржевого торга
32.	Понятие о сделках с биржевым товаром
33.	Виды, особенности и порядок заключения сделок на валютной бирже
34.	Виды, особенности и порядок заключения сделок на товарной бирже
35.	Виды, особенности и порядок заключения сделок на фондовой бирже
36.	Клиринг и расчеты. Общее описание. Сущность и функции
37.	Основные виды рисков
38.	Клиринг и расчеты на рынке ценных бумаг
39.	Клиринг и расчеты на фьючерсном рынке
40.	Основные направления развития систем клиринга и расчетов
41.	Биржевые котировки. Сущность и значение
42.	Установление цены на аукционе

<b>№ п/п</b>	<b>Вопросы к зачету</b>
43.	Метод установления единого курса
44.	Автоматизация в биржевой деятельности. Рабочие места участников биржевой торговли
45.	Автоматизированные системы управления биржами
46.	Фьючерсная торговля и контракты. Понятие
47.	Фьючерсная торговля. История и причины возникновения
48.	Фьючерсная торговля. Цели и механизм
49.	Порядок заключения и использования фьючерсных сделок на куплю-продажу фьючерсных контрактов
50.	Хеджирование. Понятие классификация и виды. Общее с биржевой спекуляцией
51.	Техники и стратегии хеджирования. Риски и выгоды. Недостатки хеджирования
52.	Биржевая спекуляция. Функции и виды спекулянтов. Техники спекулятивных операций
53.	Ценообразование на фьючерсные контракты
54.	Финансовые расчеты во фьючерсной торговле
55.	Особенности фьючерсной торговли
56.	Биржевой опцион. Понятие и виды
57.	Сделки с немедленным сроком поставки («спот»). Особенности и риски
58.	Сделки с отсроченным сроком поставки («форвард»). Сделки с залогом, с премией, бартерные, с условием. Особенности и риски
59.	Ведущие биржи мира
60.	Российские биржи

### 7.3.2. Критерии и нормы оценки

<b>Семестр</b>	<b>Форма проведения промежуточной аттестации</b>	<b>Критерии и нормы оценки</b>	
5	Зачет (по накопительному рейтингу)	«Зачтено»	Обучающийся набрал 55 и более баллов по накопительному рейтингу
		«Не зачтено»	Обучающийся набрал 54 и менее баллов по накопительному рейтингу

Пересдача зачета в устной форме возможна в случае спорной ситуации или в случае, если студент набрал менее 55 баллов по накопительному рейтингу.

### Критерии оценки устного ответа на зачете

<b>Семестр</b>	<b>Форма проведения промежуточной аттестации</b>	<b>Критерии и нормы оценки</b>
----------------	--	--------------------------------

Семестр	Форма проведения промежуточной аттестации	Критерии и нормы оценки	
5	Зачет	«Зачтено»	<ul style="list-style-type: none"> <li>– обстоятельно раскрыто содержание зачётных вопросов, аргументированы ответы на дополнительные вопросы;</li> <li>– раскрыто содержание зачётных вопросов, не приведены примеры, не даны определения экономическим категориям;</li> <li>– не раскрыт полностью один из зачётных вопросов, есть неточности в толковании экономических категорий и законов</li> </ul>
		«Не зачтено»	<ul style="list-style-type: none"> <li>– не раскрыт ни один из зачётных вопросов</li> </ul>

### Процедура проведения зачета

Зачеты проводятся в объёме программы учебной дисциплины по заранее разработанным билетам (тестам), обсуждённым на заседании кафедры (департамента) и утверждённым заведующим кафедрой (департаментом).

Зачеты проводятся в устной или письменной форме.

Все материалы к зачету (билеты, рабочие программы курсов) должны быть оформлены в соответствии с требованиями и утверждены заведующим кафедрой (департаментом) в текущем учебном году.

При проведении устного зачета вопросы выбирает сам экзаменуемый. При подготовке к устному зачету студент ведет записи в листе устного ответа, который затем сдается преподавателю, принимающему зачет.

В процессе сдачи зачета преподавателю, принимающему зачет, предоставляется право задавать студентам дополнительные вопросы по программе дисциплины.

Во время зачета студентам предоставляется право пользоваться программой учебной дисциплины, а с разрешения преподавателя – также справочниками, таблицами, схемами и другими пособиями, перечень которых определяет преподаватель.

При проведении зачета в устной форме в билет включается два четко сформулированных вопроса (или один вопрос и задача) из различных разделов, тем программы, рассчитанных по объёму на подготовку к ответу в течение 20 минут и на ответ обучающегося в течение до 15 минут. Количество билетов должно превышать число всех обучающихся, сдающих зачет (как правило, 25-30 билетов).

Зачет принимается преподавателем, ведущим занятия в группе или читающим лекции по данной дисциплине.

## 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	Дегтярева, О. И.	Биржевое дело : учебник / О.И. Дегтярева. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Магистр : ИНФРА-М, 2024. — 528 с. - ISBN 978-5-9776-0470-3.	учебник	2024	ЭБС "ZNANIUM.COM"
2	Маскаева А.И.	Биржа и биржевое дело : учебное пособие / А.И. Маскаева, Н.Н. Туманова. — Москва : ИНФРА-М, 2025. — 118 с. — (Высшее образование). - ISBN 978-5-16-018603-0.	учебное пособие	2025	ЭБС "ZNANIUM.COM"

### 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	Куракин Р.С.	Биржевые рынки государств Европы : монография / Р.С. Куракин. — Москва : ИНФРА-М, 2023. — 549 с. — (Научная мысль). — DOI 10.12737/monography_5a0588950fe4c9.73896828. - ISBN 978-5-16-013309-6.	монография	2023	ЭБС "ZNANIUM.COM"

### 8.3. Перечень современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем

- Springer Link [Электронный ресурс] : [база данных]. – Switzerland: Springer Nature, 1842– . – Режим доступа : [link.springer.com](http://link.springer.com). – Загл. с экрана. – Яз. англ.
- Science Direct [Электронный ресурс] : коллекция электронных книг издательства Elsevier. – Netherlands: Elsevier, 2018– . – Режим доступа : [sciencedirect.com](http://sciencedirect.com). – Загл. с экрана. – Яз. англ.

### 8.4. Перечень программного обеспечения

№ п/п	Наименование ПО	Реквизиты договора (дата, номер, срок действия)
1	Windows: WinPro 10 RUS Upgrd OLP NL Acdmc	договор № 757 от 04.07.2018, срок действия – бессрочно; контракт № 1653 от 14.12.2018, срок действия – бессрочно
2	Office Standard: Office Stdandard 2013 Russian OLP NL AcademicEdition	договор № 690 от 19.05.2015, 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.	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. (УЛК-807)	Экран телевизионный, ширмы, проектор на штативе. стол преподавательский, стулья преподавательские. Транспарант-перетяжка, системный блок .
2.	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. (УЛК-810)	Экран телевизионный, ширмы, проектор на штативе. стол преподавательский, стулья преподавательские. Транспарант-перетяжка, системный блок .

№ п/п	<b>Наименование оборудованных учебных кабинетов, лабораторий, мастерских и др. объектов для проведения практических и лабораторных занятий, помещений для самостоятельной работы обучающихся (номер аудитории)</b>	<b>Перечень основного оборудования</b>
3.	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. (УЛК-411)	Столы ученические двухместные, стулья, стол преподавательский, доска аудиторная (меловая).
4.	Помещение для самостоятельной работы обучающихся (УЛК-105)	Столы, стулья, стеллажи (в т.ч. выставочные) с книгами, компьютеры, мобильные рабочие места
5.	Помещение для самостоятельной работы обучающихся (УЛК-406)	Столы компьютерные, стулья, микрокомпьютеры raspberry pi 32 bit.