

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Кудрявцев Максим Геннадьевич
Должность: Проректор по образовательной деятельности
Дата подписания: 22.11.2024 16:42:47
Уникальный программный ключ:
790a1a8df2525774421adc1fc96453f0e902bfb0

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
МИНИСТЕРСТВА СЕЛЬСКОГО ХОЗЯЙСТВА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

**«РОССИЙСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ НАРОДНОГО ХОЗЯЙСТВА
ИМЕНИ В.И. ВЕРНАДСКОГО»**

(Университет Вернадского)

Кафедра Экономики и финансов

Принято Ученым советом
Университета Вернадского
«28» марта 2024 г. протокол № 9



Рабочая программа дисциплины

Рынок ценных бумаг

Направление подготовки **38.03.01 Экономика**

Направленность (профиль) программы **Бухгалтерский учет, анализ и аудит**

Квалификация **бакалавр**

Форма обучения **очно-заочная**

Балашиха 2024г.

Рабочая программа разработана в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.03.01 Экономика

Рабочая программа дисциплины разработана доцентом кафедры Экономики и финансов Макеевой Татьяной Юрьевной

Рецензент: д.э.н., профессор кафедры Экономики и финансов РГУНХ Степаненко Е.И.

1 Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с установленными в ОПОП ВО индикаторами достижения компетенций
1.1 Перечень компетенций, формируемых учебной дисциплиной

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции
Профессиональная компетенция	
ПК-4 Способен проводить финансовый анализ, бюджетирование и управление денежными потоками	Знать: демонстрирует знания отечественного и зарубежного опыта, законодательства в сфере финансового анализа, бюджетирования и управление денежными потоками
	Уметь: умеет осуществлять планирование программ и сроков проведения финансового анализа экономического субъекта, формирует аналитические отчеты и предоставляет их заинтересованным пользователям.
	Владеть: владеет организацией работы по финансовому анализу экономического субъекта; планированием работ по анализу финансового состояния экономического субъекта; организацией бюджетирования и управления денежными потоками в экономическом субъекте.

2. Цели и задачи освоения учебной дисциплины, место дисциплины в структуре ОПОП ВО

Дисциплина Б1.В.01.06 «Рынок ценных бумаг» относится к дисциплинам, формируемым участниками образовательных отношений основной профессиональной образовательной программы высшего образования 38.03.01 Экономика, профиль «Бухгалтерский учет, анализ и аудит». Соответствует требованиям ФГОС.

Цель: подготовка студентов к эффективному использованию теоретических знаний и практических навыков в области рынка ценных бумаг. Дисциплина синтезирует полученные ранее знания и навыки для использования в профессиональной деятельности бухгалтера и аудитора.

Задачи:

- овладеть базовыми понятиями в системе основных категорий рынка ценных бумаг
- выяснить экономическую сущность ценных бумаг, рассмотреть особенности конкретных видов ценных бумаг, условия их выпуска и обращения, возможности использования в хозяйственной практике экономических субъектов;
- рассмотреть структуру рынка ценных бумаг, виды его участников (профессиональных участников, эмитентов, инвесторов), их взаимодействие;
- охарактеризовать операции различных категорий участников с ценными бумагами;
- развить навыки нахождения организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности и готовности нести за них ответственность;
- дать представление об основах инвестирования в ценные бумаги, о методах инвестиционного анализа и оценки финансовых рисков, связанных с ценными бумагами.

3. Объем учебной дисциплины в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий, текущий и промежуточный контроль по дисциплине) и на самостоятельную работу обучающихся

Вид учебной работы	4 курс/8семестр
Общая трудоемкость дисциплины, зачетных единиц	
часов	144
Аудиторная (контактная) работа, часов	24,3

в т.ч. занятия лекционного типа	8
занятия семинарского типа	16
промежуточная аттестация	0,3
Самостоятельная работа обучающихся, часов	110,7
в т.ч. контрольная работа	24,3
Контроль	9
Вид промежуточной аттестации	экзамен

4. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий

4.1 Перечень разделов дисциплины с указанием трудоемкости аудиторной (контактной) и самостоятельной работы, видов контролей и перечня компетенций

Наименование разделов и тем	Трудоемкость, часов			Наименование оценочного средства	Код ИДК
	всего	в том числе			
		аудиторной (контактной) работы	самостоятельной работы		
Раздел 1. Концептуальные основы рынка ценных бумаг	50	8	40	Практическое задание, доклад	ПК-4
1.1. Сущность и функции и регулирование рынка ценных бумаг.	20	4	10		
1.2. Классификация рынка ценных бумаг.	15	2	15		
1.3. Участники рынка ценных бумаг.	15	2	15		
Раздел 2. Основные виды ценных бумаг и их характеристика	50	8	40	Практическое задание, доклад	ПК-4
2.1. Общая характеристика ценных бумаг, виды сделок с ценными бумагами	20	4	10		
2.2. Основные ценные бумаги	15	5	15		
2.3. Производные ценные бумаги	15	5	15		
Раздел 3. Особенности функционирования рынка ценных бумаг	43,7	8	30,7	Практическое задание, доклад	ПК-4
3.1. Основные этапы эмиссии ценных бумаг.	23	4	15		
3.2. Особенности биржевой и внебиржевой торговли ценными бумагами. Коммерческие банки на рынке ценных бумаг.	20,7	4	15,7		
Итого за семестр	143,7	24	110,7		
Промежуточная аттестация	0,3	0,3	9	Итоговое тестирование	
ИТОГО по дисциплине	144	24,3	119,7		

4.2 Содержание дисциплины по разделам и темам

Раздел 1. Концептуальные основы рынка ценных бумаг

Цель: формирование теоретических знаний и практических навыков у обучающихся о рынке ценных бумаг.

Задачи:

- усвоение базовых понятиями в системе основных категорий рынка ценных бумаг
- усвоение основ функционирования современного рынка ценных бумаг, знание истории возникновения, сущности, нормативно-правового регулирования и т.д.
- усвоение основных функций участников рынка ценных бумаг (профессиональных участников, эмитентов, инвесторов), их взаимодействие;

Перечень учебных элементов раздела:

1.1. Сущность и функции и регулирование рынка ценных бумаг.

Понятие рынка ценных бумаг и его структура, классификация. Функции и составные части рынка ценных бумаг. Основы регулирования рынка ценных бумаг.

1.2. Классификация рынка ценных бумаг.

Виды рынка ценных бумаг. Место рынка ценных бумаг в структуре финансового рынка.

1.3. Участники рынка ценных бумаг.

Общая характеристика участников. Эмитенты и инвесторы на рынке ценных бумаг. Участники биржевого и внебиржевого сегментов рынка ценных бумаг. Финансовые посредники (фондовые брокеры и дилеры). Организации, осуществляющие функционирование рынка ценных бумаг. Организации, обслуживающие рынок ценных бумаг.

Раздел 2.

Основные виды ценных бумаг и их характеристика

Цель: формирование теоретических знаний и практических навыков у обучающихся видах ценных бумаг и их оценке.

Задачи:

- изучение экономической сущности ценных бумаг и их особенностей, условия их выпуска и обращения, возможности использования в хозяйственной практике экономических субъектов;
- приобрести способность анализировать и оценивать основные ценные бумаги.
- приобрести способность анализировать и оценивать производные ценные бумаги.

Перечень учебных элементов раздела:

2.1. Общая характеристика ценных бумаг, виды сделок с ценными бумагами

Сущность и понятие ценных бумаг. История появления ценных бумаг. Классификации ценных бумаг. Виды сделок с ценными бумагами.

2.2. Основные ценные бумаги

Понятие и типы основных ценных бумаг. Общая характеристика акций, их стоимостная оценка акций, доходность акций. Облигация, виды облигаций. Стоимостная оценка облигации. Виды векселей и их оценка.

2.3. Производные ценные бумаги

Понятие и типы производных ценных бумаг. Фьючерсный контракт. Виды опционов. Основные преимущества опционов. Торговля фьючерсными контрактами и биржевыми опционами. Хеджирование на фьючерсном и опционном рынках.

Раздел 3. Особенности функционирования рынка ценных бумаг

Цель: формирование теоретических знаний и практических навыков у обучающихся об особенностях функционирования рынка ценных бумаг: эмиссии, биржевой и внебиржевой торговле, роли коммерческих банков на данном рынке.

Задачи:

— охарактеризовать операции различных категорий участников с ценными бумагами;

— дать представление об основах инвестирования в ценные бумаги, о методах инвестиционного анализа и оценки финансовых рисков, связанных с ценными бумагами.

Перечень учебных элементов раздела:

3.1. Основные этапы эмиссии ценных бумаг.

Эмиссия ценных бумаг, публичное размещение акций. Цели выпуска ценных бумаг. Механизм реализации выпуска ценных бумаг. Методы размещения ценных бумаг. Андеррайтинг.

3.2 Особенности биржевой и внебиржевой торговли ценными бумагами. Коммерческие банки на рынке ценных бумаг

Организация торгов на фондовой бирже. Виды и функции внебиржевых организаций. Состав операций коммерческих банков с ценными бумагами. Выпуск ценных бумаг коммерческими банками. Инвестиции банков в ценные бумаги. Доверительные операции коммерческих банков.

5. Оценочные материалы по дисциплине

Оценочные материалы по дисциплине представлены в виде фонда оценочных средств.

6. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

6.1 Перечень учебно-методического обеспечения по дисциплине

№ п/п	Автор, название, место издания, издательство, год издания, количество страниц, режим доступа
1	Методические указания по изучению дисциплины

6.2 Перечень учебных изданий, необходимых для освоения дисциплины *

Печатные учебные издания в библиотечном фонде

№ п/п	Автор, название, место издания, издательство, год издания, количество страниц	Количество экземпляров в библиотеке
1	Чалдаева Л.А. Рынок ценных бумаг: учеб. для вузов/ Л.А. Чалдаева, А.А. Килячков.-3-е изд., перераб. и доп. –М.: Юрайт, 2018.-857с.	15
2	Финансы и кредит: учебник для бакалавров / под ред. М.В. Романовского, Г.Н. Белоглазовой. – М.: Юрайт, 2012. – 609 с.	10

Электронные учебные издания в электронно-библиотечных системах (ЭБС)

№ п/п	Автор, название, место издания, год издания, количество страниц	Ссылка на учебное издание в ЭБС
Основная литература		

1	Рынок ценных бумаг : учебник / [В. А. Татьянников, Е. А. Разумовская, Т. В. Решетникова, Ю. В. Куваева, М. И. Львова] ; под общ. ред. В. А. Татьянникова ; М-во науки и высшего обр. Рос. Федерации, Урал. гос. экон. ун-т. – Екатеринбург : Изд-во Урал. ун-та, 2019. – 496 с.	https://fdok.usue.ru/images/logos/%D0%A0%D1%8B%D0%BD%D0%BE%D0%BA%20%D1%86%D0%B5%D0%BD%D0%BD%D1%8B%D1%85%20%D0%B1%D1%83%D0%BC%D0%B0%D0%B3_compressed.pdf
2	Рынок ценных бумаг:учебник / автор С.Ф. Федулова – Ижевск: Изд. центр «Удмуртский университет», 2020. – 212 с.	http://elibrary.udsu.ru/xmlui/bitstream/handle/123456789/19539/469/%D0%BB%D0%B1_1000984220_28.10.2020.pdf?sequence=1
Дополнительная литература		
1	Финансовые рынки и институты : учебник / Е.Г. Князева, Е.А. Разумовская, Н.Н. Мокеева, М.И. Львова, О.А. Школик, Ю.В. Истомина ; под общей редакцией О.А. Школика ; Министерство науки и высшего образования Российской Федерации, Уральский федеральный университет.— Екатеринбург : Изд-во Урал. ун-та, 2021.— 312 с. : ил.— (Учебник УрФУ).	https://elar.urfu.ru/bitstream/10995/105470/1/978-5-7996-3296-0_2021.pdf
2	Довбий, И.П. Финансовые рынки и финансовые институты: учебное пособие. – Челябинск: Издательский центр ЮУрГУ, 2019. – 138 с.	https://hsem.susu.ru/es/wp-content/uploads/sites/29/2022/05/DIP_tutorial_FinInstit.pdf

6.3 Перечень электронных образовательных ресурсов

№ п/п	Электронный образовательный ресурс	Доступ в ЭОР (сеть Интернет, локальная сеть, авторизованный/свободный доступ
1	Научная электронная библиотека	http://elibrary.ru .
2	Сайт ЦБ РФ	http://www.cbr.ru
3	Справочно-правовая система «Гарант»	http://www.base.garant.ru

6.4 Современные профессиональные базы данных, информационные справочные системы и лицензионное программное обеспечение

Современные профессиональные базы данных, информационные справочные системы, цифровые электронные библиотеки и другие электронные образовательные ресурсы

1. Договор о подключении к Национальной электронной библиотеке и предоставлении доступа к объектам Национальной электронной библиотеки №101/НЭБ/0502-п от 26.02.2020 5 лет с пролонгацией

2. Соглашение о бесплатном тестовом доступе к Polpred.com. Обзор СМИ 27.04.2016 бессрочно

3. Соглашение о бесплатном тестовом доступе к Polpred.com. Обзор СМИ 02.03.2020 бессрочно

4. Информационно-справочная система «Гарант» – URL: <https://www.garant.ru/>
Информационно-справочная система Лицензионный договор № 261709/ОП-2 от 25.06.2021

5. «Консультант Плюс». – URL: <http://www.consultant.ru/> свободный доступ

6. Электронно-библиотечная система AgriLib <http://ebs.rgazu.ru/> (свидетельство о государственной регистрации базы данных №2014620472 от 21.03.2014).

7. Федеральная служба государственной статистики. – URL: <https://rosstat.gov.ru/> -.

8. Научная электронная библиотека открытого доступа (Open Access).– URL:<https://cyberleninka.ru/>.
9. полнотекстовая коллекция (база данных) электронных книг издательства Springer Nature.<http://link.springer.com/> -
10. Федеральный центр информационно-образовательных ресурсов.– URL:<http://fcior.edu.ru/>.
11. Информационная система «Единое окно доступа к образовательным ресурсам».–URL:<http://window.edu.ru/>.

Доступ к электронной информационно-образовательной среде, информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

1. Система дистанционного обучения Moodle www.portfolio.rgazu.ru (свободно распространяемое)
2. Право использования программ для ЭВМ Mirapolis HCM в составе функциональных блоков и модулей: Виртуальная комната. Стандартная лицензия до 1000 пользователей на 1 месяц (Лицензионный договор № 77/03/22 – К от 25 апреля 2022)
3. Инновационная система тестирования – программное обеспечение на платформе 1С (Договор № К/06/03 от 13.06.2017)
4. Образовательный интернет – портал Российского государственного аграрного заочного университета (свидетельство о регистрации средства массовой информации Эл № ФС77-51402 от 19.10.2012).

Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение

1. OpenOffice – свободный пакет офисных приложений (свободно распространяемое)
2. linuxmint.com [https://linuxmint.com/](https://linuxmint.com) (свободно распространяемое).
3. Электронно-библиотечная система AgriLib <http://ebs.rgazu.ru/> (свидетельство о государственной регистрации базы данных №2014620472 от 21.03.2014).
4. Официальная страница ФГБОУ ВО «Российский государственный аграрный заочный университет» <https://vk.com/rgazuru> (свободно распространяемое)ю
5. Портал Федерального государственного бюджетного образовательного учреждения высшего образования «Российский государственный аграрный заочный университет» (свободно распространяемое) <https://zen.yandex.ru/id/5fd0b44cc8ed19418871dc31>.
6. Антивирусное программное обеспечение Dr. WEB Desktop Security Suite (Сублицензионный договор №13740 на передачу неисключительных прав на программы для ЭВМ от 01.07.2021).

6.5 Перечень учебных аудиторий, оборудования и технических средств обучения**

Предназначение помещения (аудитории)	Наименование корпуса, № помещения (аудитории)	Перечень оборудования (в т.ч. виртуальные аналоги) и технических средств обучения*
<i>Для занятий лекционного типа</i>	Учебно-административный корпус № 342	Специализированная мебель, доска маркерная, экран напольный
	Учебно-административный корпус № 129	Специализированная мебель, доска меловая, мультимедийное оборудование, проектор, экран настенный
<i>Для занятий семинарского типа, групповых</i>	Учебно-административный корпус № 342	Специализированная мебель, доска маркерная, экран напольный

<i>консультаций, промежуточной аттестации</i>	Учебно- административный корпус № 129	Специализированная мебель, доска меловая, мультимедийное оборудование, проектор, экран настенный
<i>Для самостоятельно й работы</i>	Учебный лабораторный корпус № 320	Специализированная мебель, персональные компьютеры в сборке с выходом в интернет.
	Учебно- административный корпус. Каб. 105. Учебная аудитория для учебных занятий обучающихся из числа инвалидов и лиц с ОВЗ.	Специализированная мебель, доска меловая, редуктор червячный, редуктор конический, лабораторное оборудование СМ-12М, лабораторное оборудование СМ-16, лабораторное оборудование СМ-18, лабораторное оборудование СМ-21, испытательная машина, установки для исследования СМ-44, машина на кручение КМ-50, машина разрывная, копер маятниковый

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
МИНИСТЕРСТВА СЕЛЬСКОГО ХОЗЯЙСТВА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
**«РОССИЙСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ НАРОДНОГО ХОЗЯЙСТВА
ИМЕНИ В.И. ВЕРНАДСКОГО»**
(Университет Вернадского)

**Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля и промежуточной
аттестации обучающихся по дисциплине
«Рынок ценных бумаг»**

Направление подготовки 38.03.01 **Экономика**

Направленность (профиль) программы **Бухгалтерский учет, анализ и аудит**

Квалификация **бакалавр**

Форма обучения **очно-заочная**

Балашиха 2024г.

1 Описание показателей и критериев оценивания планируемых результатов обучения по учебной дисциплине

Код и наименование компетенции	Уровень освоения	Планируемые результаты обучения	Наименование оценочного средства
ПК-4 Способен проводить финансовый анализ, бюджетирование и управление денежными потоками	Пороговый (удовлетворительно)	<p>Знает: отечественный и зарубежный опыта, законодательства в сфере финансового анализа, бюджетирования и управление денежными потоками</p> <p>Умеет: осуществлять планирование программ и сроков проведения финансового анализа экономического субъекта, формирует аналитические отчеты и предоставляет их заинтересованным пользователям.</p> <p>Владеет: организацией работы по финансовому анализу экономического субъекта; планированием работ по анализу финансового состояния экономического субъекта; организацией бюджетирования и управления денежными потоками в экономическом субъекте.</p>	Практические задания, доклад
	Продвинутый (хорошо)	<p>Знает твердо: отечественный и зарубежный опыта, законодательства в сфере финансового анализа, бюджетирования и управление денежными потоками.</p> <p>Умеет уверенно: осуществлять планирование программ и сроков проведения финансового анализа экономического субъекта, формирует аналитические отчеты и предоставляет их заинтересованным пользователям.</p> <p>Владеет уверенно: организацией работы по финансовому анализу экономического субъекта; планированием работ по анализу финансового состояния экономического субъекта; организацией бюджетирования и управления денежными потоками в экономическом субъекте.</p>	
	Высокий (отлично)	<p>Имеет сформировавшееся систематические знания: отечественный и зарубежный опыта, законодательства в сфере финансового анализа, бюджетирования и управление денежными потоками</p> <p>Имеет сформировавшееся систематическое умение: осуществлять планирование программ и сроков проведения финансового анализа экономического субъекта, формирует аналитические отчеты и предоставляет их заинтересованным пользователям.</p> <p>Показал сформировавшееся систематическое владение: организацией работы по финансовому анализу экономического субъекта; планированием работ по анализу финансового состояния экономического субъекта; организацией бюджетирования и управления денежными потоками в экономическом субъекте.</p>	

2 Описание шкал оценивания

2.1 Шкала оценивания на этапе текущего контроля

Форма текущего контроля	Отсутствие усвоения (ниже порогового)*	Пороговый (удовлетворительно)	Продвинутый (хорошо)	Высокий (отлично)
Выполнение	не выполнено или	Решено более 50%	Решено более 70%	все задания

практического задания	все задания решены неправильно	задания, но менее 70%	задания, но есть ошибки	решены без ошибок
Доклад	Менее 51%	51-79%	80-90%	91% и более

* Студенты, показавшие уровень усвоения ниже порогового, не допускаются к промежуточной аттестации по дисциплине.

2.2 Шкала оценивания на этапе промежуточной аттестации (зачет и экзамен в виде итогового теста, курсовая работа)

Форма промежуточной аттестации	Отсутствие усвоения (ниже порогового)	Пороговый (удовлетворительно)	Продвинутый (хорошо)	Высокий (отлично)
Выполнение итоговых тестов (не менее 15 вопросов на вариант)	Менее 51%	51-79%	80-90%	91% и более

3. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ

КОМПЛЕКТ ЗАДАЧ ДЛЯ ПРАКТИЧЕСКИХ ЗАДАНИЙ по дисциплине

Раздел 1. Концептуальные основы рынка ценных бумаг

1. Объем производства увеличился на 6%, скорость оборота денег снизилась на 5%, средний уровень цен вырос на 9%. Как изменился объем денежной массы?
2. Объем производства увеличился на 6%, денежная масса - на 24, скорость оборота денег осталась прежней. Как изменился средний уровень цен?
3. Банковский мультипликатор равен 25, максимально возможное количество денег, которое может создать банковская система – 75 млн. руб. Определить норму обязательных резервов и сумму первоначального депозита. Какой будет рыночная стоимость акции номиналом 10 у.е. при ставке банковского процента 20% годовых и объявленных дивидендах 10% годовых.
4. Определить индекс и уровень инфляции за квартал, если уровень инфляции в январе составил 0,5%, в феврале - 1,5%, в марте - 2%.
5. Период начисления 3 месяца, ожидаемый ежемесячный уровень инфляции 2%. Под какую простую ставку нужно положить начальную сумму, чтобы обеспечить реальную доходность сделки 5%.

ТЕМЫ ДОКЛАДОВ по дисциплине

Раздел 1 Концептуальные основы рынка ценных бумаг

1. Проблемы и перспективы развитие фондового рынка в России.
2. Финансовые риски, их оценка и методы страхования рисков.
3. Проблемы и перспективы развитие фондового рынка в России.
4. Финансовые риски, их оценка и методы страхования рисков.
5. Критерии выбора типа облигаций для их размещения.

КОМПЛЕКТ ЗАДАЧ ДЛЯ ПРАКТИЧЕСКИХ ЗАДАНИЙ по дисциплине

Раздел 2. Основные виды ценных бумаг и их характеристика

1. Вексель, имеющий номинальную стоимость 4 млн. руб., учтен в банке по ставке 15,5% годовых за 156 дней до его погашения. Определить сумму полученную владельцем векселя при учете.
2. Вексель номинальной стоимостью 120 тыс. руб. учтен банком за полгода до даты погашения. Банк выплатил сумму 115 тыс. руб. Определить простую учетную ставку.
3. Определите доходность операции учета векселя банком, если известно что вексель номиналом 5000 у.е. учтен банком за 90 дней до погашения с дисконтом 100 у.е. через 60 дней вексель был реализован банком по ставке 6,8%
4. При учете векселя на сумму 100 тыс. руб., выданного на срок 270 дней, его владельцу была выплачена сумма 98027 руб., когда до срока погашения осталось 80 дней. Определите учетную ставку банка при покупке векселя (временная база $D_{год}=365$ дней).
5. Вексель выдан на сумму 750 тыс. руб. с уплатой 20 июня 2013 года. Владелец векселя учитывает его в банке 18 апреля. Определить сумму полученную владельцем векселя при учете, если учетная ставка равна 8%

ТЕМЫ ДОКЛАДОВ по дисциплине

Раздел 2. Основные виды ценных бумаг и их характеристика

1. Модели ценообразования акций и возможности их применения в России.

2. Депозитарные расписки. Опыт и проблемы выпуска депозитарных расписок российскими предприятиями.
3. Развитие налогообложения в РФ
4. Современная финансовая политика зарубежных стран.
5. Развитие налогообложения в мире

КОМПЛЕКТ ЗАДАЧ ДЛЯ ПРАКТИЧЕСКИХ ЗАДАНИЙ по дисциплине

Раздел 3. Особенности функционирования рынка ценных бумаг

1. Сумма в 5 млн. выплачивается через 5 лет. Какова ее современная величина при условии, что применяются простые проценты 12% годовых.
2. За какой срок сумма равная 90 млн. руб. достигнет 300 млн. руб. при начислении 16% годовых по простой ставке ежегодно.
3. Определить простую ставку процентов, при которой первоначальный капитал в размере 20000 руб. достигнет через 180 дней 25000 руб.
4. Вклад в размере 30000 руб. помещен на депозит 10 марта под 12% годовых по схеме точных процентов, начисляемых по английской методике. Какую сумму вкладчик получит 20 ноября того же года.
5. Вклад в размере 25000 руб. помещен на депозит 15 марта под 10% годовых по схеме точных процентов, начисляемых по немецкой методике. Какую сумму вкладчик получит 10 ноября того же года.

ТЕМЫ ДОКЛАДОВ по дисциплине

Раздел 3. Особенности функционирования рынка ценных бумаг

1. Модели финансового посредничества.
2. Модель коалиции владельцев информации.
3. Российские эмитенты на рынке еврооблигаций
4. Рынок Форекс
5. Развитие банковского дела в России

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

КОМПЛЕКТ ТЕСТОВ для промежуточной аттестации (экзамен)

по дисциплине

Экзамен проводится в виде итогового теста. Для выполнения теста отводится 60 минут.

Примерные задания итогового теста

1. Определенным образом подобранная совокупность отдельных видов ценных бумаг для достижения поставленной цели – это:

- а) сертификат ценных бумаг;
- б) портфель ценных бумаг;
- в) варрант ценных бумаг.

2. Если портфель не полностью соответствует инвестиционной стратегии предприятия, его называют:

- а) негармоничным
- б) сбалансированным
- в) несбалансированным

3. Укажите какая функция денежной единицы используется в задаче: определить какая стартовая цена оплаченная сегодня позволит накопить сумму в 10000 у.е. через 3 года при ставке 10%:

- а) функция текущей стоимости денежной единицы
- б) функция будущей стоимости денежной единицы

в) функция будущей стоимости аннуитета

4. Как называется портфель, который формируется из наиболее рискованных, но и самых доходных ценных бумаг?

- а) агрессивный;
- б) прогрессивный;
- в) бессистемный.

5. Устойчивое движение цен в одном направлении, которые сохраняются независимо от случайных колебаний, возникающих по тем или иным особым причинам, – это:

- а) сплит;
- б) спред;
- в) тренд.

6. Укажите какая функция денежной единицы используется в задаче: ежеквартальные платежи по кредиту составляют 450 у.е. поступают на счет в банке, ставка 12%; определить сумму выплат к концу 10 года:

- а) функция взнос на амортизацию денежной единицы
- б) функция будущей стоимости аннуитета
- в) функция формирования фонда возмещения

7. Укажите какая функция денежной единицы используется в задаче: ежемесячная сумма аренды 300 у.е. в течении 3 лет поступает на счет; определить текущую стоимость всей суммы за 3 года, если ставка составляет 15%:

- а) функция взнос на амортизацию денежной единицы
- б) функция текущей стоимости денежной единицы
- в) функция текущей стоимости аннуитета

8. Процесс создания определенной структуры портфеля, т. е. составление комбинации различных видов ценных бумаг с определенной целью, – это:

- а) диверсификация портфеля;
- б) формирование портфеля;
- в) ценообразование.

9. Укажите какая функция денежной единицы используется в задаче: определить сумму на депозитном счете в конце 5 года, если ежегодно на него перечисляется 250 у.е, при ставке 11%:

- а) функция будущей стоимости денежной единицы
- б) функция будущей стоимости аннуитета
- в) функция формирования фонда возмещения

10. Укажите какая функция денежной единицы используется в задаче: определить какую сумму ежегодно требуется переводить на счет в банк, чтобы к концу 7 года, получить 15000 у.е. при ставке 11% :

- а) функция взнос на амортизацию денежной единицы
- б) функция будущей стоимости денежной единицы
- в) функция формирования фонда возмещения

11. Портфель ценных бумаг – это:

- а) документ, закрепляющий право ее владельца на покупку в предусмотренный в ней срок определенного количества ценных бумаг, котируемых на бирже по цене, определенной в опционе эмитента;
- б) документ, удостоверяющий право эмитента на выкуп в предусмотренный в ней срок и/или при наступлении указанных в ней обстоятельств определенного количества своих акций у владельцев этих акций в количестве и по цене, определенной в проспекте эмиссии;

в) определенным образом подобранная совокупность отдельных видов ценных бумаг для достижения поставленной цели.

12. Укажите какая функция денежной единицы используется в задаче: определить размер выплат по кредиту, взятому в размере 3000 у.е., при ежегодном погашении равными долями; кредит взят на 4 года, при ставке 11%:

а) функция внос на амортизацию денежной единицы

б) функция текущей стоимости аннуитета

в) функция формирования фонда возмещения

13. Комплексный портфель состоит из ценных бумаг, выпущенных:

а) предприятиями одной отрасли;

б) частными лицами и предприятиями одной отрасли;

в) предприятиями различных отраслей.

14. Группа портфелей дохода не включает следующие виды портфелей: егулярного дохода;

б) доходных бумаг;

в) агрессивного роста.

15. Риск, который несет инвестор при ошибочной оценке инвестиционных качеств ценной бумаги, называется:

а) капитальный;

б) селективный;

в) временной.