

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
ФГБОУ ВО «БАЙКАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

УТВЕРЖДАЮ

Проректор по учебной работе
к.э.н., доцент Измestьев А.А



17.06.2019г.

Рабочая программа дисциплины
Б1.В.9. Ценные бумаги

Направление подготовки: 38.03.01 Экономика
Направленность (профиль): Финансы и кредит, бухгалтерский учет и
налогообложение
Квалификация выпускника: бакалавр
Форма обучения: очная, заочная

	Очная ФО	Заочная ФО
Курс	3	3
Семестр	31	31
Лекции (час)	28	6
Практические (сем, лаб.) занятия (час)	28	10
Самостоятельная работа, включая подготовку к экзаменам и зачетам (час)	88	128
Курсовая работа (час)		
Всего часов	144	144
Зачет (семестр)	31	31
Экзамен (семестр)		

Иркутск 2019

Программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению 38.03.01 Экономика.

Авторы А.А. Тимофеева, Дубовик И. В.

Рабочая программа обсуждена и утверждена на заседании кафедры финансов и финансовых институтов

Заведующий кафедрой Т.В. Щукина

Дата актуализации рабочей программы: 30.06.2020

Дата актуализации рабочей программы: 30.06.2021

1. Цели изучения дисциплины

Целью освоения дисциплины «Ценные бумаги» является формирование знаний о сущности и видах ценных бумаг и финансовых инструментах на рынке ценных бумаг; формирование умений давать характеристику ценным бумагам с позиций эмитентов и инвесторов как объектам привлечения капитала и инвестиций; применение знаний и умений для анализа динамики рынков отдельных видов ценных бумаг в целях совершения операций на рынке ценных бумаг.

2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины

Код компетенции по ФГОС ВО	Компетенция
ПК-6	способность анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей
ПК-7	способность, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные, проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет

Структура компетенции

Компетенция	Формируемые ЗУНы
ПК-6 способность анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей	З. Знать основные методы анализа данных отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях У. Уметь выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей Н. Владеть навыком интерпретации данных отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях
ПК-7 способность, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные, проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет	З. Знать основные принципы построения информационных обзоров и/или аналитических отчетов У. Уметь подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет по результатам проведенного анализа собранных данных Н. Владеть навыком сбора информации с использованием отечественных и зарубежных источников

3. Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Принадлежность дисциплины - БЛОК 1 ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛИ): Вариативная часть.

Предшествующие дисциплины (освоение которых необходимо для успешного освоения данной): "Макроэкономика", "Финансы", "Деньги, кредит, банки"

4. Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся

Общая трудоемкость дисциплины составляет 4 зач. ед., 144 часов.

Вид учебной работы	Количество часов (очная ФО)	Количество часов (заочная ФО)
Контактная(аудиторная) работа		
Лекции	28	6
Практические (сем, лаб.) занятия	28	10
Самостоятельная работа, включая подготовку к экзаменам и зачетам	88	128
Всего часов	144	144

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

5.1. Содержание разделов дисциплины

Заочная форма обучения

№ п/п	Раздел и тема дисциплины	Семестр	Лекции	Семинар Лаборат. Практич.	Самостоят. раб.	В интерактивной форме	Формы текущего контроля успеваемости
1	Ценные бумаги: понятие, виды, классификация	31	1	1	22		Коллоквиум 1
2	Облигации	31	1	2	20		Контрольная работа 1. Доклад 1
3	Векселя	31	1	2	22		Коллоквиум 2. Доклад 2
4	Депозитные и сберегательные сертификаты, чеки и иные виды долговых ценных бумаг	31	1	2	22		Коллоквиум 3. Контрольная работа 2
5	Акции и ценные бумаги на их основе	31	1	2	20		Коллоквиум 4. Контрольная работа 3. Доклад 4
6	Инвестиционные паи. Ипотечные сертификаты участия. Клиринговые сертификаты участия.	31	1	1	22		Доклад 3
	ИТОГО		6	10	128		

Очная форма обучения

№ п/п	Раздел и тема дисциплины	Семестр	Лекции	Семинар Лаборат. Практич.	Самостоят. раб.	В интерактивной форме	Формы текущего контроля успеваемости
-------	--------------------------	---------	--------	---------------------------------	--------------------	--------------------------	--------------------------------------

№ п/п	Раздел и тема дисциплины	Семестр	Лекции	Семинар Лаборат. Практич.	Самостоят. раб.	В интерактивной форме	Формы текущего контроля успеваемости
1	Ценные бумаги: понятие, виды, классификация	31	4	4	12		Коллоквиум 1
2	Облигации	31	8	8	20		Контрольная работа 1. Доклад 1
3	Векселя	31	4	4	12		Коллоквиум 2. Доклад 2
4	Депозитные и сберегательные сертификаты, чеки и иные виды долговых ценных бумаг	31	4	4	12		Коллоквиум 3. Контрольная работа 2
5	Акции и ценные бумаги на их основе	31	6	6	20		Коллоквиум 4. Контрольная работа 3. Доклад 4
6	Инвестиционные паи. Ипотечные сертификаты участия. Клиринговые сертификаты участия.	31	2	2	12		Доклад 3
	ИТОГО		28	28	88		

5.2. Лекционные занятия, их содержание

№ п/п	Наименование разделов и тем	Содержание
1	Ценные бумаги: понятие, виды, классификация	Понятие ценной бумаги. Свойства ценной бумаги. Виды ценных бумаг. Классификации ценных бумаг: по соответствию признакам эмиссионных ценных бумаг; свидетельством какого капитала являются; виду удостоверяемых прав; представителями (титулами) какого рынка являются; эмитентам; сроку действия;
2	Ценные бумаги: понятие, виды, классификация	Классификации ценных бумаг: по способу фиксации права на ценную бумагу и передачи ценной бумаги; форме; виду дохода. Форма удостоверения прав, закрепленной ценной бумагой.
3	Облигации	Определение облигации. Отличительные признаки облигаций. Классификация облигаций по эмитентам, сроку действия, форме, способу фиксации и передачи удостоверяемых прав, виду дохода, наличию права изменить срок действия облигации, наличию обеспечения, наличию права обмена на акции, уровню риска, способу погашения. Основные характеристики облигаций: номинальная стоимость, рыночная цена, курс, купонный процент, текущий доход, текущая и конечная доходность, эффективная текущая и эффективная конечная доходность. Факторы, влияющие на динамику цен и доходности облигации. Измерение чувствительности цен облигаций.
4	Облигации	Государственные (муниципальные) ценные бумаги: понятие,

№ п/п	Наименование разделов и тем	Содержание
		цели выпуска, функции. Облигации федеральных займов (ОФЗ): основные характеристики; виды; участники рынка; размещение, обращение, погашение.
5	Облигации	Государственные сберегательные облигации (ГСО): основные характеристики; обслуживание рынка; размещение, выкуп и обмен.
6	Облигации	Еврооблигации: понятие, отличительные признаки, место среди инструментов международного рынка ценных бумаг; участники рынка; особенности регулирования рынка. Еврооблигационные займы от имени Российской Федерации, субъектов Российской Федерации и российских корпоративных эмитентов. Облигации внешних облигационных займов Российской Федерации (ОВОЗ РФ). ОВОЗ РФ, выпущенные в процессе реструктуризации задолженности бывшего СССР перед Лондонским клубом кредиторов; ОВОЗ РФ с датами выпуска в 2010-2013 гг., 2015 г., 2016 г.: характеристики, участники рынка, размещение и обращение.
7	Векселя	Правовые основы выпуска и обращения векселей в Российской Федерации. Определение векселя. Свойства и виды векселей. Схемы обращения простого и переводного векселей. Требования к составлению векселя. Акцепт векселя. Платеж векселя и протест векселя в неплатеже. Передача векселя через индоссамент. Виды индоссаментов. Аваль. Расчет доходности векселей.
8	Векселя	Кредитные операции с векселями. Вексельные кредиты в форме учета векселей, специального ссудного счета под векселя. Выдача банком ссуды под залог векселей. Комиссионные операции банка с векселями. Инкассирование, домициляция векселей. Переучет векселей Центральным банком РФ.
9	Депозитные и сберегательные сертификаты, чеки и иные виды долговых ценных бумаг	Депозитный и сберегательный сертификаты: понятие, характеристики, виды, удостоверяемые права, оформление цессии, порядок выпуска. Значение и объемы выпуска депозитных и сберегательных сертификатов российскими коммерческими банками. Чек: понятие, виды, реквизиты. Передача прав по чеку. Назначение чека.
10	Депозитные и сберегательные сертификаты, чеки и иные виды долговых ценных бумаг	Закладная: правовые основы выпуска и обращения, определение, вид договора как основание для выпуска закладной, основные характеристики, порядок выпуска, обращение. Двойное и простое складские свидетельства: правовые основы выпуска и обращения, определение, виды, основные характеристики, реквизиты, порядок выпуска, участники и сфера обращения, погашение. Коносамент: определение, основные характеристики, реквизиты, порядок выпуска, обращение, цена.
11	Акции и ценные	Понятие акции. Классификация акций. Категории (типы)

№ п/п	Наименование разделов и тем	Содержание
	бумаги на их основе	акций. Права акционеров - держателей обыкновенных и привилегированных акций. Право на получение дивиденда: понятие дивиденда, порядок установления размера и выплаты дивидендов по категориям акций, ограничения на выплату дивидендов. Право на участие в управлении акционерным обществом. Возникновение права голоса по привилегированным акциям. Право на имущество общества при его ликвидации: способы ликвидации акционерного общества, порядок ликвидации общества на добровольной основе, очередность удовлетворения требований акционеров при ликвидации.
12	Акции и ценные бумаги на их основе	Право требования на выкуп обществом принадлежащих акционеру акций. Виды стоимостной оценки акции. Доходность акции. Право на информацию об акционерном обществе. Преимущественное право на приобретение размещаемых дополнительных акций. Право свободного распоряжения акциями. Типы привилегированных акций.
13	Акции и ценные бумаги на их основе	Опцион эмитента: определение, основные характеристики, ограничения на выпуск. Фондовый варрант как зарубежный аналог опциона эмитента. Российская депозитарная расписка: определение, основные характеристики, закрепляемые права, особенности эмиссии и обращения. Американские депозитарные расписки (АДР): понятие, причины и порядок выпуска. Виды и уровни АДР: сущность и отличительные признаки. Обращение АДР. Глобальные депозитарные расписки (ГДР).
14	Инвестиционные паи. Ипотечные сертификаты участия. Клиринговые сертификаты участия.	Инвестиционный пай: правовые основы выпуска; понятие, удостоверяемые права; основные характеристики; порядок выпуска; обращение. Расчетная цена инвестиционного пая.
14	Инвестиционные паи. Ипотечные сертификаты участия. Клиринговые сертификаты участия.	Ипотечный сертификат участия: правовые основы выпуска; определение; основные характеристики; порядок выпуска, обращение. Клиринговый сертификат участия: правовые основы выпуска; определение; основные характеристики; порядок выпуска.

5.3. Семинарские, практические, лабораторные занятия, их содержание

№ раздела и темы	Содержание и формы проведения
1	. Предмет, задачи дисциплины. Требования, предъявляемые для сдачи экзамена по дисциплине по результатам текущей работы на семинарских

№ раздела и темы	Содержание и формы проведения
	<p>занятиях. Ценные бумаги: понятие, виды, классификация. Проводится в форме семинара с элементами дискуссии. Понятие ценной бумаги. Свойства ценной бумаги. Виды ценных бумаг. Классификации ценных бумаг: по соответствию признакам эмиссионных ценных бумаг; свидетельством какого капитала являются. Собеседование (разбор тестовых заданий). Презентация доклада(ов) с обсуждением.</p>
1	<p>. Проводится в форме семинара с элементами дискуссии. Классификации ценных бумаг: по виду удостоверяемых прав; представителями (титулами) какого рынка являются; по эмитентам; по сроку действия; по способу фиксации права на ценную бумагу и передачи ценной бумаги; по форме; по виду дохода. Форма удостоверения прав, закрепленной ценной бумагой. Собеседование (разбор тестовых заданий). Презентация доклада(ов) с обсуждением. Контрольная работа № 1 в форме теста по теме 1 «Ценные бумаги: понятие, виды, классификация».</p>
2	<p>. Проводится в форме семинара с элементами дискуссии. Определение облигации. Отличительные признаки облигаций. Классификация облигаций по эмитентам, сроку действия, форме, способу фиксации и передачи удостоверяемых прав, виду дохода, наличию права изменить срок действия облигации, наличию обеспечения, наличию права обмена на акции, уровню риска, способу погашения. Собеседование (разбор тестовых заданий). Презентация доклада(ов) с обсуждением.</p>
2	<p>. Проводится в форме семинара с элементами дискуссии. Основные характеристики облигаций: номинальная стоимость, рыночная цена, курс, купонный процент, текущий доход, текущая и конечная доходность, эффективная текущая и эффективная конечная доходность. Факторы, влияющие на динамику цен и доходности облигации. Измерение чувствительности цен облигаций. Решение задач. Собеседование (разбор тестовых заданий). Презентация доклада(ов) с обсуждением.</p>
2	<p>. Проводится в форме семинара с элементами дискуссии. Государственные (муниципальные) ценные бумаги: понятие, цели выпуска, функции. Облигации федеральных займов (ОФЗ): основные характеристики; виды; участники рынка; размещение, обращение, погашение. Государственные сберегательные облигации (ГСО): основные характеристики; обслуживание рынка; размещение, выкуп и обмен. Государственные ценные бумаги на российском рынке ценных бумаг: эволюция инструментов. Еврооблигации: понятие, отличительные признаки, место среди инструментов международного рынка ценных бумаг; участники рынка; особенности регулирования рынка. Еврооблигационные займы от имени Российской Федерации, субъектов Российской Федерации и российских корпоративных эмитентов. Решение задач. Собеседование (разбор тестовых заданий). Презентация</p>

№ раздела и темы	Содержание и формы проведения
	доклада(ов) с обсуждением.
2	. Проводится в форме семинара с элементами дискуссии. Облигации внешних облигационных займов Российской Федерации (ОВОЗ РФ). ОВОЗ РФ, выпущенные в процессе реструктуризации задолженности бывшего СССР перед Лондонским клубом кредиторов; ОВОЗ РФ с датами выпуска в 2010-2013 гг., 2015 г., 2016 г.: характеристики, участники рынка, размещение и обращение. Решение задач. Собеседование (разбор тестовых заданий). Презентация доклада(ов) с обсуждением. Контрольная работа № 2 в форме теста по теме 2 «Облигации».
3	. Правовые основы выпуска и обращения векселей в Российской Федерации. Определение векселя. Свойства и виды векселей. Схемы обращения простого и переводного векселей. Требования к составлению векселя. Акцепт векселя. Платеж векселя и протест векселя в неплатеже. Передача векселя через индоссамент. Виды индоссаментов. Аваль. Расчет доходности векселей. Решение задач. Собеседование (разбор тестовых заданий). Презентация доклада(ов) с обсуждением.
3	. Проводится в форме семинара с элементами дискуссии. Кредитные операции с векселями. Вексельные кредиты в форме учета векселей, специального ссудного счета под векселя. Выдача банком ссуды под залог векселей. Комиссионные операции банка с векселями. Инкассирование, домициляция векселей. Переучет векселей Центральным банком РФ. Развития вексельного рынка в России. Место векселей коммерческих банков на вексельном рынке. Собеседование (разбор тестовых заданий). Презентация доклада(ов) с обсуждением.
4	. Проводится в форме семинара с элементами дискуссии. Депозитный и сберегательный сертификаты: понятие, характеристики, виды, удостоверяемые права, оформление цессии, порядок выпуска. Значение и объемы выпуска депозитных и сберегательных сертификатов российскими коммерческими банками. Чек: понятие, виды, реквизиты. Передача прав по чеку. Назначение чека. Закладная: правовые основы выпуска и обращения, определение, вид договора как основание для выпуска закладной, основные характеристики, порядок выпуска, обращение. Двойное и простое складские свидетельства: правовые основы выпуска и обращения, определение, виды, основные характеристики, реквизиты, порядок выпуска, участники и сфера обращения, погашение. Собеседование (разбор тестовых заданий). Презентация доклада(ов) с обсуждением.
4	. Проводится в форме семинара с элементами дискуссии. Коносамент: определение, основные характеристики, реквизиты, порядок выпуска, обращение, цена. Клиринговый сертификат участия: определение, основные характеристики, сфера использования. Собеседование (разбор тестовых заданий). Презентация доклада(ов) с обсуждением. Контрольная работа № 3 в форме теста по темам 3-4: «Векселя»,

№ раздела и темы	Содержание и формы проведения
	«Депозитные и сберегательные сертификаты, чеки и иные виды долговых ценных бумаг»
5	<p>. Проводится в форме семинара с элементами дискуссии.</p> <p>Понятие акции. Классификация акций. Категории (типы) акций. Права акционеров -держателей обыкновенных и привилегированных акций. Право на получение дивиденда: понятие дивиденда, порядок установления размера и выплаты дивидендов по категориям акций, ограничения на выплату дивидендов. Право на участие в управлении акционерным обществом. Возникновение права голоса по привилегированным акциям. Право на имущество общества при его ликвидации: способы ликвидации акционерного общества, порядок ликвидации общества на добровольной основе, очередность удовлетворения требований акционеров при ликвидации.</p> <p>Собеседование (разбор тестовых заданий). Презентация доклада(ов) с обсуждением.</p>
5	<p>. Проводится в форме семинара с элементами дискуссии.</p> <p>Права акционера: право требования на выкуп обществом принадлежащих акционеру акций; право на информацию об акционерном обществе; преимущественное право на приобретение размещаемых дополнительных акций; право свободного распоряжения акциями.</p> <p>Типы привилегированных акций.</p> <p>Виды стоимостной оценки акции. Доходность акции.</p> <p>Решение задач. Собеседование (разбор тестовых заданий). Презентация доклада(ов) с обсуждением.</p>
5	<p>. Проводится в форме семинара с элементами дискуссии.</p> <p>Опцион эмитента: определение, основные характеристики, ограничения на выпуск. Фондовый варрант как зарубежный аналог опциона эмитента.</p> <p>Российская депозитарная расписка: определение, основные характеристики, закрепляемые права, особенности эмиссии и обращения.</p> <p>Американские депозитарные расписки (АДР): понятие, причины и порядок выпуска. Виды и уровни АДР: сущность и отличительные признаки.</p> <p>Обращение АДР. Глобальные депозитарные расписки (ГДР). Характерные черты и тенденции развития российского рынка акций. Капитализация и ликвидность рынка. Факторы повышения ликвидности акций. Проблемы вторичных эмиссий акций акционерными обществами Российской Федерации.</p> <p>Собеседование (разбор тестовых заданий). Презентация доклада(ов) с обсуждением</p>
6	<p>. Проводится в форме семинара с элементами дискуссии.</p> <p>Инвестиционный пай: правовые основы выпуска; понятие, удостоверяемые права; основные характеристики; порядок выпуска; обращение. Расчетная цена инвестиционного пая.</p> <p>Ипотечный сертификат участия: правовые основы выпуска; определение; основные характеристики; порядок выпуска, обращение.</p> <p>Клиринговый сертификат участия: правовые основы выпуска; определение; основные характеристики; порядок выпуска.</p> <p>Собеседование (разбор тестовых заданий). Презентация доклада(ов) с обсуждением.</p>

6. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации по дисциплине (полный текст приведен в приложении к рабочей программе)

6.1. Текущий контроль

№ п/п	Этапы формирования компетенций (Тема из рабочей программы дисциплины)	Перечень формируемых компетенций по ФГОС ВО	(ЗУНы: (З.1...З.п, У.1...У.п, Н.1...Н.п))	Контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы (Наименование оценочного средства)	Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания (по 100-балльной шкале)
1	1. Ценные бумаги: понятие, виды, классификация	ПК-6	З.Знать основные методы анализа данных отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях	Коллоквиум 1	Оценка выставляется по совокупности ответов на поставленные вопросы от 0 до 5 баллов. (5)
2	2. Облигации	ПК-7	З.Знать основные принципы построения информационных обзоров и/или аналитических отчетов У.Уметь подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет по результатам проведенного анализа собранных данных Н.Владеть навыком сбора информации с использованием отечественных и зарубежных источников	Доклад 1	Доклад оценивается в зависимости от полноты раскрытия темы от 1 до 10 баллов (10)
3		ПК-7	У.Уметь подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет по результатам проведенного анализа собранных данных Н.Владеть навыком сбора информации с использованием отечественных и зарубежных источников	Контрольная работа 1	Максимальное количество баллов, приходящееся на контрольную работу № 1 и соответствующее оценке «отлично», — 20, количество баллов, соответствующее оценке «хорошо» — 16 баллов, оценке «удовлетворительно» — 12 баллов. (20)
4	3. Векселя	ПК-7	З.Знать основные принципы построения	Доклад 2	Доклад оценивается в

№ п/п	Этапы формирования компетенций (Тема из рабочей программы дисциплины)	Перечень формируемых компетенций по ФГОС ВО	(ЗУНы: (З.1...З.п, У.1...У.п, Н.1...Н.п)	Контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы (Наименование оценочного средства)	Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания (по 100-балльной шкале)
			информационных обзоров и/или аналитических отчетов У. Уметь подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет по результатам анализа собранной информации Н. Владеть навыком сбора информации с использованием отечественных и зарубежных источников		зависимости от полноты раскрытия темы от 1 до 10 баллов (10)
5		ПК-6	З. Знать основные методы анализа данных отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях	Коллоквиум 2	Оценка выставляется по совокупности ответов на поставленные вопросы от 0 до 5 баллов. (5)
6	4. Депозитные и сберегательные сертификаты, чеки и иные виды долговых ценных бумаг	ПК-6	З. Знать основные методы анализа данных отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях	Коллоквиум 3	Оценка выставляется по совокупности ответов на поставленные вопросы от 0 до 5 баллов. (5)
7		ПК-6	У. Уметь выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей Н. Владеть навыком интерпретации данных отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях	Контрольная работа 2	Максимальное количество баллов, приходящееся на контрольную работу № 2 и соответствующее оценке «отлично», — 10, количество баллов, соответствующее оценке «хорошо» — 8 баллов, оценке «удовлетворительно» — 6 баллов. (10)
8	5. Акции и	ПК-7	З. Знать основные	Доклад 4	Доклад

№ п/п	Этапы формирования компетенций (Тема из рабочей программы дисциплины)	Перечень формируемых компетенций по ФГОС ВО	(ЗУНы: З.1...З.п, У.1...У.п, Н.1...Н.п)	Контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы (Наименование оценочного средства)	Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания (по 100-балльной шкале)
	ценные бумаги на их основе		принципы построения информационных обзоров и/или аналитических отчетов У. Уметь подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет по результатам проведенного анализа собранных данных Н. Владеть навыком сбора информации с использованием отечественных и зарубежных источников		оценивается в зависимости от полноты раскрытия темы от 1 до 10 баллов (10)
9		ПК-6	З. Знать основные методы анализа данных отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях	Коллоквиум 4	Оценка выставляется по совокупности ответов на поставленные вопросы от 0 до 5 баллов. (5)
10		ПК-6	У. Уметь выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей Н. Владеть навыком интерпретации данных отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях	Контрольная работа 3	Максимальное количество баллов, приходящееся на контрольную работу № 3 и соответствующее оценке «отлично», — 10, количество баллов, соответствующее оценке «хорошо» — 8 баллов, оценке «удовлетворительно» — 6 баллов. (10)
11	6. Инвестиционные паи. Ипотечные сертификаты участия. Клиринговые сертификаты участия.	ПК-7	З. Знать основные принципы построения информационных обзоров и/или аналитических отчетов У. Уметь подготовить информационный	Доклад 3	Доклад оценивается в зависимости от полноты раскрытия темы от 1 до 10 баллов (10)

№ п/п	Этапы формирования компетенций (Тема из рабочей программы дисциплины)	Перечень формируемых компетенций по ФГОС ВО	(ЗУНы: (З.1...З.п, У.1...У.п, Н.1...Н.п)	Контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы (Наименование оценочного средства)	Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания (по 100-балльной шкале)
			обзор и/или аналитический отчет по результатам проведенного анализа собранных данных		
				Итого	100

6.2. Промежуточный контроль (зачет, экзамен)

Рабочим учебным планом предусмотрен Зачет в семестре 31.

ВОПРОСЫ ДЛЯ ПРОВЕРКИ ЗНАНИЙ:

1-й вопрос билета (40 баллов), вид вопроса: Тест/проверка знаний. Критерий: Каждый правильный ответ на вопрос оценивается в 2 балла.

Компетенция: ПК-6 способность анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей

Знание: Знать основные методы анализа данных отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях

1. Государственные сберегательные облигации (ГСО): основные характеристики, обслуживание рынка, размещение, выкуп и обмен.
2. Государственный долг и муниципальный долг: понятие, структура, внутренний и внешний государственный долг.
3. Еврооблигации: понятие, отличительные признаки, место среди инструментов международного рынка ценных бумаг; участники рынка; особенности регулирования рынка.
4. Облигации внешних облигационных займов Российской Федерации.
5. Облигации федеральных займов (ОФЗ): основные характеристики, виды ОФЗ.
6. Определение, свойства и виды векселей.
7. Основные характеристики облигаций: номинальная стоимость, рыночная цена, курс, купонный процент, текущий доход, текущая и конечная доходность.
8. Особенности передачи векселя через индоссамент, виды индоссаментов.
9. Отличительные признаки облигаций.
10. Требования к составлению векселя.

Компетенция: ПК-7 способность, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные, проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет

Знание: Знать основные принципы построения информационных обзоров и/или аналитических отчетов

11. Акционерные общества: правовые основы деятельности в Российской Федерации.
12. Виды стоимостной оценки акции. Доходность акции.

13. Депозитный и сберегательный сертификаты: понятие, характеристики, виды, удостоверяемые права, оформление цессии, порядок выпуска.
14. Закладная: правовые основы выпуска и обращения, определение, вид договора как основание для выпуска закладной, основные характеристики, порядок выпуска, обращение.
15. Инвестиционный пай: правовые основы выпуска и обращения, понятие, удостоверяемые права, основные характеристики, порядок выпуска, обращение.
16. Ипотечный сертификат участия: правовые основы выпуска и обращения, определение, основные характеристики, порядок выпуска, обращение.
17. Классификация облигаций по эмитентам, сроку действия, форме, способу фиксации и передачи удостоверяемых прав, виду дохода, наличию права изменить срок действия облигации, наличию обеспечения, наличию права обмена на акции, уровню риска, способу погашения.
18. Кредитные операции с векселями.
19. Опцион эмитента: определение, основные характеристики, ограничения на выпуск.
20. Органы управления акционерного общества: порядок создания, полномочия.
21. Понятие, классификация акций.
22. Права акционеров ? держателей обыкновенных и привилегированных акций.
23. Российская депозитарная расписка: определение, основные характеристики, закрепляемые права, особенности эмиссии и обращения.
24. Типы привилегированных акций.
25. Ценные бумаги товарного рынка: двойное и простое складские свидетельства, коносамент.
26. Чек: понятие, виды, реквизиты.

ТИПОВЫЕ ЗАДАНИЯ ДЛЯ ПРОВЕРКИ УМЕНИЙ:

2-й вопрос билета (30 баллов), вид вопроса: Задание на умение. Критерий: Оценивается правильность расчета.

Компетенция: ПК-6 способность анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей

Умение: Уметь выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей

Задача № 1. Определить приобретение какой из облигаций обеспечит держателю большую текущую доходность?

Задача № 2. Определить цену совершения сделки с учетом накопленного купонного дохода.

Компетенция: ПК-7 способность, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные, проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет

Умение: Уметь подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет по результатам проведенного анализа собранных данных

Задача № 3. Определить у какого инвестора эффективная текущая доходность по облигациям выше? Привести расчет по каждому инвестору.

Задача № 4. Рассчитайте цену совершения сделки с учетом накопленного купонного дохода.

ТИПОВЫЕ ЗАДАНИЯ ДЛЯ ПРОВЕРКИ НАВЫКОВ:

3-й вопрос билета (30 баллов), вид вопроса: Задание на навыки. Критерий: Оценивается правильность расчета.

Компетенция: ПК-6 способность анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей

Навык: Владеть навыком интерпретации данных отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях

Задание № 1. Рассчитать размер конечного дохода по облигации с амортизацией долга с известной номинальной стоимостью

Компетенция: ПК-7 способность, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные, проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет

Навык: Владеть навыком сбора информации с использованием отечественных и зарубежных источников

Задание № 2. Рассчитать годовой купонный (текущий) доход и текущую доходность по облигации

Задание № 3. Рассчитать эффективный конечный доход инвестора — юридического лица за время владения облигацией. Привести формулы, необходимые для расчета и сам расчет по действиям.

ОБРАЗЕЦ БИЛЕТА

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «БАЙКАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ» (ФГБОУ ВО «БГУ»)	Направление - 38.03.01 Экономика Профиль - Финансы и кредит, бухгалтерский учет и налогообложение Кафедра финансов и финансовых институтов Дисциплина - Ценные бумаги
---	--

БИЛЕТ № 1

1. Тест (40 баллов).
2. Определить приобретение какой из облигаций обеспечит держателю большую текущую доходность? (30 баллов).
3. Рассчитать размер конечного дохода по облигации с амортизацией долга с известной номинальной стоимостью (30 баллов).

Составитель _____ А.А. Тимофеева

Заведующий кафедрой _____ Т.В. Щукина

7. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

а) основная литература:

1. Галанов В. А. Рынок ценных бумаг. учебник для вузов. допущено М-вом образования и науки РФ/ В. А. Галанов.- М.: ИНФРА-М, 2014.-378 с.
2. Алексеева И. А. Ирина Анатольевна Рынок ценных бумаг. Ч. 1. учеб. пособие. Электронный ресурс. 2-е изд., доп. и перераб./ И. А. Алексеева.- Иркутск: Изд-во БГУЭП, 2013.-252 с.
3. [Гонов А.А. Инструменты рынка ценных бумаг \[Электронный ресурс\] : учебное пособие / А.А. Гонов, А.В. Луценко, М.А. Медведева. — Электрон. текстовые данные. —](#)

Екатеринбург: Уральский федеральный университет, ЭБС АСВ, 2015. — 156 с. — 978-5-7996-1496-6. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/66155.html>

б) дополнительная литература:

1. Алехин Б. И. Рынок ценных бумаг. 2-е изд., перераб. и доп./ Б.И. Алехин.- Москва: Юнити-Дана, 2012.-464 с.
2. Селищев А. С. Александр Сергеевич, Маховикова Г. А. Галина Афонасьевна Рынок ценных бумаг. учеб. для бакалавров. допущено М-вом образования и науки РФ/ А. С. Селищев, Г. А. Маховикова.- М.: Юрайт, 2013.-431 с.
3. Николаева И. П. Рынок ценных бумаг/ И.П. Николаева.- Москва: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2015.-256 с.
4. Лялин В. А., Воробьев П. В. Рынок ценных бумаг. учебник. Изд. 2-е, перераб. и доп./ В. А. Лялин, П. В. Воробьев.- М.: Проспект, 2015.-398 с.
5. Кузнецов Б.Т. Рынок ценных бумаг. учебное пособие. Электронный ресурс/ Б.Т. Кузнецов.- Москва: Юнити-Дана, 2017.-288 с.
6. [Алиев А.Р. Рынок ценных бумаг в России \[Электронный ресурс\] : учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальности «Финансы и кредит» / А.Р. Алиев. — Электрон. текстовые данные. — М. : ЮНИТИ-ДАНА, 2017. — 199 с. — 978-5-238-01921-5. — Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/71224.html](http://www.iprbookshop.ru/71224.html)
7. [Кейт Роджерс Рынок облигаций \[Электронный ресурс\] : курс для начинающих / Роджерс Кейт. — Электрон. текстовые данные. — М. : Альпина Паблишер, 2017. — 344 с. — 978-5-9614-1091-4. — Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/68008.html](http://www.iprbookshop.ru/68008.html)
8. [Кузнецов Б.Т. Рынок ценных бумаг \[Электронный ресурс\] : учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальности «Финансы и кредит» / Б.Т. Кузнецов. — Электрон. текстовые данные. — М. : ЮНИТИ-ДАНА, 2017. — 288 с. — 978-5-238-01945-1. — Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/71054.html](http://www.iprbookshop.ru/71054.html)
9. [Роджер Гибсон Формирование инвестиционного портфеля \[Электронный ресурс\] : управление финансовыми рисками / Гибсон Роджер. — Электрон. текстовые данные. — М. : Альпина Паблишер, Альпина Бизнес Букс, 2016. — 276 с. — 978-5-9614-0775-4. — Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/41496.html](http://www.iprbookshop.ru/41496.html)
10. [Скрипниченко М.В. Портфельные инвестиции \[Электронный ресурс\] : учебное пособие / М.В. Скрипниченко. — Электрон. текстовые данные. — СПб. : Университет ИТМО, 2016. — 42 с. — 2227-8397. — Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/67536.htm](http://www.iprbookshop.ru/67536.htm)
11. [Слепухина Ю.Э. Риск-менеджмент на финансовых рынках \[Электронный ресурс\] : учебное пособие / Ю.Э. Слепухина. — Электрон. текстовые данные. — Екатеринбург: Уральский федеральный университет, 2015. — 216 с. — 978-5-7996-1522-2. — Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/68289.html](http://www.iprbookshop.ru/68289.html)

8. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины (модуля), включая профессиональные базы данных и информационно-справочные системы

Для освоения дисциплины обучающемуся необходимы следующие ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:

– Сайт Байкальского государственного университета, адрес доступа: <http://bgu.ru/>, доступ круглосуточный неограниченный из любой точки Интернет

– Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU, адрес доступа: <http://elibrary.ru/>. доступ к российским журналам, находящимся полностью или частично в открытом доступе при условии регистрации

– Сайт Министерства финансов, адрес доступа: http://www.minfin.ru/common/UPLOAD/library/2014/07/main/ONBP_2015-2017.pdf. доступ неограниченный

– Сайт ЦБ РФ, адрес доступа: <http://www.cbr.ru/publ>. доступ неограниченный

– Электронно-библиотечная система IPRbooks, адрес доступа: <http://www.iprbookshop.ru>.
доступ неограниченный

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

Изучать дисциплину рекомендуется в соответствии с той последовательностью, которая обозначена в ее содержании. Для успешного освоения курса обучающиеся должны иметь первоначальные знания в области финансов, денег и кредита, макроэкономики.

На лекциях преподаватель озвучивает тему, знакомит с перечнем литературы по теме, обосновывает место и роль этой темы в данной дисциплине, раскрывает ее практическое значение. В ходе лекций студенту необходимо вести конспект, фиксируя основные понятия и проблемные вопросы.

Практические (семинарские) занятия по своему содержанию связаны с тематикой лекционных занятий. Начинать подготовку к занятию целесообразно с конспекта лекций. Задание на практическое (семинарское) занятие сообщается обучающимся до его проведения. На семинаре преподаватель организует обсуждение этой темы, выступая в качестве организатора, консультанта и эксперта учебно-познавательной деятельности обучающегося.

Изучение дисциплины (модуля) включает самостоятельную работу обучающегося.

Основными видами самостоятельной работы студентов с участием преподавателей являются:

- текущие консультации;
- коллоквиум как форма контроля освоения теоретического содержания дисциплин: (в часы консультаций, предусмотренные учебным планом);
- прием и разбор домашних заданий (в часы практических занятий);

Основными видами самостоятельной работы студентов без участия преподавателей являются:

- формирование и усвоение содержания конспекта лекций на базе рекомендованной лектором учебной литературы, включая информационные образовательные ресурсы (электронные учебники, электронные библиотеки и др.);
- самостоятельное изучение отдельных тем или вопросов по учебникам или учебным пособиям;
- подготовка докладов с презентациями;
- подготовка к семинарам;
- выполнение домашних заданий в виде решения отдельных задач, ответов на тестовые задания.

10. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения

В учебном процессе используется следующее программное обеспечение:

- MS Office,
- КонсультантПлюс: Версия Проф - информационная справочная система,

11. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю):

В учебном процессе используется следующее оборудование:

- Помещения для самостоятельной работы, оснащенные компьютерной техникой с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду вуза,
- Учебные аудитории для проведения: занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, практических занятий, выполнения курсовых работ, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, укомплектованные специализированной мебелью и техническими средствами обучения,
- Наборы демонстрационного оборудования и учебно-наглядных пособий