

Документ подписан простой электронной подписью.
Информация о владельце:

ФИО: Кандрашина Елена Александровна

Должность: Врио ректора ФГАОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 22.06.2023 14:33:41

Уникальный программный ключ:

b2fd765521f4c570b8c6e8e502a10b4f1de8ae0d

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный экономический университет»

Институт Институт национальной и мировой экономики

Кафедра Экономической теории

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета

(протокол № 11 от 30 мая 2023 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Наименование дисциплины Б1.В.03 Консультационный проект

Основная профессиональная образовательная программа 38.03.01 Экономика программа Ценные бумаги и финансовые технологии

Квалификация (степень) выпускника Бакалавр

Самара 2023

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный экономический университет»**

Институт Институт национальной и мировой экономики
Кафедра Экономической теории

АННОТАЦИЯ

Наименование дисциплины Б1.В.03 Консультационный проект

Основная профессиональная образовательная программа 38.03.01 Экономика программа Ценные бумаги и финансовые технологии

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный экономический университет»**

Институт Институт национальной и мировой экономики
Кафедра Экономической теории

УТВЕРЖДЕНО
Ученым советом Университета
(протокол № 11 от 30 мая 2023 г.)

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ
ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ**

Наименование дисциплины	Б1.В.03 Консультационный проект
Основная профессиональная образовательная программа	38.03.01 Экономика программа Ценные бумаги и финансовые технологии

Самара 2023

Содержание (рабочая программа)

Стр.

- 1 Место дисциплины в структуре ОП
- 2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 3 Объем и виды учебной работы
- 4 Содержание дисциплины
- 5 Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины
- 6 Фонд оценочных средств по дисциплине

Содержание (ФОС)

Стр.

- 6.1 Контрольные мероприятия по дисциплине
- 6.2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 6.3 Паспорт оценочных материалов
- 6.4 Оценочные материалы для текущего контроля
- 6.5 Оценочные материалы для промежуточной аттестации
- 6.6 Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

Целью изучения дисциплины является формирование результатов обучения, обеспечивающих достижение планируемых результатов освоения образовательной программы.

1. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Консультационный проект входит в часть, формируемая участниками образовательных отношений блока Б1. Дисциплины (модули)

Последующие дисциплины по связям компетенций: Портфельное инвестирование, Производные финансовые инструменты, Теория факторных доходов, Профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг, Организация и регулирование фондового рынка, Биржевое дело, Корпоративное дело, Финансовые институты, Конкуренция и монополия на финансовых рынках, Основы финансовой политики и макрорегулирования, Практикум по рынку ценных бумаг, Практикум по валютному рынку, Зарубежные фондовые рынки

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Изучение дисциплины Консультационный проект в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-1 - Способен, используя отечественные и зарубежные источники информации, в том числе информацию, содержащуюся в отчетности организаций - участников рынка ценных бумаг, осуществить мониторинг рынка банковских услуг, иностранной валюты, рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-1	ПК-1.1 Знать	ПК-1.2 Уметь	ПК-1.3 Владеть (иметь навыки)
Способен совершать сделки с валютой, ценными бумагами и производными финансовыми инструментами	Особенности функционирования современных финансовых рынков, методики расчета стоимости ценных бумаг, производных финансовых инструментов, кросс-курсов валют	Прогнозировать курсы ценных бумаг, ПФИ и валют на основе графиков, совершать сделки в биржевом терминале, осуществлять анализ факторов, влияющих на курсы валют, ценных бумаг и ПФИ	Способностью рассчитать основные показатели, характеризующие состояние хозяйствующих субъектов, на основе зарубежных и отечественных методик подготовить отчет и/или аналитический обзор

ПК-2 - Способен на основе типовых методик осуществить расчет цен валюты, ценных бумаг, фондовых индексов и производных финансовых инструментов и совершать сделки с валютой, ценными бумагами и производными финансовыми инструментами

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине

ПК-2	ПК-2.1 Знать	ПК-2.2 Уметь	ПК-2.3 Владеть (иметь навыки)
Способен анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности компаний, являющихся участниками рынка ценных бумаг	Правила применения нормативных актов регламентирующие правила построения отчетности компаний, являющихся участниками рынка ценных бумаг и правил анализа и интерпретации финансовой и, бухгалтерской информации в учебных заданиях	При решении задач применять нормативные акты регламентирующие правила построения отчетности компаний, являющихся участниками рынка ценных бумаг и правила анализа и интерпретации финансовой и, бухгалтерской информации при решении учебных задач	При решении задач практическими навыками применения в профессиональной деятельности нормативных актов, регламентирующих правила построения отчетности компаний, являющихся участниками рынка ценных бумаг и правилами анализа и интерпретации финансовой и, бухгалтерской информации

ПК-3 - Способен определить инвестиционный профиль участника рынка ценных бумаг, подобрать в соответствии с установленным профилем поставщиков финансовых услуг и проконсультировать по разному типу финансовых продуктов, обращающихся на банковском, валютном рынках и рынке ценных бумаг и производных финансовых инструментов

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-3	ПК-3.1 Знать	ПК-3.2 Уметь	ПК-3.3 Владеть (иметь навыки)
Способен собрать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета показателей финансово-хозяйственной деятельности компаний-участников рынка ценных бумаг, а также для оценки состояния рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов в целом	Различные методики расчета показателей финансово-хозяйственной деятельности компаний-участников рынка ценных бумаг, а также показателей оценки состояния рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов в целом	Анализировать данные о финансово-хозяйственной деятельности компаний-участников рынка ценных бумаг, а также о состоянии рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов в целом	Способностью интерпретировать и анализировать данные о финансово-хозяйственной деятельности компаний-участников рынка ценных бумаг, а также о состоянии рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов в целом

ПК-4 - Способен на основе действующей нормативно-правовой базы осуществить контроль за деятельностью управляющих компаний, вести внутренний учет сделок с ценными бумагами и производными финансовыми инструментами, составлять и вести реестры владельцев ценных бумаг и определять взаимные обязательства участников торгов

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-4	ПК-4.1 Знать	ПК-4.2 Уметь	ПК-4.3 Владеть (иметь навыки)

<p>Обладает способностью, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать и осуществить мониторинг рынка банковских услуг иностранной валюты, рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов</p>	<p>Методологические основы системного анализа, процедуру системного анализа, навыками поиска необходимой информации и проведения сравнительного анализа экономического состояния рынка банковских услуг иностранной валюты, рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов</p>	<p>Собирать, анализировать и интерпретировать необходимую информацию, содержащуюся в различных формах отчетности и прочих отечественных и зарубежных источниках, выделить внешние и внутренние факторы системы, проводить качественный анализ результатов прогноза, использовать источники экономической, социальной, управленческой информации. представлять результаты аналитической и исследовательской работы в виде выступления, доклада, информационного обзора, аналитического отчета, статьи</p>	<p>Навыками сбора и обработки необходимых данных, навыками анализа и интерпретации информации, содержащейся в различных отечественных и зарубежных источниках о состоянии рынка банковских услуг иностранной валюты, рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов</p>
---	--	--	---

3. Объем и виды учебной работы

Учебным планом предусматриваются следующие виды учебной работы по дисциплине:

Очная форма обучения

Виды учебной работы	Всего час/ з.е.			
	Сем 5	Сем 6	Сем 7	Сем 8
Контактная работа, в том числе:	36.15/1	36.15/1	36.15/1	36.15/1
Занятия лекционного типа	18/0.5	18/0.5	18/0.5	18/0.5
Занятия семинарского типа	18/0.5	18/0.5	18/0.5	18/0.5
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.15/0	0.15/0	0.15/0	0.15/0
Самостоятельная работа	53.85/1.5	53.85/1.5	53.85/1.5	53.85/1.5
Промежуточная аттестация	18/0.5	18/0.5	18/0.5	18/0.5
Вид промежуточной аттестации: Зачет	Зач	Зач	Зач	Зач

Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	108	108	108	108
Зачетные единицы	3	3	3	3

4. Содержание дисциплины

4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Консультационный проект представлен в таблице.

Разделы, темы дисциплины и виды занятий Очная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контактная работа				Самостоятельная работа	Планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по образовательной программе
		Лекции	Занятия семинарского типа	ИКР	ГКР		
			Практич. занятия				
1.	Функционирование финансового рынка и финансовых институтов	18	18	0.15		53.85	ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3, ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3
2.	Фундаментальный анализ эмитентов и активов	18	18	0.15		53.85	ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3, ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3
3.	Корпоративное управление и хозяйственная деятельность корпораций	18	18	0.15		53.85	ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2,

							ПК-3.3, ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3
4.	Портфельное инвестирование и управление портфелем	18	18	0.15		53.85	ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3, ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3
	Контроль	72					
	Итого	72	72	0.6		215.4	

4.2 Содержание разделов и тем

4.2.1 Контактная работа

Тематика занятий лекционного типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия лекционного типа*	Тематика занятия лекционного типа
1.	Функционирование финансового рынка и финансовых институтов	лекция	Сущность и содержание финансового рынка
		лекция	Инструменты финансового рынка
		лекция	Финансовые посредники
		лекция	Регулирование финансовых рынков
		лекция	Основные тенденции и особенности развития финансовых рынков на современном этапе
		лекция	Денежный рынок
		лекция	Рынок долгосрочного заемного капитала
2.	Фундаментальный анализ эмитентов и активов	лекция	Основные подходы к изучению динамики рынка.
		лекция	Методика проведения фундаментального анализа рынка ценных бумаг.
		лекция	Экономический и отраслевой анализ. Рыночный анализ активов.

		лекция	Финансовый анализ деятельности предприятия.
		лекция	Рыночные характеристики акций. Финансовые вычисления по акциям.
		лекция	Фундаментальный анализ облигаций. Финансовые вычисления по облигациям.
3.	Корпоративное управление и хозяйственная деятельность корпораций	лекция	Корпорация. Понятие корпоративного дела
		лекция	Проблемы создания акционерного общества. Регулирование внутренних корпоративных отношений
		лекция	Акции акционерных обществ. Права и обязанности акционеров
		лекция	Общее собрание акционеров
		лекция	Совет директоров (Наблюдательный совет)
		лекция	Исполнительные органы общества
		лекция	Хозяйственная деятельность корпораций
4.	Портфельное инвестирование и управление портфелем	лекция	Основы знаний о портфельном инвестировании
		лекция	Ожидаемая доходность и риск портфеля
		лекция	Выбор рискованного портфеля
		лекция	Определение эффективной границы и оптимальных портфелей
		лекция	Стратегии в управлении портфелем
		лекция	Принятие решения в условиях риска и неопределенности
		лекция	Параметрическая модель VaR

*лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся

Тематика занятий семинарского типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия семинарского типа**	Тематика занятия семинарского типа
1.	Функционирование финансового рынка и финансовых институтов	практическое занятие	Сущность и содержание финансового рынка
практическое занятие		Инструменты финансового рынка	
практическое занятие		Финансовые посредники	
практическое занятие		Регулирование финансовых рынков	
практическое занятие		Основные тенденции и особенности развития финансовых рынков на современном этапе	
практическое занятие		Денежный рынок	

		практическое занятие	Рынок долгосрочного заемного капитала	
2.	Фундаментальный анализ эмитентов и активов	практическое занятие	Основные подходы к изучению динамики рынка.	
		практическое занятие	Методика проведения фундаментального анализа рынка ценных бумаг.	
		практическое занятие	Экономический и отраслевой анализ. Рыночный анализ активов.	
		практическое занятие	Финансовый анализ деятельности предприятия.	
		практическое занятие	Рыночные характеристики акций. Финансовые вычисления по акциям.	
		практическое занятие	Фундаментальный анализ облигаций. Финансовые вычисления по облигациям.	
3.	Корпоративное управление и хозяйственная деятельность корпораций	практическое занятие	Корпорация. Понятие корпоративного дела	
		практическое занятие	Проблемы создания акционерного общества. Регулирование внутренних корпоративных отношений	
		практическое занятие	Акции акционерных обществ. Права и обязанности акционеров	
		практическое занятие	Общее собрание акционеров	
		практическое занятие	Совет директоров (Наблюдательный совет)	
		практическое занятие	Исполнительные органы общества	
	4.	Портфельное инвестирование и управление портфелем	практическое занятие	Хозяйственная деятельность корпораций
			практическое занятие	Основы знаний о портфельном инвестировании
			практическое занятие	Ожидаемая доходность и риск портфеля
			практическое занятие	Выбор рискованного портфеля
			практическое занятие	Определение эффективной границы и оптимальных портфелей
			практическое занятие	Стратегии в управлении портфелем
		практическое занятие	Принятие решения в условиях риска и неопределенности	
		практическое занятие	Параметрическая модель VaR	

** семинары, практические занятия, практикумы, лабораторные работы, коллоквиумы и иные аналогичные занятия

Иная контактная работа

При проведении учебных занятий СГЭУ обеспечивает развитие у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств (включая при необходимости проведение интерактивных лекций, групповых дискуссий, ролевых игр, тренингов, анализ ситуаций и имитационных моделей, преподавание дисциплин (модулей) в форме курсов, составленных на основе результатов научных исследований, проводимых организацией, в том числе с учетом региональных особенностей профессиональной деятельности выпускников и потребностей работодателей).

Формы и методы проведения иной контактной работы приведены в Методических указаниях по основной профессиональной образовательной программе.

4.2.2 Самостоятельная работа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид самостоятельной работы ***
1.	Функционирование финансового рынка и финансовых институтов	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование
2.	Фундаментальный анализ эмитентов и активов	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование
3.	Корпоративное управление и хозяйственная деятельность корпораций	- подготовка доклада - тестирование
4.	Портфельное инвестирование и управление портфелем	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование

*** самостоятельная работа в семестре, написание курсовых работ, докладов, выполнение контрольных работ

5. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

5.1 Литература:

Основная литература

1. Гусева И. А. Финансовые рынки и институты : учебник и практикум для вузов / И. А. Гусева. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 347 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00339-0. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/469564>
2. Корпоративная социальная ответственность : учебник и практикум для вузов / В. Я. Горфинкель [и др.] ; ответственный редактор В. Я. Горфинкель, Н. В. Родионова. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 438 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-11340-2. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/450196>
3. Божук, С. Г. Корпоративная социальная ответственность : учебник для вузов / С. Г. Божук, В. В. Кулибанова, Т. Р. Тэор. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 226 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-09589-0. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/470277>
4. Рынок ценных бумаг : учебник для вузов / Н. И. Берзон [и др.] ; под общей редакцией Н. И. Берзона. — 5-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 514 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-11196-5. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/449663>
5. Теплова Т. В. Инвестиции в 2 ч. Часть 1 : учебник и практикум для вузов / Т. В. Теплова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 409 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-01818-9. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/451566>
6. Теплова Т. В. Инвестиции в 2 ч. Часть 2 : учебник и практикум для вузов / Т. В. Теплова. —

2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 382 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-01820-2. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/451568>

Дополнительная литература

1. Михайленко, М. Н. Финансовые рынки и институты : учебник для вузов / М. Н. Михайленко. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 336 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-01273-6. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/450069>
2. Ермолаев К. Н. Финансовые рынки [Электронный ресурс] : учебное пособие / М. Е. Коновалова, О. Ю. Кузьмина. - Самара : Изд-во Самар. гос. экон. ун-та, 2017. - 85 с. - ISBN 978-5-94622-787-2. <http://lib1.sseu.ru/MegaPro/Web>
3. Михайленко, М. Н. Рынок ценных бумаг : учебник и практикум для вузов / М. Н. Михайленко. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 326 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-04961-9. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/468907>
4. Корпоративная социальная ответственность : учебник и практикум для вузов / Э. М. Коротков [и др.] ; под редакцией Э. М. Короткова. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 429 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-07332-4. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/468747>
5. Касьяненко, Т. Г. Экономическая оценка инвестиций : учебник и практикум / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 559 с. — (Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-9916-3089-4. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/425890>

Литература для самостоятельного изучения

1. Теплова, Т. В. Инвестиции: учебник для бакалавров Главы 7,8 / Т. В. Теплова. — 2-е изд., перераб. и доп. — М.: Издательство Юрайт, 2014. — 782 с. — Серия: Бакалавр. Углубленный курс. — ISBN 978-5-9916-3309-3 <https://www.biblio-online.ru/search?query=Теплова+Инвестиции>
2. Аппель Дж. Эффективные инвестиции. Как зарабатывать на росте и падении акций, инфляции, скачках цен на нефть... и не только[электронный ресурс]/ Пер. с англ. под ред. В.В. Ильина. — Спб.: Питер, 2009. — 416с. — ISBN 978-5-91180-949-2 <http://ibooks.ru/reading.php?productid=21898>

5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения

1. Microsoft Windows 10 Education / Microsoft Windows 7 / Windows Vista Business
2. Office 365 ProPlus, Microsoft Office 2019, Microsoft Office 2016 Professional Plus (Word, Excel, Access, PowerPoint, Outlook, OneNote, Publisher) / Microsoft Office 2007 (Word, Excel, Access, PowerPoint)

5.3 Современные профессиональные базы данных, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Профессиональная база данных «Информационные системы Министерства экономического развития Российской Федерации в сети Интернет» (Портал «Официальная Россия» - <http://www.gov.ru/>)
2. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/ru/>)
3. Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики - <http://www.gks.ru/>)

5.4. Информационно-справочные системы, к которым обеспечивается доступ

обучающихся

1. Справочно-правовая система «Консультант Плюс»
2. Справочно-правовая система «ГАРАНТ-Максимум»

5.5. Специальные помещения

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран
Учебные аудитории для проведения практических занятий (занятий семинарского типа)	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для самостоятельной работы	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для хранения и профилактического обслуживания оборудования	Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования

5.6 Лаборатории и лабораторное оборудование**6. Фонд оценочных средств по дисциплине Консультационный проект:****6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине**

Вид контроля	Форма контроля	Отметить нужное знаком « + »
Текущий контроль	Оценка докладов	+

	Устный/письменный опрос	-
	Тестирование	+
	Практические задачи	-
	Оценка контрольных работ (для заочной формы обучения)	-
Промежуточный контроль	Зачет	+

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования, утвержденными Ученым советом ФГАОУ ВО СГЭУ, протокол № 16 от 20.05.2021; Положением о балльно-рейтинговой системе оценки успеваемости обучающихся по основным образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры в федеральном государственном автономном образовательном учреждении высшего образования «Самарский государственный экономический университет», утвержденным Ученым советом ФГАОУ ВО СГЭУ, протокол № 16 от 20.05.2021 г.

6.2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-1 - Способен, используя отечественные и зарубежные источники информации, в том числе информацию, содержащуюся в отчетности организаций - участников рынка ценных бумаг, осуществить мониторинг рынка банковских услуг, иностранной валюты, рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ПК-1.1 Знать	ПК-1.2 Уметь	ПК-1.3 Владеть (иметь навыки)
Пороговый	Структуру организации финансовых рынков	Сопоставлять различные индикаторы рынка для определения направлений их последующего движения	Методами и принципами анализа ситуации на финансовых рынках
Стандартный	Способы использования финансовых технологий в профессиональной деятельности	Способы использования имеющихся финансовых технологий	Методами применения финансовых инструментов и использования финансовых технологий в практической деятельности
Повышенный	Методики анализа функционирования рынков	Пользоваться программными продуктами для совершения операций с финансовыми инструментами	Практическими навыками определения экономической эффективности операций с различными финансовыми инструментами

ПК-2 - Способен на основе типовых методик осуществить расчет цен валюты, ценных бумаг, фондовых индексов и производных финансовых инструментов и совершать сделки с валютой, ценными бумагами и производными финансовыми инструментами

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ПК-2.1 Знать	ПК-2.2 Уметь	ПК-2.3 Владеть (иметь навыки)
Пороговый	нормативные акты регламентирующие правила построения отчетности компаний, являющихся участниками рынка ценных бумаг и правила анализа и интерпретации финансовой и, бухгалтерской информации	В теоретическом плане применять нормативные акты регламентирующие правила построения отчетности компаний, являющихся участниками рынка ценных бумаг и правила анализа и интерпретации финансовой и, бухгалтерской информации при решении учебных задач	В теоретическом плане практическими навыками применения в профессиональной деятельности нормативных актов, регламентирующих правила построения отчетности компаний, являющихся участниками рынка ценных бумаг и правилами анализа и интерпретации финансовой и, бухгалтерской информации
Стандартный	Правила применения нормативных актов регламентирующие правила построения отчетности компаний, являющихся участниками рынка ценных бумаг и правил анализа и интерпретации финансовой и, бухгалтерской информации в учебных заданиях	При решении учебных задач применять нормативные акты регламентирующие правила построения отчетности компаний, являющихся участниками рынка ценных бумаг и правила анализа и интерпретации финансовой и, бухгалтерской информации при решении учебных задач	При решении учебных задач практическими навыками применения в профессиональной деятельности нормативных актов, регламентирующих правила построения отчетности компаний, являющихся участниками рынка ценных бумаг и правилами анализа и интерпретации финансовой и, бухгалтерской информации
Повышенный	Приемы практического использования нормативных актов регламентирующих правила построения отчетности компаний, являющихся участниками рынка ценных бумаг и правил анализа и интерпретации финансовой и, бухгалтерской информации	При решении реальных проблем хозяйственной практики применять нормативные акты регламентирующие правила построения отчетности компаний, являющихся участниками рынка ценных бумаг и правила анализа и интерпретации финансовой и,	При решении вопросов хозяйственной практики практическими навыками применения в профессиональной деятельности нормативных актов, регламентирующих правила построения отчетности компаний, являющихся участниками рынка ценных бумаг и правилами анализа и

	информации	бухгалтерской информации при решении учебных задач	интерпретации финансовой и, бухгалтерской информации
--	------------	--	--

ПК-3 - Способен определить инвестиционный профиль участника рынка ценных бумаг, подобрать в соответствии с установленным профилем поставщиков финансовых услуг и проконсультировать по разному типу финансовых продуктов, обращающихся на банковском, валютном рынках и рынке ценных бумаг и производных финансовых инструментов

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ПК-3.1 Знать	ПК-3.2 Уметь	ПК-3.3 Владеть (иметь навыки)
Пороговый	Основы использования данных для выявления тенденций изменения финансовых показателей	Выявлять тенденции изменения финансовых показателей, строить прогнозы экономического развития участника фондового рынка	Навыками построения прогнозов изменений финансовых показателей с применением результатов анализа статистических данных
Стандартный	Методы анализа и интерпретации информации, содержащейся в отчетности участников фондового рынка	Анализировать и интерпретировать информацию, содержащуюся в отчетности участников фондового рынка	Навыками анализа, интерпретации экономических показателей содержащихся в отчетности участников фондового рынка
Повышенный	Способы применения результатов анализа и интерпретации отчетности о финансово-хозяйственной деятельности участников фондового рынка	Использовать полученные выводы в результате анализа информации, содержащейся в отчетности участников фондового рынка, для принятия управленческих решений	Навыками принятия управленческих решений по итогам результатов анализа информации, содержащейся в отчетности участников фондового рынка

ПК-4 - Способен на основе действующей нормативно-правовой базы осуществить контроль за деятельностью управляющих компаний, вести внутренний учет сделок с ценными бумагами и производными финансовыми инструментами, составлять и вести реестры владельцев ценных бумаг и определять взаимные обязательства участников торгов

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ПК-4.1 Знать	ПК-4.2 Уметь	ПК-4.3 Владеть (иметь навыки)
Пороговый	Источники информации о	Собирать, необходимую	Навыками сбора необходимых данных,

	состоянии рынка банковских услуг иностранной валюты, рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов, навыками поиска необходимой информации и проведения сравнительного анализа экономического состояния рынка банковских услуг иностранной валюты, рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов	информацию, содержащуюся в различных формах отчетности и прочих отечественных и зарубежных источниках, использовать источники экономической, социальной, управленческой информации. Представлять результаты аналитической и исследовательской работы в виде, информационного обзора.	содержащейся в различных отечественных и зарубежных источниках о состоянии рынка банковских услуг иностранной валюты, рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов
Стандартный	Источники информации о состоянии рынка банковских услуг иностранной валюты, рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов, процедуру системного анализа, навыками поиска необходимой информации и проведения сравнительного анализа экономического состояния рынка банковских услуг иностранной валюты, рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов	Собирать, анализировать необходимую информацию, содержащуюся в различных формах отчетности и прочих отечественных и зарубежных источниках, выделить внешние и внутренние факторы системы, использовать источники экономической, социальной, управленческой информации. представлять результаты аналитической и исследовательской работы в виде информационного обзора, аналитического отчета	Навыками сбора и обработки необходимых данных, содержащейся в различных отечественных и зарубежных источниках о состоянии рынка банковских услуг иностранной валюты, рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов
Повышенный	Методологические	Собирать,	Навыками сбора и

	<p>основы системного анализа, процедуру системного анализа, навыками поиска необходимой информации и проведения сравнительного анализа экономического состояния рынка банковских услуг иностранной валюты, рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов</p>	<p>анализировать и интерпретировать необходимую информацию, содержащуюся в различных формах отчетности и прочих отечественных и зарубежных источниках, выделить внешние и внутренние факторы системы, проводить качественный анализ результатов прогноза, использовать источники экономической, социальной, управленческой информации. представлять результаты аналитической и исследовательской работы в виде выступления информационного обзора, аналитического отчета</p>	<p>обработки необходимых данных, навыками анализа и интерпретации информации, содержащейся в различных отечественных и зарубежных источниках о состоянии рынка банковских услуг иностранной валюты, рынка ценных бумаг и производных финансовых инструментов</p>
--	---	--	--

6.3. Паспорт оценочных материалов

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контролируемые планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по программе	Вид контроля/используемые оценочные средства	
			Текущий	Промежуточный
1.	Функционирование финансового рынка и финансовых институтов	ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3, ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3	Оценка докладов Тестирование	Зачет

2.	Фундаментальный анализ эмитентов и активов	ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3, ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3	Оценка докладов Тестирование	Зачет
3.	Корпоративное управление и хозяйственная деятельность корпораций	ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3, ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3	Оценка докладов Тестирование	Зачет
4.	Портфельное инвестирование и управление портфелем	ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК2.1, ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3, ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3	Оценка докладов Тестирование	Зачет

6.4.Оценочные материалы для текущего контроля

Примерная тематика докладов

Раздел дисциплины	Темы
Функционирование финансового рынка и финансовых институтов	<ol style="list-style-type: none"> 1. Глобальный процесс секьюритизации финансовых рынков 2. Виды торговли ценными бумагами 3. Фундаментальные свойства государственных облигаций 4. Эмитенты государственных ценных бумаг 5. Функции ЦБ РФ как агента рынка государственных ценных бумаг 6. Эмиссия и обращение государственных ценных бумаг 7. ГКО и ОФЗ как основные облигации государственного займа 8. Государственный долг и его виды 9. Дефицит государственного бюджета и методы его покрытия 10. Инфраструктура рынка государственных ценных бумаг 11. Национальный расчетный депозитарий и его функции 12. Функции расчетной системы 13. Аукционы по первичному размещению облигаций 14. Конкурентные и неконкурентные заявки на покупку ценных бумаг
Фундаментальный анализ эмитентов и активов	<ol style="list-style-type: none"> 1) Понятие и элементы информационной инфраструктуры рынка ценных бумаг. 2) Структура биржевой информации. 3) Информация внебиржевых систем торговли ценными бумагами. 4) Методика расчета российских фондовых индексов. 5) Служебная (инсайдерская) информация и методы борьбы с ее использованием в международной и российской практике. Неформальная информация. 6) Фундаментальный анализ и его роль в принятии инвестиционных решений. 7) Цели и инструменты фундаментального анализа. 8) Фундаментальный анализ российского региона (на примере отдельного региона). 9) Инвестиционная привлекательность отрасли (на примере отдельной отрасли в России).

	<p>10) Оценка финансово-экономического положения эмитента и ее влияние на динамику курса ценных бумаг.</p> <p>11) Инвестиционная привлекательность предприятия (на примере крупнейших российских эмитентов).</p> <p>12) Особенности фундаментального анализа коммерческого банка.</p> <p>13) Дивидендная доходность по акциям российских компаний.</p> <p>14) Методы оценки стоимости ценных бумаг.</p> <p>15) Рыночная стоимость ценной бумаги и факторы, на нее влияющие.</p> <p>16) Рейтинг облигаций российских эмитентов: процесс присвоения, взаимодействие эмитентов с международными и российскими рейтинговыми агентствами.</p> <p>17) Российский долговой рынок: структура, доходность, проблемы и перспективы развития.</p>
<p>Корпоративное управление и хозяйственная деятельность корпораций</p>	<p>1) Креативные корпорации.</p> <p>2) Проблемы функционирования корпораций в России</p> <p>3) Дискуссии о положительной и отрицательной роли корпораций в современной экономике</p> <p>4) Формирование уставного капитала в зарубежных АО.</p> <p>5) Проблемы содержания устава АО.</p> <p>6) Регистрация АО в зарубежных правопорядках.</p> <p>7) Акционерные соглашения за рубежом и в России</p> <p>8) Виды ценных бумаг, обращающихся на территории РФ.</p> <p>9) Развитие рынка акций в России в современных условиях.</p> <p>10) Рынок акций, его место в системе рыночных отношений</p> <p>11) Мировой рынок акций.</p> <p>12) Проблемы реализации прав акционеров в России.</p> <p>13) Мировая практика реализации прав акционеров.</p> <p>14) Проблемы прав акционеров (мировая и российская практика)</p> <p>15) Мировой опыт управления корпорациями.</p> <p>16) Основные принципы управления корпорациями в России.</p> <p>17) Сравнительная характеристика двух основных базовых моделей рынка ценных бумаг.</p> <p>18) Отличия модели корпоративного управления России от зарубежных корпораций.</p> <p>19) Факторы, влияющие на общее собрание.</p> <p>20) Мировая практика проведения общих собраний.</p> <p>21) Практика и проблемы проведения общих собраний акционеров в России</p> <p>22) Проблема профессионализации деятельности совета директоров.</p> <p>23) Мировая практика деятельности советов директоров.</p> <p>24) Практика и проблемы деятельности советов директоров в современных российских условиях.</p> <p>25) Мировая практика деятельности исполнительных органов акционерного общества.</p>
<p>Портфельное инвестирование и управление портфелем</p>	<p>1) Необходимость и сущность портфельного инвестирования.</p> <p>2) Общие принципы построения инвестиционных портфелей.</p> <p>3) Механизм портфельного инвестирования.</p> <p>4) Субъекты портфельного инвестирования.</p> <p>5) Объекты портфельного инвестирования.</p>

	6) Правовое регулирование портфельного инвестирования. 7) Регуляторы рынка портфельного инвестирования 8) Пассивные и активные стратегии управления портфелем. 9) Пассивные стратегии управления портфелем. Активные стратегии управления портфелем. 10) Механические стратегии по размещению средств по классам активов. 11) Стратегия постоянной пропорции между классами активов. 12) Стратегия диапазона. 13) Стратегии плавающей пропорции. 14) Стратегии страхования портфеля.
--	--

Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций (min 20, max 50 + ссылку на ЭИОС с тестами)

<https://lms2.sseu.ru/course/index.php?categoryid=514>

Целью проведения фундаментального анализа ценных бумаг не является:

- определение внутренней (справедливой) стоимости ценных бумаг
- определение величины недооценки или переоценки ценных бумаг рынком
- принятие инвестором торгового решения
- покупка на основе индикаторов технического анализа

Фундаментальный анализ ценных бумаг не включает:

- общеэкономический (макроэкономический) анализ
- отраслевой анализ
- анализ компаний - эмитентов ценных бумаг
- психологический анализ

Оценка стоимости компании не может осуществляться посредством:

- затратного метода
- сравнительного метода
- доходного метода
- метода экстраполяции

Анализ финансовой устойчивости компании не позволяет оценить:

- степень зависимости компании от ее финансовых обязательств
- интенсивность использования компанией заемных средств
- эффективность использования компанией заемных средств
- геополитические риски

Стоимость акции компании будет больше, если:

- ниже будут ожидаемые темпы роста
- +выше будут ожидаемые темпы роста
- ниже будет требуемая норма доходности
- +больше будут ожидаемые дивиденды

Наиболее распространенная стратегия использования фундаментального и технического анализа состоит в том, чтобы использовать:

- фундаментальный анализ для выбора бумаг, а технический анализ для выбора момента покупки (продажи)
- только один вид анализа
- для одних бумаг технический анализ, а для других - фундаментальный анализ
- не использовать анализ для определения точек входа в рынок

Что является предметом изучения в техническом анализе?

- конфиденциальная информация о деятельности компании
- временные ряды цен сделок и объемов торгов
- показатели доходности финансовых инструментов
- психология участников рынка

Если технический и фундаментальный анализ противоречат друг другу, на какой лучше опираться при принятии решений?

- на фундаментальный, он всегда первичен
- на технический, он всегда первичен
- таких ситуаций не бывает
- надо определить вес каждого из методов анализа в данной ситуации

Какой анализ основывается на оценке показателей эмитента ценных бумаг:

- технический
- статистический
- фундаментальный
- экономический

Какой анализ основывается на оценке цен и объемов торгов ценных бумаг:

- технический
- статистический
- фундаментальный
- экономический

Какой показатель может служить основанием для покупки акции данной компании при сравнении ее текущих показателей с соответствующими значениями в прошлом?

- +относительно более высокая дивидендная доходность акций
- относительно меньший темп роста дивиденда
- относительно более высокое значение коэффициента p/e
- относительно меньшая рентабельность собственного капитала

Каким кредитным рейтингом должны обладать облигации "инвестиционного качества"?

- не ниже А
- BBB- и выше
- не ниже BB
- ССС и выше

Что можно оценить с помощью показателя дюрации?

- чувствительность цены облигации к изменению процентной ставки
- изменение цены облигации при приближении срока погашения
- чувствительность доходности облигации к изменению ставки купонного дохода
- изменение доходности облигации при приближении срока погашения

Что из нижеперечисленного служит наилучшим показателем ликвидности акций?

- номинал акций
- объем торгов по акциям за день
- количество акций в обращении
- рыночная капитализация компании

Чем определяется спрэд доходности эмитента по отношению к первоклассным бумагам?

- доходностью облигаций эмитента
- информационной прозрачностью эмитента
- чувствительностью цены облигаций к изменению процентной ставки на рынке
- риском невыплаты процентов и/или основной суммы долга

Какие ключевые параметры не используются в фундаментальном анализе для сравнения и отбора

ценных бумаг?

- EPS
- P/E
- P/B
- FCF

Какие ключевые параметры не используются в фундаментальном анализе для сравнения и отбора ценных бумаг?

- P/B;
- текущая цена акции;
- P/S
- FCF

Какие ключевые показатели из перечисленных ниже используются в фундаментальном анализе?

- +стоимость чистых активов
- объем торговли за период
- индекс относительной силы

Какие ключевые показатели из перечисленных ниже не используются в фундаментальном анализе?

- доход на акцию
- стоимость чистых активов
- EPS
- индекс относительной силы

Наиболее распространенная стратегия использования фундаментального и технического анализа состоит в том, чтобы использовать:

- фундаментальный анализ для выбора бумаг
- фундаментальный анализ для выбора момента покупки (продажи)
- технический анализ для выбора бумаг
- для одних бумаг технический анализ, а для других - фундаментальный анализ

Наиболее распространенная стратегия использования технического и фундаментального анализа состоит в том, чтобы использовать:

- технический анализ для выбора момента покупки (продажи)
- фундаментальный анализ для выбора момента покупки (продажи)
- только один вид анализа
- для одних бумаг технический анализ, а для других - фундаментальный анализ

Рентабельность собственного капитала рассчитывается как деление:

- чистой прибыли на совокупные активы
- чистой прибыли на собственный капитал
- чистой прибыли на выручку
- общей задолженности на совокупные активы

Рентабельность активов рассчитывается как деление:

- чистой прибыли на совокупные активы
- чистой прибыли на собственный капитал
- чистой прибыли на выручку
- общей задолженности на совокупные активы

Рентабельность продаж рассчитывается как деление:

- чистой прибыли на совокупные активы
- чистой прибыли на собственный капитал
- чистой прибыли на выручку
- общей задолженности на совокупные активы

Коэффициент абсолютной ликвидности рассчитывается как деление:

- денежные средства и краткосрочные финансовые вложения на краткосрочные обязательства
- оборотные активы за минусом запасов на краткосрочные обязательства
- текущие активы на текущие обязательства
- собственные оборотные средства на собственный капитал

Коэффициент срочной ликвидности рассчитывается как деление:

- денежные средства и краткосрочные финансовые вложения на краткосрочные обязательства
- оборотные активы за минусом запасов на краткосрочные обязательства
- текущие активы на текущие обязательства
- собственные оборотные средства на собственный капитал

Коэффициент текущей ликвидности рассчитывается как деление:

- денежные средства и краткосрочные финансовые вложения на краткосрочные обязательства
- оборотные активы за минусом запасов на краткосрочные обязательства
- текущие активы на текущие обязательства
- собственные оборотные средства на собственный капитал

Коэффициент маневренности капитала рассчитывается как деление:

- денежные средства и краткосрочные финансовые вложения на краткосрочные обязательства
- оборотные активы за минусом запасов на краткосрочные обязательства
- текущие активы на текущие обязательства
- собственные оборотные средства на собственный капитал

Примерами темпа роста, истощающего финансовые ресурсы компании, являются:

- поставщики продолжают отгружать сырье и материалы с отсрочкой платежа
- банки предоставляют кредит на обычных условиях,
- акционеры принимают решения о реинвестировании прибыли
- ничего из вышеперечисленного

6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме зачета

Раздел дисциплины	Вопросы
Функционирование финансового рынка и финансовых институтов	<ol style="list-style-type: none">1. Охарактеризуйте суть финансового посредничества.2. В чем отличие коммерческих банков от других финансовых посредников на рынке?3. Назовите элементы кредитной системы.4. Каковы функции коммерческих банков?5. В чем отличие специализированных финансовых институтов от коммерческих банков?6. Какие функции выполняет Центральный банк?7. Какие инструменты используются Центральным банком для проведения денежно-кредитной политики?8. Охарактеризуйте основные тенденции развития современной банковской системы.9. В чем особенности баланса банка по сравнению с балансом предприятия?10. Охарактеризуйте структуру активов и пассивов баланса банка.11. Какую роль в работе банка играет финансовый рычаг?12. Охарактеризуйте состав и источники формирования доходов и расходов банка.13. Какие показатели применяются для определения

	<p>прибыльности банка?</p> <p>14. Охарактеризуйте модель ROE и ее основные компоненты.</p> <p>15. Как рассчитываются показатели чистой процентной маржи и спреда прибыли?</p> <p>Какие виды рисков в банковском деле вы знаете?</p> <p>17. Что такое ликвидность? Каковы ее роль и функции?</p> <p>18. Назовите виды ликвидных активов и обязательств.</p> <p>19. Перечислите факторы спроса на ликвидные средства и методы обеспечения ликвидности</p> <p>20. Какие способы измерения и нормативы ликвидности банка вам известны?</p> <p>21. Охарактеризуйте структуру банковских пассивов, привлеченных и собственных средств банка.</p> <p>22. Какие виды депозитных операций вам известны?</p> <p>23. Какова роль недепозитных источников ресурсов в управлении пассивами?</p> <p>24. Охарактеризуйте структуру и функции капитала банка. Как рассчитываются показатели достаточности капитала банка?</p> <p>25. В чем суть политики управления активами и пассивами банка?</p> <p>26. Каковы цели кредитной политики банка? Охарактеризуйте основные положения о кредитной политике банка.</p> <p>27. Какие виды банковских ссуд вам известны?</p> <p>28. Охарактеризуйте методику анализа кредитоспособности потенциального заемщика (источники сведений, методы оценки кредитного риска).</p> <p>29. Какие стратегии управления ликвидностью вы знаете? Охарактеризуйте основные из них.</p> <p>30. Назовите основные параметры GAP-модели, которая используется при управлении процентным риском.</p>
<p>Фундаментальный анализ эмитентов и активов</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. Основные подходы к изучению динамики фондового рынка: основные принципы, области применения. 2. Сравнительная характеристика технического и фундаментального анализа. 3. Теория эффективности рынка. Информационная и операционная эффективность рынка. Формы эффективности 4. Гипотеза "свободного блуждания", ее связь с теорией эффективности рынка, с техническим и фундаментальным анализом. 5. Теория рефлексивности Дж. Сороса. 6. Психологический анализ рынка. 7. Биржевые индексы. 8. Влияние информации на рыночную котировку акций. 9. Понятие фундаментального анализа. 10. Методы, области применения фундаментального анализа. 11. Процесс фундаментального анализа: экономический, отраслевой анализ и анализ предприятия. 12. Рыночный анализ активов. 13. Альфа- и бета-коэффициенты. 14. Показатели оценки инвестиционной привлекательности акций. 15. Показатели оценки стоимости компании. 16. Показатели рентабельности компании. 17. Показатели финансовой устойчивости компании. 18. Показатели темпов роста компании. 19. Анализ отчета о прибылях и убытках компании. 20. Анализ отчета о движении денежных средств компании. 21. Анализ статей балансового отчета компании. 22. Индексы акций. 23. Налогообложение операций с акциями.

	<p>24. Фундаментальный анализ облигаций. 25. Факторы, влияющие на курсовую стоимость облигаций. 26. Определение курсовой стоимости и доходности облигаций. 27. Рейтинг облигаций. 28. Рейтинговые агентства. 29. Этапы рейтинговых процедур. 30. Индексы облигаций. 31. Налогообложение операций с облигациями. 32. Дюрация и иммунизация облигаций.</p>
<p>Корпоративное управление и хозяйственная деятельность корпораций</p>	<p>1. Понятие корпорации. Цели и задачи деятельности корпораций. 2. Роль корпораций в развитие экономики. Корпорации в мировой экономике. 3. Российские корпорации. Перспективы развития корпораций в России. 4. Проблемы учреждения акционерных обществ, формирования уставного капитала. 5. Проблемы государственной регистрации, реорганизации акционерных обществ, содержания устава АО. 6. Внутренние документы корпораций 7. Понятие корпоративного дела. Корпоративные отношения 8. Характеристика акций. Реквизиты акций. 9. Классификация и виды акций. Отличие акции от других ценных бумаг. 10. Стоимостная оценка акций, ее виды, курс акций. 11. Доходность акций, виды доходности акций. 12. Рынок акций, его место в системе рыночных отношений. Развитие и перспективы российского рынка акций. 13. Понятие и виды прав акционеров. 14. Общие обязанности акционеров. Специальные обязанности акционеров. Публичные обязанности акционеров. 15. Понятие корпоративного управления. Принципы управления акционерным обществом. 16. Российский кодекс корпоративного поведения. 17. Модели корпоративного управления северо-американская, германская и другие. 18. Характеристика российской модели корпоративного управления. 19. Компетенция общего собрания акционеров. Факторы, влияющие на общее собрание акционеров. 20. Подготовка к проведению общего собрания акционеров. Предложения в повестку дня общего собрания. 21. Информация о проведении общего собрания акционеров. Право голоса на общем собрании. 22. Проведение общего собрания акционеров. Протокол общего собрания акционеров. 23. Дивиденд. Порядок выплаты дивидендов. 24. Совет директоров или наблюдательный совет. Компетенция Совета директоров. 25. Избрание совета директоров. Проблема профессионализации деятельности Совета директоров. Права и обязанности членов совета директоров. 26. Организация деятельности совета директоров. Вознаграждение. Ответственность директоров. Признание недействительными решений совета директоров. 27. Компетенция исполнительного органа общества. Единоличный исполнительный орган. Коллегиальный исполнительный орган. Управляющая компания (управляющий). 28. Права и обязанности лица, занимающего должность (осуществляющего функции) единоличного исполнительного органа. Права и обязанности членов коллегиального исполнительного органа. 29. Ответственность лица, занимающего должность единоличного исполнительного органа, членов коллегиального исполнительного</p>

	<p>органа.</p> <p>30. Необходимость деятельности корпоративного секретаря. Порядок назначения (избрания) и функции корпоративного секретаря.</p> <p>31. Корпорация как хозяйственный агент. Хозяйственные цели и задачи деятельности корпораций.</p> <p>32. Роль корпораций в осуществление научно – технического прогресса.</p> <p>33. Доводы за и против господства корпораций в экономике.</p> <p>34. Эффективность корпораций.</p> <p>35. Хозяйственные показатели деятельности корпораций.</p> <p>36. Сравнительная характеристика корпораций и других хозяйствующих субъектов.</p> <p>37. Понятие корпорации в зарубежном законодательстве.</p> <p>38. Становление и состояние российского корпоративного законодательства.</p> <p>39. Международные корпорации, транснациональные компании, их роль в глобальной экономике.</p> <p>40. Развитие и перспективы корпоративного дела в России.</p>
<p>Портфельное инвестирование и управление портфелем</p>	<p>1.Необходимость и сущность портфельного инвестирования.</p> <p>2.Общие принципы построения инвестиционных портфелей.</p> <p>3.Механизм портфельного инвестирования.</p> <p>4.Субъекты портфельного инвестирования.</p> <p>5.Объекты портфельного инвестирования.</p> <p>6.Правовое регулирование портфельного инвестирования.</p> <p>7.Регуляторы рынка портфельного инвестирования</p> <p>8.Ожидаемая доходность актива.</p> <p>9.Ожидаемый риск портфеля.</p> <p>10. Риск портфеля, состоящего из нескольких активов.</p> <p>11. Доминирующий портфель.</p> <p>12.Эффективный набор портфелей.</p> <p>13.Портфель, состоящий из актива без риска и рискованного актива.</p> <p>14. кредитный и заемный портфели.</p> <p>15.Эффективная граница портфелей, состоящих из актива без риска и рискованного актива.</p> <p>16. Рыночный портфель.</p> <p>17. Модель оценки стоимости активов (САРМ).</p> <p>18.Модель У. Шарпа.</p> <p>19.Определение набора эффективных портфелей.</p> <p>20.Прогнозирование величины Бета.</p> <p>21. Арбитражная модель Росса.</p> <p>22.Определение эффективной границы с помощью кривых изосредних и изодисперсий.</p> <p>23.Определение эффективной границы Марковица методом множителей Лагранжа.</p> <p>24.Определение рыночного портфеля при возможности заимствования и кредитования.</p> <p>25.Определение оптимального портфеля с помощью линейного программирования.</p> <p>26.Пассивные и активные стратегии управления портфелем.</p> <p>27. Пассивные стратегии управления портфелем. Активные стратегии управления портфелем.</p> <p>28.Механические стратегии по размещению средств по классам активов.</p> <p>29.Стратегия постоянной пропорции между классами активов.</p> <p>30.Стратегия диапазона.</p> <p>31.Стратегии плавающей пропорции.</p> <p>32.Стратегии страхования портфеля.</p>

	<p>33. Функции полезности инвестора.</p> <p>34. Концепция полезности и аксиомы рационального выбора.</p> <p>35. Премия за риск Марковица.</p> <p>36. Кривая безразличия.</p> <p>37. Выбор оптимального портфеля.</p> <p>38. Максимизация количества стандартных отклонений между доходностью портфеля и целевым уровнем.</p> <p>39. Инвестиционный выбор на основе принципа стохастического доминирования.</p> <p>40. Эффект выбора среднего портфеля.</p> <p>41. Абсолютный и относительный VaR.</p>
--	---

6.6. Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

Шкала и критерии оценивания

Оценка	Критерии оценивания для мероприятий контроля с применением 2-х балльной системы
«зачтено»	ПК-1, ПК-2, ПК-3, ПК-4
«не зачтено»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне