

Документ подписан простой электронной подписью.
Информация о владельце:

ФИО: Кандрашина Елена Александровна

Должность: И.о. ректора ФГАОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 12.08.2025 11:06:46

Уникальный программный ключ:

2db64eb9605ce27edd3b8e8fdd32c70e0674ddd2

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 № 10 от 22 мая 2025 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Наименование дисциплины

Б1.О.43 Информационно-аналитические
системы на финансовых рынках

**Основная профессиональная
образовательная программа**

09.03.03 Прикладная информатика программа
Информационные системы на финансовых
рынках

Квалификация (степень) выпускника Бакалавр

Самара 2025

**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.О.43 Информационно-аналитические системы на финансовых рынках
Основная профессиональная образовательная программа	09.03.03 Прикладная информатика программа Информационные системы на финансовых рынках

**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 № 10 от 22 мая 2025 г.)

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ
ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ**

Наименование дисциплины	Б1.О.43 Информационно-аналитические системы на финансовых рынках
Основная профессиональная образовательная программа	09.03.03 Прикладная информатика программа Информационные системы на финансовых рынках

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 Информационно-аналитические системы на финансовых рынках входит в обязательную часть блока Б1.Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Проектный практикум, Финансовый инжиниринг, Цифровая трансформация денежного обращения, Организация и регулирование финансового рынка, Организационные торговые системы, Цифровизация финансового рынка и развитие платежной инфраструктуры

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

Изучение дисциплины Информационно-аналитические системы на финансовых рынках в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Общепрофессиональные компетенции (ОПК):

ОПК-9 - Способен принимать участие в реализации профессиональных коммуникаций с заинтересованными участниками проектной деятельности и в рамках проектных групп

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ОПК-9	ОПК-9.1: Знать:	ОПК-9.2: Уметь:	ОПК-9.3: Владеть (иметь навыки):
	особенности реализации профессиональных коммуникаций с заинтересованными участниками проектной деятельности и в рамках проектных групп	реализовывать профессиональных коммуникаций с заинтересованными участниками проектной деятельности и в рамках проектных групп	навыками реализации профессиональных коммуникаций с заинтересованными участниками проектной деятельности и в рамках проектных групп

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-4 - Способен осуществлять подготовку к реализации комплексных проектов в области инновационных финансовых технологий и их административное сопровождение

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):
	механизм реализации инновационных финансовых технологий	осуществлять подготовку к реализации комплексных проектов в области инновационных финансовых технологий	навыками административного обеспечения управления проектами в области инновационных финансовых технологий

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 8
Контактная работа, в том числе:	36.15/1
Занятия лекционного типа	18/0.5
Занятия семинарского типа	18/0.5
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.15/0
Самостоятельная работа:	17.85/0.5
Промежуточная аттестация	18/0.5
Вид промежуточной аттестации:	
Зачет	Зач
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	72
Зачетные единицы	2

4. Содержание дисциплины

4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Информационно-аналитические системы на финансовых рынках 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.	Организованные торговые системы: понятие, регулирование, параметры	8	8			7,85	ОПК-9.1, ОПК-9.2, ОПК-9.3, ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3
2.	Виды организованных торговых систем по обращающимся активам	10	10			10	ОПК-9.1, ОПК-9.2, ОПК-9.3, ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3
	Контроль	18					
	Итого	18	18	0.15		17.85	

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.	Организованные торговые системы: понятие, регулирование, параметры	лекция	Технологические принципы построения организованных торговых систем на финансовых рынках
		лекция	Организация исполнения сделок на финансовом рынке. Основные этапы проведения сделок с ценными бумагами

			организатором торгов
		лекция	Технологические и институциональные принципы построения международного организованного финансового рынка
		лекция	Анализ динамики параметров, характеризующих организованную торговлю на финансовых рынках
2.	Виды организованных торговых систем по обращающимся активам	лекция	Принципы функционирования организованных торговых систем рынка корпоративных ценных бумаг
		лекция	Принципы функционирования организованных торговых систем рынка государственных федеральных ценных бумаг
		лекция	Принципы функционирования организованных торговых систем срочного рынка: система FORTS
		лекция	Особенности функционирования организованных торговых систем валютного рынка. Биржевой валютный дилинг
		лекция	Аналитическая информация на международном организованном финансовом рынке

*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.	Организованные торговые системы: понятие, регулирование, параметры	практическое занятие	Технологические принципы построения организованных торговых систем на финансовых рынках: функции системы заключения сделок, клиринговой и расчетной систем
		практическое занятие	Инфраструктурные организации, обеспечивающие торговлю на финансовом рынке, их взаимодействие. Участники торговых систем и организация доступа к участию в торгах
		практическое занятие	Организация исполнения сделок на финансовом рынке: технологии клиринга по сделкам в организованных торговых системах
		практическое занятие	Основные этапы проведения сделок с ценными бумагами организатором торгов: организация денежных расчетов и поставки по результатам сделки
2.	Виды организованных торговых систем по обращающимся активам	практическое занятие	Технологические принципы построения международного организованного финансового рынка: особенности международного брокеринга, дилинга, клиринга и

			расчетов
		практическое занятие	Особенности аукционов по размещению государственных федеральных и субфедеральных обязательств через организатора торговли на примере MoEx
		практическое занятие	Система FORTS MoEx: требования к участникам, типы срочных контрактов и, их спецификации, порядок расчета гарантийного обеспечения, особенности проведения клиентских сделок
		практическое занятие	Раскрытие информации на международном организованном финансовом рынке
		практическое занятие	Аналитические и информационные материалы на международном организованном финансовом рынке на примере WFE (World Federation of Exchanges)

** 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.	Организованные торговые системы: понятие, регулирование, параметры	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование
2.	Виды организованных торговых систем по обращающимся активам	- 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. Лукасевич, И. Я. Финансовый менеджмент: учебник и практикум для вузов / И. Я. Лукасевич. — 4-е изд., перераб. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2024. — 680 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16271-4. — Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/544902>

2. Международный финансовый рынок: учебник и практикум для вузов / М. А. Эскиндаров [и др.]; под общей редакцией М. А. Эскиндарова, Е. А. Звоновой. — Москва: Издательство Юрайт, 2024. — 430 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16871-6. — Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/531937>

Дополнительная литература

1. Лукасевич, И. Я. Финансовая политика: учебник и практикум для вузов / И. Я. Лукасевич. — 4-е изд., перераб. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2024. — 208 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-19229-2. — Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/556169>
2. Международный финансовый рынок: учебник и практикум для вузов / М. А. Эскиндаров [и др.]; под общей редакцией М. А. Эскиндарова, Е. А. Звоновой. — Москва: Издательство Юрайт, 2024. — 430 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16871-6. — Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/531937>
3. Мировые финансы: структура и анализ мировых рынков: учебник и практикум для вузов / М. А. Эскиндаров [и др.]; под общей редакцией М. А. Эскиндарова, Е. А. Звоновой. — Москва: Издательство Юрайт, 2024. — 409 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-17687-2. — Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/537555>

Литература для самостоятельного изучения

1. Иванилова, С. В. Биржевое дело : учебное пособие для бакалавров / С. В. Иванилова. — 3-е изд. — Москва: Дашков и К, Ай Пи Эр Медиа, 2021. — 222 с. — ISBN 978-5-394-04355-0. — Текст: электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS: [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/102271.html>
2. Дегтярева, О. И. Биржевое дело: учебник. — 2-е изд., перераб. и доп. / О. И. Дегтярева. — Москва: Магистр: ИНФРА-М, 2021. — 528 с. - ISBN 978-5-9776-0470-3. - Текст: электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1192237>
3. 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>
4. Петерс Э.ХАОС И ПОРЯДОК НА РЫНКАХ КАПИТАЛА. Новый аналитический взгляд на циклы, цены и изменчивость рынка: Пер. с англ. 2000. — 336 с. ISBN 5-03-003356-4.
5. Халл Джон К. Опционы, фьючерсы и другие производные финансовые инструменты. 6-е издание: Пер. с англ. — М.: ООО “И. Д. Вильямс”. 2007. — 1056 с. ISBN 978-5-8459-1205-3 (рус.)

5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения

1. Astra Linux Special Edition «Смоленск», «Орел»; РедОС ; ОС "Альт Рабочая станция" 10; ОС "Альт Образование" 10
2. МойОфис Стандартный 2, МойОфис Образование, Р7-Офис Профессиональный, МойОфис Стандартный 3, МойОфис Профессиональный 3

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. Государственная система правовой информации «Официальный интернет-портал правовой информации» (<http://pravo.gov.ru/>)
3. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/ru/>)
4. 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»

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 Информационно-аналитические системы на финансовых рынках:

6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

Вид контроля	Форма контроля	Отметить нужное знаком « + »
Текущий контроль	Оценка докладов	+
	Устный/письменный опрос	+
	Тестирование	+
	Практические задачи	+
Промежуточный контроль	Зачет	+

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования; 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».

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

Общепрофессиональные компетенции (ОПК):

ОПК-9 - Способен принимать участие в реализации профессиональных коммуникаций с заинтересованными участниками проектной деятельности и в рамках проектных групп

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ОПК-9.1: Знать:	ОПК-9.2: Уметь:	ОПК-9.3: Владеть (иметь навыки):
	особенности реализации профессиональных коммуникаций с заинтересованными участниками проектной деятельности и в рамках проектных групп	реализовывать профессиональных коммуникаций с заинтересованными участниками проектной деятельности и в рамках проектных групп	навыками реализации профессиональных коммуникаций с заинтересованными участниками проектной деятельности и в рамках проектных групп
Пороговый	инструменты и методы профессиональных коммуникаций в проектной деятельности	применять информационно-технические средства групповых профессиональных коммуникаций для проведения презентаций и подготовки демонстрационного материала.	навыками реализации профессиональных коммуникаций при проведении презентаций, переговоров, публичных выступлений
Стандартный (в дополнение к пороговому)	каналы и модели профессиональных коммуникаций в рамках проектных групп	использовать методы логического анализа и объективной аргументации с заинтересованными участниками проектной деятельности при обсуждении проектов информационных экономических систем и технологий	навыками осуществлять взаимодействие с заказчиком в процессе реализации проектной деятельности; принимать участие в командообразовании и развитии персонала
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	технологии межличностной и групповой коммуникации в деловом взаимодействии, основы конфликтологии, технологии подготовки и проведения презентаций	формализовать и обобщить процесс профессиональных коммуникаций при разработке проекта в рамках проектной группы, руководствуясь требованиями заказчика и состоянием системы	навыками выбора, применения и адаптации методов командообразования в рамках проектных групп для решения задач в профессиональной деятельности с использованием финтех

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-4 - Способен осуществлять подготовку к реализации комплексных проектов в области инновационных финансовых технологий и их административное сопровождение

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ПК-4.1: Знать:	ПК-4.2: Уметь:	ПК-4.3: Владеть (иметь навыки):
	механизм реализации инновационных финансовых технологий	осуществлять подготовку к реализации комплексных проектов в области инновационных финансовых технологий	навыками административного обеспечения управления проектами в области инновационных финансовых технологий
Пороговый	базовые инновационные финансовые технологии и простые методы управления простыми проектами в области ИФТ	осуществлять подготовку проектов области ИФТ на основе полученных планов в условиях, когда проект не выходит за пределы утвержденных параметров в рамках учебных задач	базовым практическим опытом подготовки и управления простыми проектами в области ИФТ на основе полученных планов проектов в условиях, когда проект не выходит за пределы утвержденных параметров в рамках учебных задач
Стандартный (в дополнение к пороговому)	большинство принципов и методов управления проектами среднего уровня сложности в области ИФТ на основе полученных планов проектов и их администрирования	управлять проектами среднего уровня сложности в области ИФТ на основе полученных планов проектов в условиях, когда проект не выходит за пределы утвержденных параметров	практическим опытом управления проектами среднего уровня сложности в области ИФТ на основе полученных планов проектов в условиях, когда проект не выходит за пределы утвержденных параметров
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	классические и современные принципы и методы управления сложными и масштабными проектами в области ИФТ на основе полученных планов проектов и принципы, результаты их администрирования	реализовывать и администрировать масштабные проекты, состоящие из нескольких модулей и компонентов в области ИФТ, когда проект не выходит за пределы утвержденных параметров	практическим опытом реализации и администрирования сложных масштабных проектов, состоящими из нескольких модулей и компонент в области ИФТ на основе полученных проектных планов

6.3. Паспорт оценочных материалов

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контролируемые планируемые результаты обучения в	Вид контроля/используемые оценочные средства	
			Текущий	Промежуточный

		соотношении с результатами обучения по программе		
1.	Организованные торговые системы: понятие, регулирование, параметры	ОПК-9.1, ОПК-9.2, ОПК-9.3, ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3	- доклад - устный/письменный опрос - тестирование	Зачет
2.	Виды организованных торговых систем по обращающимся активам	ОПК-9.1, ОПК-9.2, ОПК-9.3, ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3	- доклад - устный/письменный опрос - тестирование	Зачет

6.4.Оценочные материалы для текущего контроля

Примерная тематика докладов

Раздел дисциплины	Темы
Организованные торговые системы: понятие, регулирование, параметры	1. Роль информации и требования, предъявляемые к ней у организаторов торгов. 2. Специфика и классификация биржевых товаров в системе мировой организованной торговли. 3. Общественная структура и инфраструктура организатора торговли (на примере крупнейших мировых организаторов торговли). 4. Отличительные особенности сделок с форвардными и фьючерсными контрактами. 5. Спрэдовые операции маркет-мейкеров в рамках организованных торгов. 6. Три модуля торговой системы: метчинг, акцепт, отчетность. 7. Понятие и процедура фиксинга. 8. Хеджирование и биржевая спекуляция. 9. История развития биржевой торговли, ее тенденции в мировой и отечественной практике. 10. Современный биржевой рынок России: институты, специализация. 11. Роль биржевой торговли в современной мировой экономике. Крупнейшие международные биржевые центры. 12. Организация и регулирование деятельности российских организаторов торговли. 13. Государственное регулирование биржевой деятельности. Закон РФ «Об организованных торгах» № 325-ФЗ.
Виды организованных торговых систем по обращающимся активам	14. Порядок организации и лицензирования биржевой торговли. Учредители биржи и оформление документов на регистрацию. 15. Брокерская фирма и ее место в организованных торгах. 16. Роль расчетной палаты в организованных торгах. 17. Современная роль товарных и фьючерсных бирж в процессе ценообразования товарных активов. 18. Организация и техника торгов в России и за рубежом. 19. Виды поручений клиентов и условия покупки реального товара на бирже. 20. Основные функции фьючерсных бирж. Биржевые спекуляции. Характеристика участников фьючерсных торгов. 21. Механизм биржевой фьючерсной торговли. Методы ведения торгов. 22. Порядок определения цены контракта, его основные характеристики.

	23. Роль расчетной палаты, как гаранта выполнения сделок. Маржа во фьючерсной торговле. 24. Процедура национального и международного клиринга. 25. Операции с опционами на фьючерсных биржах (понятие и виды опционов, основные характеристики цены опциона, стратегии использования опционов). 26. Страхование рисков на рынке фьючерсных контрактов (концепция и практика хеджирования). 27. Основные фьючерсные и опционные рынки.
--	--

Вопросы для устного/письменного опроса

Раздел дисциплины	Вопросы
Организованные торговые системы: понятие, регулирование, параметры	1. Технологические принципы построения организованных торговых систем на финансовых рынках 2. Организация исполнения сделок на финансовом рынке. 3. Основные этапы проведения сделок с ценными бумагами организатором торгов 4. Технологические и институциональные принципы построения международного организованного финансового рынка 5. Анализ динамики параметров, характеризующих организованную торговлю на финансовых рынках 6. Принципы функционирования организованных торговых систем рынка корпоративных ценных бумаг 7. Принципы функционирования организованных торговых систем рынка государственных федеральных ценных бумаг 8. Принципы функционирования организованных торговых систем срочного рынка: система FORTS 9. Особенности функционирования организованных торговых систем срочного рынка 10. Система FORTS MoEx: требования к участникам, типы срочных контрактов и, их спецификации, порядок расчета гарантийного обеспечения, особенности проведения клиентских сделок 11. Особенности функционирования организованных торговых систем валютного рынка. 12. Биржевой валютный дилинг. 13. Особенности биржевого валютного дилинга: национальный и международный аспекты 14. Участники и условия проведения валютных операций через организатора торговли 15. Раскрытие информации на международном организованном финансовом рынке 16. Аналитическая информация на международном организованном финансовом рынке 17. Инфраструктурные организации, обеспечивающие торговлю на финансовом рынке, их взаимодействие. 18. Участники торговых систем и организация доступа к участию в торгах 19. Организация исполнения сделок на финансовом рынке: технологии клиринга по сделкам в организованных торговых системах 20. Основные этапы проведения сделок с ценными бумагами организатором торгов: организация денежных расчетов и поставки по результатам сделки
Виды организованных торговых систем по обращающимся активам	21. Технологические принципы построения международного организованного финансового рынка: особенности международного брокеринга, дилинга, клиринга и расчетов 22. Институциональные принципы построения международного

	организованного финансового рынка и его доминирующие тенденции 23. Биржевые индексы и биржевые средние: принципы расчета и применения на финансовых рынках в современных условиях 24. Информационное сопровождение организованной торговли на финансовых рынках: кредитные рейтинги и обзоры международных и национальных рейтинговых и аналитических агентств 25. Принципы функционирования организованных торговых систем рынка корпоративных ценных бумаг на примере фондовой секции МоЕх 26. Правила листинга и делистинга корпоративных ценных бумаг. Особенности формирования котировальных списков организаторов торгов 27. Особенности аукционов по размещению государственных федеральных и субфедеральных обязательств через организатора торговли на примере МоЕх 28. Особенности обращения государственных федеральных, субфедеральных обязательств через организатора торговли на примере МоЕх 29. Аналитические и информационные материалы на международном организованном финансовом рынке на примере WFE (World Federation of Exchanges)
--	--

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

укажите задания

Индекс РТС рассчитывается как:

- среднее арифметическое
- +среднее арифметическое взвешенное
- среднее геометрическое

При поступлении товара на склад организатора торговли не определяют:

- условия производства товара
- +соответствие качества товара биржевой цене
- +размеры естественной убыли товара

Укажите функцию, не относящуюся к функциям организатора торговли:

- разрешение споров по биржевым сделкам
- информационная деятельность
- разработка биржевых контрактов
- +нет правильного ответа

Метод торговли, предполагающий установление максимальной цены и последующее её снижение – это аукцион:

- +Голландский
- Английский
- Простой
- Двойной

Укажите верное утверждение относительно требований к организаторам торгов:

- минимальный размер собственных средств биржи должен составлять не менее 250 млн руб.
- +минимальный размер собственных средств торговой системы должен составлять не менее 50 млн руб.
- организатор торговли должен соблюдать нормативы ликвидности и оборачиваемости активов

-организатор торговли должен соблюдать нормативы обеспеченности собственными средствами и финансовой независимости (автономии)

Система «двойного посредничества» предполагает связь:

- +брокеров и дилеров
- двух брокеров
- двух дилеров
- одного брокера сразу с покупателем и продавцом

Делистинг может быть осуществлен, если эмитент:

- +объявлен банкротом
- +отказывается разглашать ежегодный отчет
- +решил уйти с биржевого рынка

Государственное регулирование биржевой торговли в РФ не предполагает:

- налогообложение биржи как юридического лица
- лицензирование биржи как организатора торговли
- +налогообложение страховых операций

Индекс Московской биржи рассчитывается как:

- среднее арифметическое
- +среднее арифметическое взвешенное
- среднее геометрическое взвешенное

Сделки своп относятся к классу:

- кассовых сделок
- сделок спот
- +форвардных сделок
- простых срочных сделок

Сделка, в которой плательщик премии уплачивает ее в двойном размере и выбирает между позицией покупателя и продавца:

- сложные
- кратные
- простые
- +нет правильного ответа

Срочные сделки на фондовой секции организатора торговли имеют срок исполнения:

- +T+90
- T+3
- T+360
- срок нормативно не ограничивается

«Пер ультимо» означает, что контракт ликвидируется:

- ровно через месяц
- в середине месяца
- +в конце месяца
- не связано со сроком ликвидации

Делистинг может быть осуществлен, если эмитент:

- объявлен банкротом
- отказывается разглашать ежегодный отчет
- решил уйти с биржевого рынка
- +все вышеперечисленное

Система «двойного посредничества» предполагает связь:

- +брокеров и дилеров

- двух брокеров
- двух дилеров
- одного брокера сразу с покупателем и продавцом

Какой из представленных видов торговли не относится к непрерывному аукциону:

- «книга заказов»
- + «выкрики»
- «табло»
- «толпа»

Процесс исключения ценных бумаг из котировальных листов организатора торговли:

- нейтинг
- листинг
- котирование
- +делистинг

Укажите функцию организатора торговли:

- фиксинг биржевых котировок
- посредничество в бартерных сделках
- +хеджирование участников биржевой торговли

Метод торговли, предполагающий одновременный прием заявок и последующий выбор самого высокого предложения – это аукцион:

- голландский
- английский
- +в темную
- простой

ФЗ «О валютном регулировании и валютном контроле» был принят:

- +в 1992 г.
- в 1994г.
- в 1996г.
- в 2004г.

Индекс РТС рассчитывается как:

- среднее арифметическое
- +среднее арифметическое взвешенное
- среднее геометрическое

При поступлении товара на биржевой склад не определяют:

- условия производства товара
- +соответствие качества товара биржевой цене
- +размеры естественной убыли товара

Уровень маржи для направления требования о внесении клиентом денежных средств или ценных бумаг, в размере, достаточном для увеличения уровня до ограничительного составляет:

- 25 %, если более высокий уровень не установлен в договоре с клиентом
- 35%
- +35 %, если более высокий уровень не установлен в договоре с клиентом
- 35 %, если более низкий уровень не установлен в договоре с клиентом

На момент направления брокером требования о внесении клиентом денежных средств или ценных бумаг в размере, достаточном для увеличения уровня до ограничительного уровня маржи, задолженность клиента перед брокером составляла 2000000 рублей и уровень маржи был равен 34,5 %. Определите величину обеспечения клиента.

- +2290076 руб.
- 2550076 руб.

-2770076 руб.
-2690000 руб.

Совокупный размер предоставленных брокеру кредитов составляет 5 млн рублей. Собственные средства брокера, рассчитанные в соответствии с установленной законодательством РФ о ценных бумагах методикой, составляют 25 млн рублей. Определите максимально возможную величину задолженности одного клиента перед брокером по маржинальным займам.

-7 млн. руб.
+7,5 млн. руб.
-8 млн. руб.
-8,5 млн. руб.

Назовите
основной
рыночный
индекс
Гонконгской
фондовой
биржи
-FTSE Small
Cap
-FTSE 100
-iShares ETF
+Hang Seng

6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме зачета

Раздел дисциплины	Вопросы
Организованные торговые системы: понятие, регулирование, параметры	1. Технологические принципы построения организованных торговых систем на финансовых рынках: функции системы заключения сделок, клиринговой и расчетной систем 2. Основные черты и этапы эволюции организованной торговли. 3. Инфраструктурные организации, обеспечивающие торговлю на финансовом рынке, их взаимодействие. Участники торговых систем и организация доступа к участию в торгах 4. Основные характерные черты биржевого товара. 5. Государственное регулирование и саморегулирование организаторов торговли. 6. Классы биржевых товаров, выделенные в мировой практике. 7. Основные черты, характеризующие валюту как биржевой товар. 8. Фондовые индексы: принципы построения, мировые и российские фондовые индексы. 9. Биржевые индексы и биржевые средние: принципы расчета и применения на финансовых рынках в современных условиях 10. Фундаментальный и технический анализ в биржевой торговле. 11. Понятие учредителя и члена биржи, их отличие. 12. Особенности членства на разных биржах. 13. Органы управления биржей, их формирование. 14. Основные группы участников торгов и их характеристика
Виды организованных торговых систем по обращающимся активам	15. Организация исполнения сделок на финансовом рынке: технологии клиринга по сделкам в организованных торговых системах 16. Основные этапы проведения сделок с ценными бумагами организатором торгов: организация денежных расчетов и поставки по результатам сделки 17. Виды сделок с реальным товаром.

	18. Виды сделок с валютой. 19. Виды сделок с ценными бумагами. 20. Понятие процедуры листинга и ее характеристика. 21. Биржевой торг и его характеристика. 22. Фондовое посредничество. 23. Понятие биржевой котировки. 24. Электронные торги: область применения, специфика проведения. 25. Клиринг и нейтинг. 26. Метод установления единого курса и его характеристика. 27. Торговля фьючерсными и опционными контрактами. 28. Технологические принципы построения международного организованного финансового рынка: особенности международного брокеринга, дилинга, клиринга и расчетов 29. Институциональные принципы построения международного организованного финансового рынка и его доминирующие тенденции 30. Информационное сопровождение организованной торговли на финансовых рынках: кредитные рейтинги и обзоры международных и национальных рейтинговых и аналитических агентств 31. Принципы функционирования организованных торговых систем рынка корпоративных ценных бумаг на примере фондовой секции MoEx 32. Правила листинга и делистинга корпоративных ценных бумаг. Особенности формирования котировальных списков организаторов торгов 33. Особенности аукционов по размещению федеральных и субфедеральных обязательств через организатора торговли на примере MoEx 34. Особенности обращения федеральных, субфедеральных обязательств через организатора торговли на примере MoEx 35. Особенности функционирования организованных торговых систем срочного рынка 36. Система FORTS MoEx: требования к участникам, типы срочных контрактов и, их спецификации. 37. Порядок расчета гарантийного обеспечения, особенности проведения клиентских сделок на секции FORTS 38. Особенности биржевого валютного дилинга: национальный и международный аспекты 39. Участники и условия проведения валютных операций через организатора торговли 40. Раскрытие информации на международном организованном финансовом рынке 41. Аналитические и информационные материалы на международном организованном финансовом рынке 42. Цифровизация организованной торговли в современных условиях
--	--

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»	ОПК-9, ПК-4
«не зачтено»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне