

Документ подписан простой электронной подписью.
Информация о владельце:

ФИО: Кандрашина Елена Александровна

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

Дата подписания: 23.07.2024 16:22:08

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 Финансов

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета

(протокол № 10 от 30 мая 2024 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

| | |
|--|--|
| Наименование дисциплины | Б1.В.ДЭ.03.01 Операции коммерческих банков на фондовом рынке |
| Основная профессиональная образовательная программа | 38.04.08 Финансы и кредит программа Банковский бизнес |

Квалификация (степень) выпускника магистр

Самара 2024

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

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

1. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Операции коммерческих банков на фондовом рынке входит в часть, формируемая участниками образовательных отношений (дисциплина по выбору) блока Б1. Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Управление проектной деятельностью в профессиональной сфере

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

Изучение дисциплины Операции коммерческих банков на фондовом рынке в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-3 - Способен планировать и прогнозировать факторы, влияющие на стоимость и доходность размещения кредитных ресурсов юридическим лицам

| Планируемые результаты обучения по программе | Планируемые результаты обучения по дисциплине | | |
|--|---|---|--|
| | ПК-3 | ПК-3.1: Знать: факторы, влияющие на стоимость и доходность размещения кредитных ресурсов юридическим лицам | ПК-3.2: Уметь: осуществлять планирование и прогнозирование факторов, влияющих на стоимость и доходность размещения кредитных ресурсов |

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 4 |
| Контактная работа, в том числе: | 12.15/0.34 |
| Занятия семинарского типа | 12/0.33 |
| Индивидуальная контактная работа (ИКР) | 0.15/0 |
| Самостоятельная работа: | 77.85/2.16 |
| Промежуточная аттестация | 18/0.5 |
| Вид промежуточной аттестации: | |
| Зачет | Зач |
| Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы | 108 |
| Зачетные единицы | 3 |

4. Содержание дисциплины

4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Операции коммерческих банков на фондовом рынке 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 |
|-------|---|---------------------------|-------------|-----|------------------------|--|
| | | Занятия семинарского типа | | ИКР | | |
| | | Практич. занятия | ГКР | | | |
| 1. | Фондовые операции коммерческих банков | 6 | | | 38.92 | ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3 |
| 2. | Инвестиционные операции коммерческих банков | 6 | | | 38.93 | ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3 |
| | Контроль | 18 | | | | |
| | Итого | 12 | 0.15 | | 77.85 | |

4.2 Содержание разделов и тем

4.2.1 Контактная работа

Тематика занятий семинарского типа

| №п/п | Наименование темы (раздела) дисциплины | Вид занятия семинарского типа** | Тематика занятия семинарского типа |
|------|---|---------------------------------|--|
| 1. | Фондовые операции коммерческих банков | практическое занятие | Деятельность коммерческих банков на фондовом рынке |
| | | практическое занятие | Коммерческий банк как посредник на фондовом рынке |
| 2. | Инвестиционные операции коммерческих банков | практическое занятие | Сущность и необходимость инвестиционных операций коммерческого банка |
| | | практическое занятие | Сущность и необходимость дополнительной эмиссии ценных бумаг коммерческим банком |

** 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. | Фондовые операции коммерческих банков | - подготовка доклада - подготовка эссе |
| 2. | Инвестиционные операции коммерческих банков | - подготовка обзора литературы - подготовка аналитической записки |

*** 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. Банки и банковское дело : учебник и практикум для вузов / под редакцией В. А. Боровковой. — 7-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 606 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16818-1. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/544957>
2. Тавасиев, А. М. Банковское дело : учебник для вузов / А. М. Тавасиев. — 4-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 546 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16642-2. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/543763>

Дополнительная литература

1. Пеганова, О. М. Банковское дело : учебник для вузов / О. М. Пеганова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 538 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-18112-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/536271>
2. Сазыкин, Б. В. Управление операционным риском в коммерческом банке / Б. В. Сазыкин. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 224 с. — (Профессиональная практика). — ISBN 978-5-534-12030-1. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/516639>
3. Михайленко, М. Н. Финансовые рынки и институты : учебник для вузов / М. Н. Михайленко. — 3-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 351 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16945-4. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/535885>

Литература для самостоятельного изучения

1. Абрамова М. А. Финансовые и денежно-кредитные методы регулирования экономики. Теория и практика : учебник для магистров / М. А. Абрамова, Е. В. Маркина, Л. И. Гончаренко; отв. ред. М. А. Абрамова, Л. И. Гончаренко, Е. В. Маркина. — М. : Издательство Юрайт, 2015. — 551 с. — (Магистр). — ISBN 978-5-9916-3591-2.
2. Андреев, О.С. Формирование системы управления качеством банковских услуг [Текст] : монография / О. С. Андреев, А. А. Просветова. - М. : Дело, 2012. - 188 с. ; 60x90/16. - 1000 экз. - Библиогр.: с. 134-138. - Прил.: с. 139-185. - ISBN 978-5-7749-0725-6
3. Бабелюк Е. А., Васькова Е. П., Килинкарлова Е. В., Кустова М. В., Мацнева Н. Г., Ногина О. А., Шевелева Н. А. [Финансовое право: учебное пособие. — Санкт-Петербург: Питер 2014 г.— 320 с. — Электронное издание. — ISBN 978-5-496-01076-4](http://ibooks.ru/reading.php?productid=340201)
4. Банковское дело [Текст] : Учебник / Лаврушин О.И. - 10-е изд. перераб. и доп., УМО. - М. : КНОРУС, 2013. - 800с. ; 70x100/16. - (Бакалавриат). - Библиогр.: с. 796. - ISBN 978-5-406-02078-4 - 2 000 экз.
5. Банковское дело. Задачи и тесты [Текст] : учебное пособие / Под ред. Н.И. Валенцовой, М.А. Помориной. - УМО. - М. : КНОРУС, 2014. - 328 с. ; 60x90/16. - (Бакалавриат). - 1000 экз. - ISBN 978-5-406-02056-5
6. Богл, Дж. Инвесторы против спекулянтов. Кто на самом деле управляет фондовым рынком [Текст] / Богл Дж. - Пер. с англ. - М. : Манн, Иванов и Фербер, 2014. - 368 с. ; 70x100/16. - ISBN 978-500057-029-6
7. Букин С. [Безопасность банковской деятельности: Учебное пособие. — Санкт-Петербург: Питер 2011 г.— 288 с. — Электронное издание. — ISBN 978-5-459-00569-1](http://ibooks.ru/reading.php?productid=23128)
8. Газман, В. Д. [Лизинг: финансирование и секьюритизация. — Москва: ВШЭ 2011 г.— 469 с. — Электронное издание. — ISBN 978-5-7598-0869-5](http://ibooks.ru/reading.php?productid=29657)
9. Деньги. Кредит. Банки [Текст] : Учебник / Жуков Е.Ф., Зеленкова Н.М., Эриашвили Н.Д. -

- 4-е изд. перераб. и доп., МО. - М. : ЮНИТИ, 2011. - 783с. ; 60x90/16. - ISBN 978-5-238-01529-3 - 2 000 экз.
10. Казакова Н.А. Экономический анализ в оценке бизнеса и управлении инвестиционной привлекательностью компании. — Москва: Финансы и статистика 2013 г.— 240 с. — Электронное издание. — ISBN 978-5-279-03357-7 <http://ibooks.ru/reading.php?productid=335386>
 11. Ключников И.К. Фондовые биржи: вводный курс. — Москва: Финансы и статистика 2013 г.— 200 с. — Электронное издание. — ISBN 978-5-279-03338-6 <http://ibooks.ru/reading.php?productid=335383>
 12. Косорукова И. В., Секачев С. А., Шуклина М. А. Оценка стоимости ценных бумаг и бизнеса. — Москва: МФПУ «Синергия» 2011 г.— 672 с. — Электронное издание. — ISBN 978-5-902597-85-8 <http://ibooks.ru/reading.php?productid=334907>
 13. Куницына, Н.Н. Бизнес-планирование в коммерческом банке [Текст] : учебное пособие / Н. Н. Куницына, А. В. Малеева, Л. И. Ушвицкий. - УМО. - М. : Магистр: ИНФРА-М, 2014. - 384 с. ; 60x90/16. - 300 экз. - Библиогр.: с. 344-348. - ISBN 978-5-9776-0096-5
 14. Лаврушин, О.И. Банковское дело: современная система кредитования [Текст] : учебное пособие / О. И. Лаврушин, О. Н. Афанасьева. - УМО, 7-е изд. перераб. и доп. - М. : КНОРУС, 2013. - 360 с. ; 60x90/16. - (Бакалавриат и магистратура). - 1500 экз. - Библиогр.: с. 351-358. - ISBN 9785-406-02154-4
 15. Маховикова Г. А., Есипов В. Е. Оценка бизнеса: Учебное пособие. 3-е изд. — Санкт-Петербург: Питер 2010 г.— 512 с. — Электронное издание. — ISBN 978-5-49807-163-3 <http://ibooks.ru/reading.php?productid=21675>
 16. Михайленко, М.Н. Финансовые рынки и институты [Текст] : учебник и практикум для прикладного бакалавриата / М. Н. Михайленко ; Под ред. А.Н. Жилкиной. - УМО. - М. : Юрайт, 2015. - 303 с. ; 84x108/32. - (Бакалавр. Прикладной курс). - 500 экз. - ISBN 978-5-9916-4428-0
 17. Мишкин, Ф.С. Экономическая теория денег, банковского дела и финансовых рынков [Текст] : Научно-популярное издание / Ф. С. Мишкин. - 7-е изд. ; Пер. с англ. - М. : ООО "И.Д.Вильямс", 2013. - 880с. ; 70x100/16. - ISBN 978-5-8459-0918-3 - 1 000 экз
 18. Ольхова, Р.Г. Банковское дело: управление в современном банке [Текст] : учебное пособие / Р. Г. Ольхова. - УМО. - М. : КНОРУС, 2015. - 282 с. ; 60x90/16. - (Бакалавриат). - 200 экз. - Библиогр.: с. 295-296. - ISBN 978-5-406-04024-9
 19. Организация деятельности коммерческого банка [Текст] : учебник / Под ред. Е.А. Звоновой. - УМО. - М. : ИНФРА-М, 2015. - 632 с. ; 60x90/16. - (Высшее образование). - 500 экз. - Библиогр.: с. 625-626. - ISBN 978-5-16-005404-9 5 экз
 20. Поморина, М.А. Финансовое управление в коммерческом банке [Текст] : учебное пособие / М. А. Поморина. - УМО. - М. : КНОРУС, 2013. - 376 с. ; 60x90/16. - (Бакалавриат). - 1000 экз. - Библиогр.: с. 351-353. - ISBN 978-5-406-01935-1
 21. Проблемы развития финансовых рынков России в посткризисный период [Текст] : монография / М. Н. Коростелева, С. Н. Толстов, К. Н. Ермолаев. - Самара : ООО "Издательство Ас Гард", 2013. - 322 с. ; 60x84/16. - 500 экз. - ISBN 978-5-4259-0239-9
 22. Риск-менеджмент в коммерческом банке : Монография / Ларионова И.В., ред. и др. - М. : КНОРУС, 2014. - 453с. - ISBN: 978-5-406-02907-7 - Электронное издание <http://www.book.ru/book/914467>
 23. Соколов Ю.А., Дубова С.Е., Кутузова А.С. Организация денежно-кредитного регулирования. — Москва: Флинта 2011 г.— 264 с. — Электронное издание. — ISBN 978-5-9765-1037-1 <http://ibooks.ru/reading.php?productid=25393>
 24. Финансово-кредитные отношения в условиях глобализации [Текст] : Монография / Ковалева Т.М. - М.: СГЭУ, 2011. - 232с.
 25. Финансовые инвестиции на рынке ценных бумаг. ; Иванов А.П. ; 2007 ; Издательский дом "Дашков и К"
 26. Финансовые рынки и финансово-кредитные институты [Текст] : Учебное пособие для бакалавров и магистров / Белоглазова Г.Н., Кроливецкая Л.П. - УМО. - СПб. : Питер, 2013. - 384с. ; 60x90/16. - (Стандарт третьего поколения). - Библиогр.: с. 378 - 379. - ISBN 978-5-496-00061-1 - 2 000 экз.
 27. Финансы и кредит [Текст] : Учебник / Костина Р.В. - МСХ. - М. : КолосС, 2008. - 472с. : ил.; 60x88/16. - (Учебники и учебные пособия для студентов высших учебных заведений). - Библиогр.:

с.468-469.

28. Финансы, деньги, кредит, банки [Текст] : учебник / Под ред. Т. М. Ковалевой. - УМО. - М.: КНОРУС, 2014. - 256 с. ISBN: 978-5-406-02788-2.
29. Финансы: Учебник для вузов/Под ред. проф. М.В. Романовского, проф. О.В. Врублевской, проф. Б.М. Сабанти, М.: Юрайт-М, 2002.
30. Экономическая оценка инвестиций: Учебное пособие для вузов. [Басовский Л.Е.](#) [Басовская Е.Н.](#), Издательство: [Инфра-М](#), 2008.

Законодательно-инструктивный материал:

1. Гражданский кодекс РФ, 1 и 2 части - М.: «ТАНДЕМ», 2008 г.
2. Бюджетный кодекс РФ. - М.: 2008 г., ст. 67, 85, 197.
3. Федеральный закон РФ «Об инвестиционной деятельности в РФ, осуществляемой в форме капитальных вложений», № 39-ФЗ от 25.02.1999 г. (в ред. № 22-ФЗ от 02.01.00 г.)
4. Федеральный закон РФ «О рынке ценных бумаг» № 39-ФЗ от 22.04.96 г. (в ред. № 182-ФЗ от 26.11.98 г., № 139-ФЗ от 08.07.99 г., № 121-ФЗ от 07.08.01 г.).
5. Федеральный закон РФ «О защите прав и законных интересов инвесторов на рынке ценных бумаг» № 46-ФЗ от 05.03.99 г. (в ред. № 194-ФЗ от 30.12.01 г.).
6. Указ Президента РФ «О частных инвестициях в РФ» № 1928 от 17.09.94 г. с дополнениями № 70 от 20.01.96 г.
7. Методические рекомендации по разработке инвестиционной политики предприятия, Приказ Министерства Экономики РФ № 188 от 01.10.1997 г.
8. Федеральный закон «Об акционерных обществах» от 26.12.1995, № 208-ФЗ (с изменениями и дополнениями от 07.08.2001, № 120-ФЗ // Экономика и жизнь.2001. № 40.
9. Федеральный закон «О рынке ценных бумаг» от 22.04.1996, № 39-ФЗ.
10. Федеральный закон «Об инвестиционной деятельности в Российской Федерации, осуществляемой в форме капитальных вложений» от 25.02.1999, № 39-ФЗ.
11. Федеральный закон «Об иностранных инвестициях в Российской Федерации» от 09.07.1999, № 160-ФЗ.
12. Федеральный закон «О лизинге» от 29.10.1998, № 164-ФЗ (с учетом изменений и дополнений от 29.01.2002, № 10-ФЗ).
13. Федеральный закон «О защите прав и законных инвесторов на рынке ценных бумаг» от 05.03.1999, № 46-ФЗ.
14. Федеральный закон «О финансово-промышленных группах» от 30.11.1995, № 190-ФЗ.
15. Федеральный закон «Об ипотеке (залог недвижимости)» от 16.07.1998, № 12-ФЗ.

5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения

1. Astra Linux Special Edition «Смоленск», «Орел»; РедОС
2. МойОфис Стандартный 2, МойОфис Образование, Р7-Офис Профессиональный

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»
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 Операции коммерческих банков на фондовом рынке:

6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

| Вид контроля | Форма контроля | Отметить нужное знаком «+» |
|------------------------|------------------------------|----------------------------|
| Текущий контроль | Оценка доклада | + |
| | Оценка эссе | + |
| | Оценка аналитической записки | + |
| | Оценка обзора литературы | + |
| 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

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

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-3 - Способен планировать и прогнозировать факторы, влияющие на стоимость и доходность размещения кредитных ресурсов юридическим лицам

| Планируемые результаты обучения по программе | Планируемые результаты обучения по дисциплине | | |
|--|--|--|--|
| | ПК-3.1: Знать: | ПК-3.2: Уметь: | ПК-3.3: Владеть (иметь навыки): |
| | факторы, влияющие на стоимость и доходность размещения кредитных ресурсов юридическим лицам | осуществлять планирование и прогнозирование факторов, влияющих на стоимость и доходность размещения кредитных ресурсов | методами финансового менеджмента и применения их в целях обеспечения финансовой устойчивости кредитной организации |
| Пороговый | знать состав кредитных ресурсов юридическим лицам | определять факторы, влияющие на стоимость и доходность размещения кредитных ресурсов | владеть методами по определению доходности размещения кредитных ресурсов юридическим лицам |
| Стандартный (в дополнение к пороговому) | факторы, влияющие на стоимость и доходность размещения кредитных ресурсов | осуществлять планирование факторов, влияющих на стоимость и доходность размещения кредитных ресурсов | иметь навыки планирования и прогнозирования факторов, влияющих на стоимость и доходность размещения кредитных ресурсов юридическим лицам |
| Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному) | знать методы планирования и прогнозирования факторов, влияющих на стоимость и доходность размещения кредитных ресурсов юридическим лицам | осуществлять планирование и прогнозирование факторов, влияющих на стоимость и доходность размещения кредитных ресурсов | методами финансового менеджмента и применять их в целях обеспечения финансовой устойчивости кредитной организации |

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. | Фондовые операции коммерческих банков | ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3 | Оценка докладов Оценка аналитических записок Обзор источников Оценка эссе | зачет |

| | | | | |
|----|---|------------------------|--|-------|
| 2. | Инвестиционные операции коммерческих банков | ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3 | Оценка докладов Оценка аналитических записок Обзор источников Оценка эссе | зачет |
|----|---|------------------------|--|-------|

6.4.Оценочные материалы для текущего контроля

Примерная тематика докладов

| Раздел дисциплины | Темы |
|---|--|
| Фондовые операции коммерческих банков | <ol style="list-style-type: none"> 1. Современное состояние банковской системы России и направления ее дальнейшего развития. 2. Операции коммерческого банка с ценными бумагами: проблемы и перспективы развития. 3. Организация работы коммерческого банка на фондовом рынке. 4. Проблемы совершенствования российского фондового рынка. 5. Банковские услуги с ценными бумагами и условия их развития в России. 6. Глобализация международных финансовых рынков и ее влияние на развитие российской банковской системы. 7. Инвестиционные компании и банки: сущность, роль и перспективы развития. 8. Операции коммерческих банков с векселями. 9. Банковский маркетинг: понятие и составные элементы. 10. Учетные операции коммерческих банков и вексельное кредитование. 11. Стратегия коммерческого банка по работе с ценными бумагами: проблемы выбора, разработки и реализации. |
| Инвестиционные операции коммерческих банков | <ol style="list-style-type: none"> 1. Проблемы формирования ресурсной базы коммерческого банка. 2. Риски банковской инвестиционной деятельности и пути их снижения. 3. Управление процентным риском в коммерческом банке. 4. Формирование портфеля ценных бумаг коммерческого банка и организация работы по управлению им. 5. Организация работы коммерческого банка по эмиссии собственных ценных бумаг. 6. Организация работы коммерческого банка с производными финансовыми инструментами. 7. Деятельность коммерческого банка как агента валютного контроля. 8. Документарные операции коммерческого банка и их роль в обеспечении комплексного подхода к работе с клиентурой. 9. Интернеттехнологии. Их роль и место в развитии банковских услуг. 10. Операции коммерческого банка с ценными бумагами и их роль в обеспечении комплексного обслуживания клиентов. 11. Проблемы и перспективы развития инвестиционных банков в России. 12. Международная деятельность российских коммерческих банков с ценными бумагами. |

Темы эссе

| Раздел дисциплины | Темы |
|---|---|
| Фондовые операции коммерческих банков | Деятельность коммерческого банка на фондовом рынке (на примере любого банка). |
| Инвестиционные операции коммерческих банков | Перспективные направления инвестиционных операций российских коммерческих банков. |

| | |
|--|--|
| | |
|--|--|

Примерная тематика аналитической записки

| Раздел дисциплины | Темы |
|---|--|
| Фондовые операции коммерческих банков | Система государственного регулирования фондовых операций коммерческих банков (на примере любой страны) |
| Инвестиционные операции коммерческих банков | Структура организации нормативно-правового регулирования инвестиционных операций коммерческих банков (на примере любой страны) |

Обзор литературы по разделам дисциплины

| Раздел дисциплины | Содержание |
|---|---|
| Фондовые операции коммерческих банков | <ul style="list-style-type: none"> - документ должен содержать не менее 25 источников литературы; - издания за последние три года; - расположение в алфавитном порядке; - учебники, учебные пособия и статьи из периодической печати 15 источников; - законодательные и нормативные акты 5 источника; - официальные сайты министерств и ведомств 5 источника. |
| Инвестиционные операции коммерческих банков | <ul style="list-style-type: none"> - документ должен содержать не менее 25 источников литературы; - издания за последние три года; - расположение в алфавитном порядке; - учебники, учебные пособия и статьи из периодической печати 15 источников; - законодательные и нормативные акты 5 источника; - официальные сайты министерств и ведомств 5 источника. |

Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций

Инвестор сформировал «портфель дохода» из облигаций государственного сберегательного займа. За счет чего он намерен получать «доход»?

- дивидендов
- +купонного дохода
- курсовой разницы

Верно ли утверждение, что ценные бумаги с фиксированным доходом должны иметь заранее определенную схему выплаты дивидендов?

- +да, это является отличительной особенностью таких ценных бумаг
- нет, поскольку для дивидендов не вводится схема их выплат
- нет, так как по ценным бумагам этого вида дивиденды вообще не выплачиваются

Как изменится доходность ценной бумаги, если её рыночная цена уменьшится?

- +останется без изменений
- возрастет
- понижится

Рынок, на котором исполнение заключенных сделок происходит не позднее второго рабочего дня со дня заключения сделки, называется:

- срочный рынок
- +кассовый рынок
- организованный внебиржевой рынок

Акция – это:

- не эмиссионная ценная бумага, закрепляющая права ее владельца на получение части прибыли акционерного общества в виде дивидендов
- эмиссионная ценная бумага, закрепляющая право ее владельца на получение от эмитента в предусмотренный в ней срок ее номинальной стоимости
- +эмиссионная ценная бумага, закрепляющая права ее владельца на получение части прибыли акционерного общества в виде дивидендов на участие управлением акционерного общества и на часть имущества остающегося после его ликвидации

Контрольный пакет акций:

- +50% + 1 акция
- 100%
- 49% + 1 акция

Ценные бумаги не классифицируются по следующим критериям:

- эмитентам
- срокам функционирования
- +стоимости ценных бумаг
- по экономической природе

Инвестиционный пай – это:

- +именная ценная бумага, подтверждающая право владельца на долю в имуществе паевого инвестиционного фонда
- именная ценная бумага, подтверждающая право ее владельца участия в деятельности паевого инвестиционного фонда

Эмиссионная ценная бумага, закрепляющая права её владельца на получение части прибыли в виде дивидендов – это:

- облигация
- опцион эмитента
- казначейские обязательства
- +акция

По виду выраженных прав ценные бумаги делятся на:

- привилегированные и непривилегированные
- денежные и безденежные
- +долговые и долевые
- эмиссионные и неэмиссионные

Ничем не обусловленное обязательство векселедателя выплатить по наступлении предусмотренного срока полученную займы сумму...

- сберегательный сертификат
- +простой вексель
- переводной вексель
- облигация

Плата за использование заемных средств - это

- +проценты
- купонный доход
- дисконт
- дивиденды

Именная ценная бумага, подтверждающая право её владельца на долю в имуществе фонда - это

- акция
- облигация
- +инвестиционный пай

Цена продажи акции при первичном размещении – это:

- дисконтная цена
- +эмиссионная цена
- номинальная цена
- рыночная цена

Владельцы каких ценных бумаг не имеют право голосовать на общем собрании акционеров:

- +владельцы обыкновенных акций
- владельцы краткосрочных акций
- владельцы привилегированных акций

Товары полностью или частично продаваемые через биржи относятся к:

- +биржевым
- оптовым
- розничным

Как называются биржи, на которых торговые операции осуществляются и с товарами, и с индексами ценных бумаг?

- +универсальные
- международные
- региональные

Как называется торговое соглашение, согласно которому продавец поставляет конкретную продукцию покупателю к определенному сроку в будущем?

- +форвардный контракт
- торговый контракт
- реальный контракт

Цена, характеризующая выражение стоимости чего-либо, поставляемого в будущем, называется:

- +форвардной
- прогнозной
- стандартной

Как называется организованный форум для заключения срочных контрактов, которые для большей ликвидности имеют в высшей степени стандартизированные условия?

- торговые рынки
- +фьючерсные рынки
- биржевые рынки

В чем состоят функции регистрационного бюро на бирже?

- регистрировать участников биржи
- регистрировать нарушения на бирже
- +фиксировать совершаемые сделки и давать информацию на табло

Кто является основными участниками фьючерсных контрактов?

- торговцы и спекулянты
- спекулянты и хеджеры
- +хеджеры и торговцы; торговцы и спекулянты; спекулянты и хеджеры

На первичном рынке ценных бумаг происходит:

- государственные финансовые органы выставляют на продажу ценные бумаги
- формируется идея об эмиссии ценных бумаг и рассчитывается их первичная стоимость
- + эмитентом выпускаются и продаются вновь выпущенные ценные бумаги

К вторичным ценным бумагам относятся:

- + ценные бумаги, для эмиссии которых должны существовать подкрепляющие их первичные

ценные бумаги

- ценные бумаги, подкрепленные обращающимися в госсекторе экономики активами
- ценные бумаги, предполагающие переуступку прав распоряжения ими

Критерии оценки портфеля ценных бумаг:

- рискованность, прибыльность, срок окупаемости
- ликвидность, срок окупаемости
- + надежность, рискованность, ликвидность, доходность

Ценовая функция рынка ценных бумаг заключается в:

- регламентации правил купли-продажи ценных бумаг по справедливым ценам
- + обеспечении рынком процесса установления рыночных цен и их постоянной динамики
- извлечении дохода от каждой операции с ценными бумагами

Структура рынка ценных бумаг представлена:

- капитальными вложениями государства и частных лиц
- + первичным и вторичным рынками
- обращаемым капиталом и ценными бумагами, в которые этот капитал вложен

Продажа банком ценных бумаг является:

- + операцией, осуществляемой на первичном рынке ценных бумаг
- операцией, осуществляемой на вторичном рынке ценных бумаг
- операцией, осуществляемой при непосредственном контроле государства

Операции с ценными бумагами:

- + эмиссионные, инвестиционные, посреднические
- эмиссионные, посреднические, ликвидационные
- эмиссионные, инвестиционные, посреднические, ликвидационные

К производным ценным бумагам относятся:

- + фьючерсные контракты, свободно обращающиеся опционы, свопы
- коносаменты, облигации, ипотечные закладные
- облигации, акции, векселя, трастовые сертификаты

Аукцион, идущий пошагово от минимальной к максимальной цене, называется:

- + Английским аукционом
- Голландским аукционом
- Американский аукционом

Владение какой ценной бумагой дает возможность наращивать вложения за счет роста курсовой стоимости?

- облигацией государственного займа
- ипотечной ценной бумаги
- + акцией

Характерное свойство фьючерсного контракта – это:

- прописанные в нем условия обязательны для исполнения только продавцом ценной бумаги
- прописанные в нем условия обязательны для исполнения только покупателем ценной бумаги
- + прописанные в нем условия обязательны для исполнения как продавцом, так и покупателем ценной бумаги

Совокупность процедур по включению ценных бумаг в биржевой список – это:

- процессинг
- + листинг
- майнинг

Какой орган государственной власти в РФ имеет право выдавать лицензии профессиональным участникам рынка ценных бумаг?

- + Центробанк РФ
- Министерство финансов РФ
- Правительство РФ

Цена, каких из перечисленных ценных бумаг определяется стоимостью основного средств?

- + опцион
- обыкновенная акция
- привилегированная акция

Можно ли снизить риск инвестиционного проекта путем страхования рисков?

- нет, так как такого вида страхования не существует
- страхование вообще нельзя рассматривать в качестве метода снижения риска инвестирования
- + да, с помощью страхования можно снизить риск инвестирования

По каким критериям принято классифицировать инвестиционные портфели?

- по степени риска и по количеству входящих в них ценных бумаг
- по степени риска и реакции на темпы инфляции
- + по степени риска и в зависимости от источника доходов по ценным бумагам портфеля

Какие из перечисленных ценных бумаг можно отнести к ценным бумагам с фиксированным доходом?

- государственная облигация
- бескупонная облигация
- + все перечисленные ценные бумаги

6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме зачета

| Раздел дисциплины | Вопросы |
|---|---|
| Фондовые операции коммерческих банков | <ol style="list-style-type: none">1. Современное состояние банковской системы России и направления ее дальнейшего развития.2. Операции коммерческого банка с ценными бумагами: проблемы и перспективы развития.3. Организация работы коммерческого банка на фондовом рынке.4. Проблемы совершенствования российского фондового рынка.5. Банковские услуги с ценными бумагами и условия их развития в России.6. Глобализация международных финансовых рынков и ее влияние на развитие российской банковской системы.7. Инвестиционные компании и банки: сущность, роль и перспективы развития.8. Операции коммерческих банков с векселями.9. Банковский маркетинг: понятие и составные элементы.10. Учетные операции коммерческих банков и вексельное кредитование.11. Стратегия коммерческого банка по работе с ценными бумагами: проблемы выбора, разработки и реализации. |
| Инвестиционные операции коммерческих банков | <ol style="list-style-type: none">1. Проблемы формирования ресурсной базы коммерческого банка.2. Риски банковской инвестиционной деятельности и пути их снижения.3. Управление процентным риском в коммерческом банке.4. Формирование портфеля ценных бумаг коммерческого банка и организация работы по управлению им.5. Организация работы коммерческого банка по эмиссии собственных |

| | |
|--|--|
| | <p>ценных бумаг.</p> <p>6. Организация работы коммерческого банка с производными финансовыми инструментами.</p> <p>7. Деятельность коммерческого банка как агента валютного контроля.</p> <p>8. Документарные операции коммерческого банка и их роль в обеспечении комплексного подхода к работе с клиентурой.</p> <p>9. Интернеттехнологии. Их роль и место в развитии банковских услуг.</p> <p>10. Операции коммерческого банка с ценными бумагами и их роль в обеспечении комплексного обслуживания клиентов.</p> <p>11. Проблемы и перспективы развития инвестиционных банков в России.</p> <p>12. Международная деятельность российских коммерческих банков с ценными бумагами.</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-3 |
| «не зачтено» | Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне |