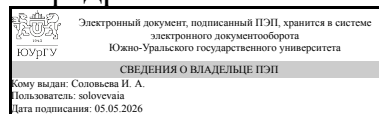


# ЮЖНО-УРАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

УТВЕРЖДАЮ:  
Заведующий выпускающей  
кафедрой



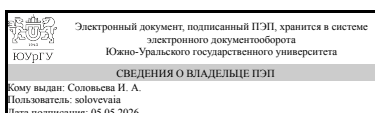
И. А. Соловьева

## РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины 1.Ф.М0.14 Биржевая торговля и биржевые инструменты  
для направления 38.04.08 Финансы и кредит  
уровень Магистратура  
магистерская программа Финансовые технологии и банковская деятельность  
форма обучения заочная  
кафедра-разработчик Экономика и финансы

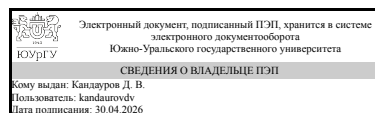
Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит, утверждённым приказом Минобрнауки от 12.08.2020 № 991

Зав.кафедрой разработчика,  
д.экон.н., проф.



И. А. Соловьева

Разработчик программы,  
к.экон.н., доцент



Д. В. Кандауров

## 1. Цели и задачи дисциплины

Изучение дисциплины ставит целью формирование у обучающихся системного понимания организации биржевой торговли и механизмов функционирования биржевых инструментов, включая практические основы заключения и сопровождения биржевых сделок. Задачами дисциплины являются: - изучить устройство биржевой инфраструктуры и роли участников торгов (организатор торгов, брокеры/дилеры, клиринг и расчёты); - изучить основные классы биржевых инструментов и специфику их обращения (в т.ч. производные инструменты); - сформировать навыки применения базовых технологий исполнения сделок и расчётов (включая режимы поставки и расчётов); - освоить подходы к управлению рисками биржевых операций и использованию ключевых показателей риска.

## Краткое содержание дисциплины

Дисциплина рассматривает биржевой рынок как организованную систему: раскрываются назначение и функции биржи, принципы организации торгов и регламенты совершения биржевых операций. Далее изучаются участники и инфраструктура биржевой торговли, включая брокерское обслуживание, клиринг и механизмы расчётов и поставки (в том числе в режимах типа T+2). Значительная часть дисциплины посвящена основным биржевым инструментам и их обращению, а также производным финансовым инструментам и практикам их использования в торговых и хеджирующих стратегиях. Завершается курс вопросами риск-менеджмента биржевых операций: классификацией рисков, подходами к их оценке и контролю.

## 2. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины

| Планируемые результаты освоения ОП ВО (компетенции)                                                                                                                                                                                                                                                                                | Планируемые результаты обучения по дисциплине                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| ПК-5 Способен осуществлять поиск, анализировать и оценивать информацию по рискам в отрасли и в организации; эффективно эксплуатировать и совершенствовать систему и процесс управления рисками в организации, обеспечивать ее устойчивое функционирование, идентифицировать и минимизировать риски при принятии финансовых решений | Знает: основные виды финансовых инструментов биржевого рынка и источники финансовой информации о них; методы моделирования стоимости финансовых инструментов биржевого рынка, необходимые для формирования целевого инвестиционного портфеля<br>Умеет: производить сбор и анализ информации о рынке финансовых инструментов биржевого рынка, строить финансовые модели ценообразования на рынке финансовых инструментов; принимать инвестиционные решения на основе собранной информации о рынке производных финансовых инструментов<br>Имеет практический опыт: подбора производных ценных бумаг для целевого инвестиционного портфеля на основе сбора и анализа информации о биржевом рынке финансовых инструментов, финансового моделирования производных финансовых инструментов |

## 3. Место дисциплины в структуре ОП ВО

| Перечень предшествующих дисциплин, видов работ учебного плана                                                                                                                                                                      | Перечень последующих дисциплин, видов работ           |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------|
| Кредитные рейтинги и кредитоспособность, Денежно-кредитная и макропруденциальная политика, Производственная практика (научно-исследовательская работа) (3 семестр), Учебная практика (научно-исследовательская работа) (2 семестр) | Производственная практика (преддипломная) (5 семестр) |

Требования к «входным» знаниям, умениям, навыкам студента, необходимым при освоении данной дисциплины и приобретенным в результате освоения предшествующих дисциплин:

| Дисциплина                                       | Требования                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Денежно-кредитная и макропруденциальная политика | Знает: роль денежно-кредитного и макропруденциального регулирования в обеспечении стабильности банковского сектора, принципы и методы денежно-кредитного и макропруденциального регулирования; модели оценки влияния денежно-кредитного и макропруденциального регулирования на риски банковского сектора Умеет: использовать аналитические материалы Банка России и надзорных органов других стран для получения информации о состоянии финансового сектора, использовать аналитические материалы Банка России и надзорных органов других стран для получения информации о рисках финансового сектора; прогнозировать деятельность кредитной организации Имеет практический опыт: установления взаимосвязи между выбором инструментов денежно-кредитной и макропруденциальной политики и стабильностью банковского сектора, работы с аналитическими материалами, касающимися деятельности регулирования рисков банков и регулирования банковского сектора; анализа эффективности макропруденциального регулирования рисков денежно-кредитной сферы |
| Кредитные рейтинги и кредитоспособность          | Знает: методики оценки кредитных рейтингов и кредитоспособности, основные рейтинги и индексы, используемые для оценки кредитоспособности организаций и ценных бумаг Умеет: осуществлять критический анализ кредитных рейтингов и кредитоспособности участников рынка, анализировать данные финансового рынка, вести сбор достоверной и своевременной информации обо всех операциях организации и на этой основе оценивать ее развитие Имеет практический опыт: к подходу по выработке стратегий обеспечения кредитоспособности, финансового консультирования в организации, в том числе финансово-кредитной; практический опыт                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

|                                                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                                                | понимания особенностей различных видов бизнеса организации и его функционирования                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| Учебная практика (научно-исследовательская работа) (2 семестр) | <p>Знает: методы анализа различных подходов к решению проблемы в рамках поставленной темы, включая финансовый анализ, стратегический анализ, конкурентный анализ и другие, основы системного подхода к анализу и к разработке стратегии разрешения проблемной ситуации, современные коммуникативные технологии, в том числе на иностранном(ых) языке(ах), и современные информационно-коммуникативные технологии, теоретико-методические основы управления проектом на каждом этапе его жизненного цикла, методы выделения этапа жизненного цикла проекта, специфику управления на каждом этапе, виды рисков предпринимательской деятельности; основные виды рисков функционирования финансово-кредитной организации; методы оценки, анализа рисков</p> <p>Умеет: проводить различные виды критического анализа текущего положения объекта исследования, оценивать существующие подходы к решению проблемы в рамках поставленной темы; на основе системного подхода осуществлять экономически обоснованный выбор стратегии действий, использовать современные информационно-коммуникативные технологии для академического и профессионального взаимодействия, в том числе электронные учебники, электронные энциклопедии и справочники, образовательные интернет ресурсы, систематизировано представлять теоретико-методические основы проблемы построения системы управления проектом на разных стадиях его жизненного цикла, включая выбор индикаторов распознавания этапа жизненного цикла проекта, постановку целей управления на каждом этапе, выработку мероприятий и разработку планов реализации каждого этапа; разработку системы контроля выполнения мероприятий, методов оценки экономической эффективности реализации каждого этапа, осуществлять поиск информации о внешней и внутренней среде организации; идентифицировать риски функционирования финансово-кредитной организации</p> <p>Имеет практический опыт: интерпретации критического анализа подходов к решению проблемы в рамках поставленной темы и формулировки выводов по результатам анализа, поиска необходимой электронной литературы и другой интернет информации, подготовки законченного, внутренне связанного документа по проблеме управления проектом на</p> |

|                                                                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|-------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                                                         | каждой стадии его жизненного цикла, выявления проблемных зон и наиболее значимых рисков ситуаций в деятельности организации                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| Производственная практика (научно-исследовательская работа) (3 семестр) | <p>Знает: современные коммуникационные технологии, включая локальные компьютерные сети и Интернет, протокол передачи данных TCP/IP, электронная почта, конференции, иностранный язык, основы различных методов анализа, в том числе финансового, стратегического, маркетингового, виды стратегий развития банка, подходы к обоснованию выбора стратегии, основы стратегического планирования, виды рисков предпринимательской деятельности; основные виды рисков функционирования финансово-кредитной организации; методы оценки, анализа и управления рисками</p> <p>Умеет: пользоваться основными видами современных коммуникационных технологий, в том числе на иностранном языке, осуществлять выбор наиболее целесообразного вида коммуникативной технологии для достижения поставленных целей, интерпретировать результаты проведенного анализа различных видов (финансового, стратегического, маркетингового), формулировать выводы и разрабатывать рекомендации по выбору стратегии, использовать системный подход при формулировке выводов и рекомендаций, осуществлять поиск информации, идентифицировать и анализировать риски функционирования финансово-кредитной организации</p> <p>Имеет практический опыт: пользования локальными сетями и глобальной сетью Интернет, электронной почтой, конференциями в целях академического и профессионального взаимодействия, проведения анализа разных видов (финансового, стратегического, маркетингового), подготовки аналитической записки по результатам проведенного анализа, разработки рекомендаций по совершенствованию системы управления рисками организации</p> |

#### 4. Объём и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 2 з.е., 72 ч., 12,25 ч. контактной работы с применением дистанционных образовательных технологий

| Вид учебной работы | Всего часов | Распределение по семестрам в часах |
|--------------------|-------------|------------------------------------|
|                    |             | Номер семестра                     |
|                    |             | 4                                  |

|                                                                            |       |       |
|----------------------------------------------------------------------------|-------|-------|
| Общая трудоёмкость дисциплины                                              | 72    | 72    |
| Аудиторные занятия:                                                        | 8     | 8     |
| Лекции (Л)                                                                 | 4     | 4     |
| Практические занятия, семинары и (или) другие виды аудиторных занятий (ПЗ) | 4     | 4     |
| Лабораторные работы (ЛР)                                                   | 0     | 0     |
| Самостоятельная работа (СРС)                                               | 59,75 | 59,75 |
| Подготовка к зачету                                                        | 15    | 15    |
| Подготовка к практическим занятиям                                         | 44,75 | 44.75 |
| Консультации и промежуточная аттестация                                    | 4,25  | 4,25  |
| Вид контроля (зачет, диф.зачет, экзамен)                                   | -     | зачет |

## 5. Содержание дисциплины

| № раздела | Наименование разделов дисциплины | Объем аудиторных занятий по видам в часах |   |    |    |
|-----------|----------------------------------|-------------------------------------------|---|----|----|
|           |                                  | Всего                                     | Л | ПЗ | ЛР |
| 1         | Биржевой рынок ценных бумаг      | 4                                         | 2 | 2  | 0  |
| 2         | Биржевой рынок деривативов       | 4                                         | 2 | 2  | 0  |

### 5.1. Лекции

| № лекции | № раздела | Наименование или краткое содержание лекционного занятия | Кол-во часов |
|----------|-----------|---------------------------------------------------------|--------------|
| 1        | 1         | Акции и облигации на биржевом рынке                     | 2            |
| 2        | 2         | Фьючерсы и опционы на срочном биржевом рынке            | 2            |

### 5.2. Практические занятия, семинары

| № занятия | № раздела | Наименование или краткое содержание практического занятия, семинара | Кол-во часов |
|-----------|-----------|---------------------------------------------------------------------|--------------|
| 1         | 1         | Торговля акциями и облигациями на биржевом рынке                    | 2            |
| 2         | 2         | Сделки с деривативами на биржевом рынке                             | 2            |

### 5.3. Лабораторные работы

Не предусмотрены

### 5.4. Самостоятельная работа студента

| Выполнение СРС                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |         |
|------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------|
| Подвид СРС                         | Список литературы (с указанием разделов, глав, страниц) / ссылка на ресурс                                                                                                                                                                                                                                              | Семестр |
| Подготовка к зачету                | Производные финансовые инструменты: текст лекций / Т.Г. Каримова. – Челябинск: Издательский центр ЮУрГУ, 2014. - URL: <a href="http://lib.susu.ru/ftd?base=SUSU_METHOD&amp;dtype=F&amp;etype=.pdf&amp;key=000536338">http://lib.susu.ru/ftd?base=SUSU_METHOD&amp;dtype=F&amp;etype=.pdf&amp;key=000536338</a> . – 85 с. | 4       |
| Подготовка к практическим занятиям | Производные финансовые инструменты: текст лекций / Т.Г. Каримова. – Челябинск: Издательский центр ЮУрГУ, 2014. - URL: <a href="http://lib.susu.ru/ftd?base=SUSU_METHOD&amp;dtype=F&amp;etype=.pdf&amp;key=000536338">http://lib.susu.ru/ftd?base=SUSU_METHOD&amp;dtype=F&amp;etype=.pdf&amp;key=000536338</a> . – 85 с. | 4       |

## 6. Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации

Контроль качества освоения образовательной программы осуществляется в соответствии с Положением о балльно-рейтинговой системе оценивания результатов учебной деятельности обучающихся.

### 6.1. Контрольные мероприятия (КМ)

| № КМ | Семестр | Вид контроля     | Название контрольного мероприятия                                      | Вес | Макс. балл | Порядок начисления баллов                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | Учитывается в ПА |
|------|---------|------------------|------------------------------------------------------------------------|-----|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|
| 1    | 4       | Текущий контроль | Тест 1 - Биржевой рынок ценных бумаг                                   | 1   | 10         | Тест из 10 вопросов по теме с вариантами ответов. В случае верного ответа на вопрос – 1 балл, в случае неверного – 0 баллов. При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179). Максимальное количество баллов – 10 за задание.                                                                                                                                                                                                                                                                         | зачет            |
| 2    | 4       | Текущий контроль | Тест 2 - Биржевой рынок деривативов                                    | 1   | 10         | Тест из 10 вопросов по теме с вариантами ответов. В случае верного ответа на вопрос – 1 балл, в случае неверного – 0 баллов. При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179). Максимальное количество баллов – 10 за задание.                                                                                                                                                                                                                                                                         | зачет            |
| 3    | 4       | Текущий контроль | Практическое задание 1 - Торги акциями и облигациями на биржевом рынке | 1   | 5          | В процессе проведения практических занятий и семинаров осуществляется контроль выполнения заданий и самостоятельной работы студента. Решение практических задач осуществляется с целью проверки уровня знаний, умений, владений, понимания студентом основных методов и законов изучаемой теории при решении конкретных практических задач. Практическое задание 1 предполагает решение студентом пяти задач. Решения излагаются письменно на бумаге и передаются преподавателю на проверку, либо выполняются в электронном виде и загружаются в систему "Электронный ЮУрГУ 2.0". Время, отводимое на задание – 90 мин. При оценивании результатов | зачет            |

|   |   |                          |                                                               |   |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |       |
|---|---|--------------------------|---------------------------------------------------------------|---|----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|
|   |   |                          |                                                               |   |    | мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179) Критерии оценивания: по 1 баллу за каждую верно решенную задачу. Максимальное количество баллов – 5 за задание.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |       |
| 4 | 4 | Текущий контроль         | Практическое задание 2 - Фьючерсы и опционы на биржевом рынке | 1 | 5  | <p>В процессе проведения практических занятий и семинаров осуществляется контроль выполнения заданий и самостоятельной работы студента. Решение практических задач осуществляется с целью проверки уровня знаний, умений, владений, понимания студентом основных методов и законов изучаемой теории при решении конкретных практических задач. Студенту выдается две задачи, которые он решает либо письменно, на листках бумаги, либо в электронном виде с последующей загрузкой решения в систему "Электронный ЮУрГУ 2.0". Время, отводимое на задание – 60 мин. При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179) Критерии оценивания:</p> <p>Критерии оценивания первой задачи: 2 балла – верное решение и ответ; 0 баллов – решение неверное, либо отсутствует.</p> <p>Критерии оценивания второй задачи: 3 балла – верное решение и ответ; 2 балла – ход решения верный, но ответ не верен ввиду вычислительной ошибки; 1 балл – ход решения неверен, ответ также не верен; 0 баллов – решение неверное, либо отсутствует.</p> <p>Максимальное количество баллов – 5 за задание.</p> | зачет |
| 5 | 4 | Промежуточная аттестация | Зачет (тест и задачи)                                         | - | 20 | <p>На зачете осуществляется оценивание учебной деятельности обучающихся по дисциплине на основе решения теста и практической задачи по изученным темам. Зачет предполагает решение студентами теста и задач. Студенту выдается 5 задач, решение которых он излагает письменно (в электронном виде) и загружает в электронную среду (ЮУрГУ 2.0), тест выполняется в системе «Электронный ЮУрГУ». Время, отводимое на мероприятие текущей</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | зачет |

|   |   |                  |                        |   |   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |       |
|---|---|------------------|------------------------|---|---|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|
|   |   |                  |                        |   |   | <p>аттестации – 90 мин. (10 мин. – тест, 80 мин. - задачи) Тест содержит 10 вопросов по 1 баллу за каждый правильный ответ. Правильное решение каждой задачи оценивается в 2 балла, студент получает 1 балл в случае вычислительной ошибки при правильном ходе решения, 0 баллов выставляется в случае неверного хода решения задачи либо отсутствии решения. Максимальное количество баллов – 20 за мероприятие промежуточной аттестации. Зачет считается завершенным, если по совокупности баллов студент набрал не менее 60 % общего рейтинга обучающегося, в ином случае студент направляется на пересдачу. Итоговая оценка за курс выставляется на основе баллов, полученных обучающимся за контрольно-рейтинговые мероприятия текущего контроля и промежуточной аттестации. При расчете итоговой оценки за курс используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179).</p> |       |
| 6 | 4 | Текущий контроль | Фонд оценочных средств | 0 | 0 | -                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | зачет |

## 6.2. Процедура проведения, критерии оценивания

| Вид промежуточной аттестации | Процедура проведения                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | Критерии оценивания                     |
|------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------|
| зачет                        | <p>На зачете происходит оценивание знаний, умений и приобретенного опыта обучающихся по дисциплине на основе полученных оценок за контрольно-рейтинговые мероприятия текущего контроля. Прохождение контрольного мероприятия промежуточной аттестации не является обязательным для студента. При недостаточной и/или не устраивающей студента величине рейтинга ему может быть предложено пройти контрольно-рейтинговое мероприятие промежуточной аттестации. На выполнение теста из 10 вопросов (по 1 баллу за вопрос) отводится 10 минут. На решение пяти задач (по 2 балла каждая) дается 80 минут. Суммарное время для выполнения всех заданий экзамена составляет 90 минут. Максимальное количество баллов за промежуточную аттестацию – 20. В результате складывается совокупный рейтинг студента, который дифференцируется в оценку и проставляется в ведомость, зачетную книжку студента.</p> | В соответствии с пп. 2.5, 2.6 Положения |

## 6.3. Паспорт фонда оценочных средств

| Компетенции | Результаты обучения                                                                                                                                                                                                                                                                  | № КМ |   |   |   |   |   |
|-------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|---|---|---|---|---|
|             |                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 1    | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| ПК-5        | Знает: основные виды финансовых инструментов биржевого рынка и источники финансовой информации о них; методы моделирования стоимости финансовых инструментов биржевого рынка, необходимые для формирования целевого инвестиционного портфеля                                         | +    | + |   |   | + | + |
| ПК-5        | Умеет: производить сбор и анализ информации о рынке финансовых инструментов биржевого рынка, строить финансовые модели ценообразования на рынке финансовых инструментов; принимать инвестиционные решения на основе собранной информации о рынке производных финансовых инструментов |      |   | + | + | + | + |
| ПК-5        | Имеет практический опыт: подбора производных ценных бумаг для целевого инвестиционного портфеля на основе сбора и анализа информации о биржевом рынке финансовых инструментов, финансового моделирования производных финансовых инструментов                                         |      |   | + | + | + | + |

Типовые контрольные задания по каждому мероприятию находятся в приложениях.

## 7. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

### Печатная учебно-методическая документация

#### а) основная литература:

1. Ширяев, В. И. Финансовая математика. Потоки платежей, производные финансовые инструменты [Текст] учеб. пособие для вузов по специальности 061800 "Мат. методы в экономике" и др. специальностям В. И. Ширяев. - 2-е изд., испр. и доп. - М.: ЛИБРОКОМ, 2009. - 230, [1] с. ил.
2. Инглис-Тейлор, Э. Производные финансовые инструменты [Текст] Слов. Пер. с англ.: А. М. Волков, А. В. Щедрин ; Науч. ред. Ю. Н. Алексеев. - М.: ИНФРА-М, 2001. - 222 с.
3. Ширяев, В. И. Финансовые рынки. Стохастические модели, опционы, форварды, фьючерсы [Текст] учеб. пособие для вузов по специальности "Матем. методы в экономике" и др. специальностям В. И. Ширяев. - 2-е изд., испр. и доп. - М.: URSS : ЛИБРОКОМ, 2009. - 221, [1] с.
4. Галанов, В. А. Производные инструменты срочного рынка: фьючерсы, опционы, свопы Учеб. для вузов по специальностям 060400 "Финансы и кредит", 060500 "Бухгалт. учет, анализ и аудит", 060600 "Мировая экономика" В. А. Галанов; Рос. экон. акад. им. Г. В. Плеханова; Рос. экон. акад. им. Г. В. Плеханова. - М.: Финансы и статистика, 2002. - 462,[1] с. ил.

#### б) дополнительная литература:

1. Практикум по курсу "Ценные бумаги" : Учеб. пособие для вузов для экон. специальностей / В. И. Колесников, В. С. Торкановский, В. Д. Никифорова и др.; Под ред.: В. С. Торкановского, В. С. Колесникова. - М. : Финансы и статистика, 2000. - 298,[1] с.
2. Международный финансовый рынок : учеб. пособие / Рос. экон. акад. им. Г. В. Плеханова ; В. А. Галанов и др. ; под ред. В. А. Слепова, Е. А. Звоновой. - М. : Магистр, 2009. - 543 с. : ил.
3. РЦБ : аналит. журн. / АОЗТ "Журн. "Рынок ценных бумаг". - М., 2008-2015. -

4. Алехин Б. И. Рынок ценных бумаг : учеб. пособие для вузов по специальности 060400 "Финансы и кредит" / Б. И. Алехин. - 2-е изд., перераб. и доп.. - М. : ЮНИТИ-ДАНА, 2006. - 460, [1] с. : ил.

в) отечественные и зарубежные журналы по дисциплине, имеющиеся в библиотеке:  
Не предусмотрены

г) методические указания для студентов по освоению дисциплины:

1. Каримова Т. Г. Рынок ценных бумаг : сб. задач для направлений "Экономика" и "Менеджмент" / Т. Г. Каримова ; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Финансы, денежное обращение и кредит ; ЮУрГУ. - Челябинск : Издательский Центр ЮУрГУ, 2016. - 24, [1] с.. URL:  
[http://www.lib.susu.ac.ru/ftd?base=SUSU\\_METHOD1&key=000554002](http://www.lib.susu.ac.ru/ftd?base=SUSU_METHOD1&key=000554002)

из них: учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студента:

1. Каримова Т. Г. Рынок ценных бумаг : сб. задач для направлений "Экономика" и "Менеджмент" / Т. Г. Каримова ; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Финансы, денежное обращение и кредит ; ЮУрГУ. - Челябинск : Издательский Центр ЮУрГУ, 2016. - 24, [1] с.. URL:  
[http://www.lib.susu.ac.ru/ftd?base=SUSU\\_METHOD1&key=000554002](http://www.lib.susu.ac.ru/ftd?base=SUSU_METHOD1&key=000554002)

### Электронная учебно-методическая документация

Нет

Перечень используемого программного обеспечения:

1. Microsoft-Office(бессрочно)

Перечень используемых профессиональных баз данных и информационных справочных систем:

1. -База данных rolpred (обзор СМИ)(бессрочно)

### 8. Материально-техническое обеспечение дисциплины

| Вид занятий                     | № ауд.  | Основное оборудование, стенды, макеты, компьютерная техника, предустановленное программное обеспечение, используемое для различных видов занятий |
|---------------------------------|---------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Практические занятия и семинары | 410 (1) | Компьютеры с доступом в интернет, проектор                                                                                                       |
| Лекции                          | 410 (1) | Компьютеры с доступом в интернет, проектор                                                                                                       |
| Зачет                           | 410 (1) | Компьютеры с доступом в интернет, проектор                                                                                                       |
| Самостоятельная работа студента | 305 (1) | Проектор, ноутбук                                                                                                                                |