

**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ БЮДЖЕТНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
ФИНАНСОВЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПРИ ПРАВИТЕЛЬСТВЕ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**

БАРНАУЛЬСКИЙ ФИЛИАЛ

Кафедра «Финансы и кредит»

Ильиных Ю.М.

Операции коммерческого банка на рынке ценных бумаг

Рабочая программа дисциплины

для студентов, обучающихся по направлению подготовки
38.04.02 «Менеджмент», магистерской программы «Финансовый менеджмент и
рынок капиталов»


Барнаул 2018

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ БЮДЖЕТНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
**ФИНАНСОВЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПРИ ПРАВИТЕЛЬСТВЕ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**

БАРНАУЛЬСКИЙ ФИЛИАЛ

Кафедра «Финансы и кредит»

УТВЕРЖДАЮ
Директор филиала

 В.А. Иванова
«25» мая 2018 г.

Ильиных Ю.М.

Операции коммерческого банка на рынке ценных бумаг

Рабочая программа дисциплины

для студентов, обучающихся по направлению подготовки
38.04.02 «Менеджмент», магистерской программы «Финансовый менеджмент и
рынок капиталов»

*Рекомендовано Ученым советом Барнаульского филиала
(протокол № 1 от «25» мая 2018 г.)*

*Одобрено кафедрой «Финансы и кредит»
(протокол № 9 от «25» апреля 2018 г.)*

Барнаул 2018

УДК 658.14/17

ББК65.291.9-23

Рецензент - Глазкова Т.Н., канд. экон. наук, доцент Алтайского государственного технического университета им. И.И. Ползунова

Операции коммерческого банка на рынке ценных бумаг. Рабочая программа дисциплины для студентов, обучающихся по направлениям подготовки 38.04.02 «Менеджмент», магистерской программы «Финансовый менеджмент и рынок капиталов». – Барнаул: Барнаульский филиал Финуниверситета, 2018 – 28 с.

Дисциплина «Операции коммерческого банка на рынке ценных бумаг» входит в блок дисциплин по выбору программы магистратуры.

Программа содержит: перечень планируемых результатов обучения по дисциплине профиля, тематику лекционных и семинарских занятий; учебно-методическое обеспечение для самостоятельной работы обучающихся, фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся, перечень ресурсов, необходимых для реализации образовательного процесса и т.д.

Учебное издание

Ильиных Юлия Михайловна

«Операции коммерческого банка на рынке ценных бумаг»

Рабочая программа дисциплины

Компьютерный набор, верстка Ю.М. Ильиных
Формат 60×90/16. Гарнитура Times New Roman

© Ю.М. Ильиных, 2018

© Барнаульский филиал Финуниверситета

СОДЕРЖАНИЕ

1. Наименование дисциплины.....	6
2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине с указанием индикаторов их достижения и планируемых результатов обучения	6
3. Место дисциплины в структуре образовательной программы.....	6
4. Объем дисциплины в зачетных единицах и в академических часах с выделением объема аудиторной (лекции, семинары) и самостоятельной работы обучающихся	7
5. Содержание дисциплины, структурированное по темам дисциплины с указанием их объемов (в академических часах) и видов учебных занятий.....	7
5.1. Содержание дисциплины.....	7
5.2. Учебно-тематический план.....	10
5.3. Содержание семинаров, практических занятий	11
6. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине.....	13
6.1. Перечень вопросов, отводимых на самостоятельное освоение дисциплины, формы внеаудиторной самостоятельной работы	13
6.2. Перечень вопросов, заданий, тем для подготовки к текущему контролю	14
7. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине.....	17
8. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины.....	21
9. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины.....	22
10. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины.....	23
11. Перечень информационных технологий, используемых для	

осуществления образовательного процесса по дисциплине, включая перечень необходимого программного обеспечения и информационных справочных систем.....	27
12. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине.....	28

1. Наименование дисциплины

«Операции коммерческого банка на рынке ценных бумаг»

2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине с указанием индикаторов их достижения и планируемых результатов обучения

Дисциплина «Операции коммерческого банка на рынке ценных бумаг» обеспечивает формирование следующих компетенций:

Код компетенции	Наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции	Результаты обучения, соотнесенные с индикаторами достижения компетенции
ДКН-2	Способность формировать финансовую и инвестиционную политику, разрабатывать бизнес-планы, моделировать экономические процессы, использовать современные информационные технологии и пакеты прикладных программ для решения практических задач	1. Самостоятельно разрабатывает финансовую и инвестиционную политику организации.	Умения Умения разрабатывать финансовую и инвестиционную политику кредитных организаций Знания Знания особенностей организации деятельности коммерческих банков на фондовом рынке, сущности финансовой и инвестиционной политики кредитных организаций
		2. Использует современные информационные технологии и пакеты прикладных программ для разработки бизнес-планов, решения практических задач	Умения Умения формировать финансовую и инвестиционную политику коммерческого банка с использованием современных информационных технологий обработки экономических данных Знания Знания современных информационных технологий и пакетов прикладных программ, применяемых для формирования портфеля ценных бумаг коммерческого банка

3. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Операции коммерческого банка на рынке ценных бумаг» предусмотрена учебным планом для обучающихся по направлениям

подготовки 38.04.02 «Менеджмент», магистерской программы «Финансовый менеджмент и рынок капиталов», входит в блок дисциплин по выбору программы магистратуры.

4. Объем дисциплины в зачетных единицах и в академических часах с выделением объема аудиторной (лекции, семинары) и самостоятельной работы обучающихся

Таблица 1

Вид учебной работы по дисциплине	Всего (в з.е. и часах)	Семестр 4 (в часах)
Общая трудоемкость дисциплины	3 з.е. (108 ч.)	3 з.е. (108 ч.)
Контактная работа - Аудиторные занятия	16	16
<i>Лекции</i>	4	4
<i>Семинары, практические занятия</i>	12	12
Самостоятельная работа	92	92
Вид текущего контроля	Контрольная работа	Контрольная работа
Вид промежуточной аттестации	Зачет	Зачет

Особенности проведения занятий для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья (ОВЗ) (опорно-двигательного аппарата, слуха и зрения) при необходимости отражаются в индивидуальном плане обучающегося.

5. Содержание дисциплины, структурированное по темам дисциплины с указанием их объемов (в академических часах) и видов учебных занятий

5.1. Содержание дисциплины

Тема 1. Основы деятельности банков на современном рынке ценных бумаг России

Предмет и содержание курса. Основы регулирования рынка ценных бумаг. Характеристика фондового рынка: участники и регуляторы. Место и роль банков в функционировании рынка ценных бумаг в разных странах.

Законодательно-нормативная база, регламентирующая операции банков с ценными бумагами в России. Участие банков в операциях на рынке ценных бумаг РФ: общая характеристика.

Тема 2. Эмиссионная деятельность кредитных организаций

Выпуск банком собственных ценных бумаг. Правовое регулирование операций банка по выпуску эмиссионных ценных бумаг. Процедура выпуска банком собственных акций. Виды акций, выпускаемых банком, и требования, предъявляемые к банковским акциям. Государственная регистрация выпуска акций коммерческого банка. Сроки и способы размещения банком собственных акций. Порядок выкупа банком собственных акций.

Деятельность банка по обеспечению реализации прав инвесторов, удостоверяемых эмитированными банком акциями. Процедура выпуска банком собственных облигаций. Виды банковских облигаций и требования, предъявляемые к выпуску банком облигаций. Государственная регистрация выпуска облигаций коммерческого банка. Сроки и способы размещения банком собственных облигаций. Деятельность банка-эмитента по обеспечению реализации прав держателей банковских облигаций. Порядок и формы раскрытия банком информации по ценным бумагам в случае публичного размещения ценных бумаг. Особенности выпуска банком конвертируемых эмиссионных ценных бумаг. Выпуск банком собственных неэмиссионных ценных бумаг. Правовое регулирование операций банка по выпуску неэмиссионных ценных бумаг. Процедура выпуска банком собственных векселей. Виды векселей, выпускаемых коммерческим банком.

Преимущества банковских векселей и порядок их размещения банком. Процедура выпуска банком собственных сертификатов. Виды сертификатов, эмитируемых коммерческим банком. Порядок согласования условий выпуска и обращения банковских сертификатов в Банке России. Порядок размещения банковских сертификатов.

Тема 3. Инвестиционные операции банков на рынке ценных бумаг

Регулирование инвестиционных операций банков на рынке ценных бумаг: антимонопольное регулирование; регулирование, связанное с защитой прав инвесторов; регулирование собственных операций банков Центральным банком Российской Федерации как органом банковского регулирования и

надзора. Требования надзорных органов к организационной структуре банка в части операций с ценными бумагами.

Операции банка по купле-продаже ценных бумаг; размещению кредитов под залог приобретенных ценных бумаг; операции по реализации банком-инвестором прав, удостоверенных приобретенными ценными бумагами.

Операции банка с производными финансовыми инструментами. Ценные бумаги как объекты банковских инвестиций. Управление банковским портфелем ценных бумаг. Функции портфеля ценных бумаг банка (прирост стоимости портфеля, создание резерва ликвидности, обеспечение банку-инвестору возможности участия в управлении предприятиями и организациями).

Виды инвестиций банка в ценные бумаги. Прямые и портфельные инвестиции. Типы портфелей ценных бумаг банка: портфель роста, портфель дохода, портфель рискованного капитала, сбалансированный портфель, специализированный портфель. Торговый и инвестиционный портфели банка.

Переоценка вложений банка в ценные бумаги. Порядок создания резервов на возможные потери под вложения банка в ценные бумаги.

Тема 4. Профессиональная деятельность

Особенности оказания услуг банками на рынке ценных бумаг. Дилерская и брокерская деятельность. Договор комиссии. Договор поручения. Виды брокерских счетов для клиентов. Организация внутреннего и бухгалтерского учета брокерских и дилерских операций.

Деятельность банков по управлению ценными бумагами.

Индивидуальный договор доверительного управления ценными бумагами. Депозитарная деятельность. Условия осуществления банком депозитарной деятельности. Договор счета депо. Открытие и ведение счетов ДЕПО. Виды депозитарных операций. Внутренние документы депозитария банка.

Тема 5. Осуществление операций, связанных с обслуживанием рынка ценных бумаг

Виды операций банков, связанные с обслуживанием рынка ценных бумаг. Основы функционирования рынка государственных облигаций. Выполнение банком функций Дилера на организованном рынке ценных бумаг. Участие банков-Дилеров организованного рынка в проведении расчетов по итогам торгов ценными бумагами. Модели организации инвестиционной банковской деятельности в мировой практике. Операции инвестиционных банков в России. Оказание услуг эмитентам ценных бумаг по размещению и обслуживанию выпусков ценных бумаг.

Тема 6. Контроль за операциями кредитных организаций на рынке ценных бумаг

Контроль за операциями банка с ценными бумагами со стороны регулирующих органов. Внутренний контроль банка за операциями с ценными бумагами.

Контроль за профессиональной деятельностью банка со стороны саморегулируемых организаций на рынке ценных бумаг.

5.2 Учебно-тематический план

Таблица 2

№ п/п	Наименование темы (разделов) дисциплины	Трудоемкость в часах						Формы текущего контроля успеваемости
		Всего	Аудиторная работа				Самос тоятель ная работа	
			Общая	Лек- ции	Семи нары, практич еские занятия	Занятия в инте- рак- тивных формах		
1	Основы деятельности банков на современном рынке ценных бумаг России	21	3	1	2	2	18	Обсуждение вопросов, выступления, анализ фактического материала
2	Эмиссионная деятельность кредитных организаций	18,5	2,5	0,5	2	1	16	Обсуждение вопросов, выступления
3	Инвестиционные операции банков на рынке ценных бумаг	16,5	2,5	0,5	2	-	14	Обсуждение вопросов, решение

								практикоориен тированных задач
4	Профессиональная деятельность банков на рынке ценных бумаг	16,5	2,5	0,5	2	-	14	Обсуждение вопросов, решение практикоориен тированных задач, тестирование
5	Осуществление операций, связанных с обслуживанием рынка ценных бумаг	18,5	2,5	0,5	2	1	16	Обсуждение вопросов, решение практикоориен тированных задач, выступления
6	Контроль за операциями кредитных организаций на рынке ценных бумаг	17	3	1	2	-	14	Обсуждение вопросов, решение практикоориен тированных задач, тестирование
	В целом по дисциплине	108	16	4	12	4	92	Согласно учебному плану: контрольная работа
	Итого в %					25		

5.3. Содержание семинаров, практических занятий

Таблица 3

Наименование тем (разделов) дисциплины	Перечень вопросов для обсуждения на семинарских, практических занятиях, рекомендуемые источники из раздела 8	Формы проведения занятий
Основы деятельности банков на современном рынке ценных бумаг России	1. Характеристика российского фондового рынка. 2. Виды операций банков на рынке ценных бумаг. 3. Законодательно-нормативная база, регламентирующая операции банков с ценными бумагами в России. 4. -Участие банков в операциях на рынке ценных бумаг РФ Темы докладов: 1. Современные представления о функциях банков на рынке ценных бумаг. 2. Развитие роли коммерческих банков в механизмах функционирования фондового рынка: российский и зарубежный опыт. 3. Эволюция нормативно-правового регулирования операций коммерческих банков на рынке ценных бумаг.	Опрос по базовым понятиям. Презентация и доклады. Обсуждение докладов. Дискуссия.

	<p>4. Сравнительная характеристика операций банков на рынке ценных бумаг в дореволюционной и современной России.</p> <p>Рекомендуемые источники: 1-9</p>	
Эмиссионная деятельность кредитных организаций	<p>1. Правовое регулирование операций банка по выпуску эмиссионных ценных бумаг.</p> <p>2. Выпуск банком собственных эмиссионных ценных бумаг.</p> <p>3. Процедура выпуска банком собственных акций.</p> <p>4. Деятельность банка по обеспечению реализации прав инвесторов, удостоверяемых эмитированными банком акциями.</p> <p>5. Процедура выпуска банком собственных облигаций.</p> <p>6. Выпуск банком собственных неэмиссионных ценных бумаг.</p> <p>Темы докладов:</p> <p>1. Особенности нормативно-правового регулирования операций российских банков на рынке ценных бумаг.</p> <p>2. Ограничения деятельности российских банков на рынке ценных бумаг на современном этапе.</p> <p>Рекомендуемые источники: 1-9</p>	<p>Опрос по базовым понятиям.</p> <p>Презентация и доклады.</p> <p>Обсуждение докладов.</p> <p>Тестирование.</p>
Инвестиционные операции банков на рынке ценных бумаг	<p>1. Регулирование инвестиционных операций банков на рынке ценных бумаг.</p> <p>2. Операции банка по купле-продаже ценных бумаг.</p> <p>3. Виды инвестиций банка в ценные бумаги</p> <p>4. Управление банковским портфелем ценным бумагам.</p> <p>Рекомендуемые источники: 1-9</p>	<p>Опрос по базовым понятиям.</p> <p>Решение ситуационных задач.</p>
Профессиональная деятельность банков на рынке ценных бумаг	<p>1. Оказание услуг банками на рынке ценных бумаг.</p> <p>2. Дилерская и брокерская деятельность.</p> <p>3. Деятельность банков по управлению ценными бумагами.</p> <p>4. -Депозитарная деятельность.</p> <p>Рекомендуемые источники: 1-9</p>	<p>Опрос по базовым понятиям.</p> <p>Решение ситуационных задач.</p> <p>Тестирование.</p>
Осуществление операций, связанных с обслуживанием рынка ценных бумаг	<p>1. Виды операций банков, связанные с обслуживанием рынка ценных бумаг.</p> <p>2. Выполнение банком функций Дилера на организованном рынке.</p> <p>3. Инвестиционная банковская деятельность.</p> <p>Темы докладов:</p> <p>1. Проблемы и перспективы регулирования операций банков по формированию уставного капитала.</p> <p>2. Альтернативные инструменты формирования уставного капитала российских банков на современном этапе.</p> <p>3. Современная практика формирования уставного капитала коммерческого банка.</p> <p>4. Особенности выпуска банками конвертируемых эмиссионных ценных бумаг.</p> <p>Рекомендуемые источники: 1-9</p>	<p>Опрос по базовым понятиям.</p> <p>Презентация докладов.</p> <p>Обсуждение докладов.</p> <p>Решение ситуационных задач.</p>

Контроль за операциями кредитных организаций на рынке ценных бумаг	1. Контроль за операциями банка с ценными бумагами со стороны регулирующих органов. 2. Внутренний контроль банка. 3. Контроль за профессиональной деятельностью банка со стороны сорегулируемых организаций на рынке ценных бумаг. Рекомендуемые источники: 1-9	Опрос по базовым понятиям. Решение ситуационных задач. Тестирование.
--	---	--

6. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

6.1 Перечень вопросов, отводимых на самостоятельное освоение дисциплины, формы внеаудиторной самостоятельной работы

Таблица 4

Наименование тем (разделов) дисциплины	Указание разделов и тем, отводимых на самостоятельное освоение обучающимися	Формы внеаудиторной самостоятельной работы
Основы деятельности банков на современном рынке ценных бумаг России	1. Характеристика фондового рынка: участники и регуляторы. 2. Место и роль банков в функционировании рынка ценных бумаг в разных странах.	- работа с учебной, научной и справочной литературой; - изучение материалов интернет-ресурсов; - разбор вопросов по теме занятия из рабочей программы дисциплины, подготовка к групповой дискуссии; - подготовка научных докладов по указанной теме.
Эмиссионная деятельность кредитных организаций	1. Деятельность банка-эмитента по обеспечению реализации прав держателей банковских облигаций. 2. Порядок и формы раскрытия банком информации по ценным бумагам в случае публичного размещения ценных бумаг. 3. Особенности выпуска банком конвертируемых эмиссионных ценных бумаг. 4. Процедура выпуска банком собственных векселей.	- работа с учебной, научной и справочной литературой; - изучение материалов интернет-ресурсов; - разбор вопросов по теме занятия из рабочей программы дисциплины, подготовка к групповой дискуссии; - подготовка научных докладов по указанной теме.
Инвестиционные операции банков на рынке ценных бумаг	1. Управление банковским портфелем ценных бумаг. 2. Порядок создания резервов на возможные потери под вложения банка в ценные бумаги.	- работа с учебной, научной и справочной литературой; - изучение материалов интернет-ресурсов; - разбор вопросов по теме занятия из рабочей программы дисциплины, подготовка к групповой дискуссии.
Профессиональная деятельность	1. Организация внутреннего и бухгалтерского учета брокерских	- работа с учебной, научной и справочной литературой;

банков на рынке ценных бумаг	и дилерских операций. 2. Условия осуществления банком депозитарной деятельности. 3. Договор счета депо. 4. Внутренние документы депозитария банка.	- изучение материалов интернет-ресурсов; - разбор вопросов по теме занятия из рабочей программы дисциплины, подготовка к групповой дискуссии.
Осуществление операций, связанных с обслуживанием рынка ценных бумаг	1. Понятие структуры и стоимости капитала. 2. Модели оценки стоимости собственного капитала. 3. Средневзвешенная стоимость капитала. 4. Модели дивидендной политики. 5. Модели организации инвестиционной банковской деятельности в мировой практике.	- работа с учебной, научной и справочной литературой; - изучение материалов интернет-ресурсов; - разбор вопросов по теме занятия из рабочей программы дисциплины, подготовка к групповой дискуссии; - подготовка научных докладов по указанной теме.
Контроль за операциями кредитных организаций на рынке ценных бумаг	1. Внутренний контроль банка за операциями с ценными бумагами.	- работа с учебной, научной и справочной литературой; - изучение материалов интернет-ресурсов; - разбор вопросов по теме занятия из рабочей программы дисциплины, подготовка к групповой дискуссии.

6.2. Перечень вопросов, заданий, тем для подготовки к текущему контролю

Тематика докладов

1. Современные представления о функциях банков на рынке ценных бумаг.
2. Развитие роли коммерческих банков в механизмах функционирования фондового рынка: российский и зарубежный опыт.
3. Эволюция нормативно-правового регулирования операций коммерческих банков на рынке ценных бумаг.
4. Сравнительная характеристика операций банков на рынке ценных бумаг в дореволюционной и современной России.
5. Особенности нормативно-правового регулирования операций российских банков на рынке ценных бумаг.
6. Ограничения деятельности российских банков на рынке ценных бумаг

на современном этапе.

7. Проблемы и перспективы регулирования операций банков по формированию уставного капитала.

8. Альтернативные инструменты формирования уставного капитала российских банков на современном этапе.

9. Современная практика формирования уставного капитала коммерческого банка.

10. Особенности выпуска банками конвертируемых эмиссионных ценных бумаг.

Темы контрольных работ

1. Особенности организации выпуска акций и облигаций коммерческими банками в условиях финансового кризиса.

2. Современные представления о выпуске коммерческим банком долговых ценных бумаг.

3. Ценные бумаги как объекты банковских инвестиций. Ценные бумаги, приобретаемые российскими банками.

4. Управление банковским портфелем ценных бумаг коммерческого банка. Структура портфеля ценных бумаг банков РФ.

5. Особенности управления портфелем ценных коммерческого банка в условиях финансового кризиса.

6. Развитие практики операций коммерческих банков с векселями.

7. Тенденции развития профессиональной деятельности коммерческих банков на рынке ценных бумаг.

8. Особенности деятельности коммерческих банков в качестве маркетмейкеров на российском рынке ценных бумаг.

9. Современные механизмы проведения российскими банками операций по доверительному управлению ценными бумагами.

10. Сравнительная характеристика трастовых операций и доверительного управления коммерческими банками РФ.

11. О роли банков в системе учета прав на ценные бумаги: российский и

зарубежный опыт.

12. Современные подходы к учету операций с ценными бумагами в коммерческом банке.

13. Тенденции развития операций российских банков в области инвестиционного банкинга.

14. Система раскрытия коммерческим банком информации по операциям с ценными бумагами.

15. Организация оптимальной системы контроля в коммерческом банке за операциями на рынке ценных бумаг.

Критерии балльной оценки различных форм текущего контроля

Заочная форма обучения

Вид учебной деятельности	Баллы	Примечание
Выступление по вопросу на семинарском занятии	До 2	В течение семестра
Аудиторная проверочная работа	До 5	
Тестирование по материалу темы	До 5	
Доклад с презентацией по заданной теме	До 4	
Контрольная работа	До 16	
Посещаемость	До 8	
	40	За семестр

Устанавливается следующее соответствие посещаемости занятий (% от общего числа академических часов по учебной дисциплине) баллам балльно-рейтинговой системы:

посещение 81-100% учебных занятий – 8 балла

посещение 51 - 80% учебных занятий – 4 балла

посещение менее 50 % учебных занятий – 0 баллов

7. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

Перечень компетенций с указанием индикаторов их достижения в процессе освоения образовательной программы

Перечень компетенций, формируемых в процессе освоения дисциплины, содержится в разделе 2 РПД «Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине с указанием индикаторов их достижения и планируемых результатов обучения».

**Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые
для оценки индикаторов достижения компетенций, умений и знаний**

***Примеры оценочных средств для проверки компетенций,
формируемых дисциплиной***

<u>компетенци я</u>	<u>типовые задания</u>
<p>ДКН-2 Способность формировать финансовую и инвестиционн ую политику, разрабатывать бизнес-планы, моделировать экономически е процессы, использовать современные информацион ные технологии и пакеты прикладных программ для решения практических задач</p>	<p>1. Самостоятельно разрабатывает финансовую и инвестиционную политику организации</p> <p align="center">Задание 1</p> <p>Ответьте на вопрос: Дайте характеристику деятельности банков как инвесторов на рынке ценных бумаг.</p> <p align="center">Задание 2</p> <p>1. Кредитные организации как профессиональные участники рынка ценных бумаг получают лицензии: А. Центрального банка Российской Федерации; Б. Федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг; В. лицензию профессионального участника рынка ценных бумаг; Г. лицензию на осуществление деятельности по ведению реестра; Д. лицензию фондовой биржи.</p> <p>2. Проводя брокерские операции, коммерческий банк выступает в качестве: А. эмитента; Б. финансового посредника; В. инвестора; Г. кредитора.</p> <p>3. Банки могут выпускать акции следующих видов: А. именные документарные; Б. именные бездокументарные; В. на предъявителя документарные; Г. обыкновенные и привилегированные; Д. акции с указанием их номинальной стоимости в иностранной валюте.</p> <p align="center">Задание 3</p> <p>Дан инвестиционный портфель, который имеет следующую структуру:</p> <ul style="list-style-type: none"> ОФЗ-ПД №26002: номинал – 1000 руб., курс – 98,77, купонная доходность – 28% годовых, купонный период – 182 дня, количество дней до выплаты купона – 119, срок до погашения – 301 день, количество облигаций – 10 шт. Дисконтный вексель ПАО «Газпром»: номинал – 500000 руб., курс – 94,03346, срок до погашения – 160 дней, количество – 1 шт. Дисконтные векселя ПАО «Сбербанк»: номинал – 500000 руб., курс – 88,85073, срок до погашения – 41 день, количество – 2 шт. ГКО №21139RMFS9: номинал – 1000 руб., курс – 99,01, число дней до погашения – 14, количество – 1 шт. <p>а) Определите текущую стоимость портфеля. б) Рассчитайте доходность портфеля на основе простой процентной ставки.</p> <p>2. Использует современные информационные технологии и пакеты прикладных программ для разработки бизнес-планов, решения практических задач</p> <p align="center">Задание 1</p> <p>Ответьте на вопрос: Дайте характеристику функций и инструментов MS Excel для решения задач управления банковским портфелем ценных бумаг. Приведите структуру фондового портфеля банков Российской Федерации</p> <p align="center">Задание 2</p>

1. Банковские векселя:
 - А. являются эмиссионными ценными бумагами;
 - Б. предполагают выплату дивидендов их владельцам;
 - В. могут выпускаться сроком платежа «по предъявлении» и сроком платежа «на определенный день»;
 - Г. выпускаются в рублях и в иностранной валюте;
 - Д. могут передаваться по индоссаменту.
2. Наиболее распространенный вид собственных долговых обязательств банка в Российской Федерации:
 - А. сберегательный сертификат;
 - Б. депозитный сертификат;
 - В. облигация;
 - Г. простой вексель;
 - Д. переводной вексель.
3. Для оценки инвестиционного портфеля применяются следующие показатели:
 - А. текущая стоимость портфеля;
 - Б. доходность портфеля;
 - В. дисперсия портфеля;
 - Г. эмиссионная стоимость портфеля;
 - Д. дюрация портфеля.

Задание 3

Коммерческий банк решил сформировать инвестиционный портфель из трех типов государственных облигаций: ГКО №21139RMFS9, ОФЗ-ПД №25021RMFS5; ОФЗ-ФД №27001RMFS5. На вторичных торгах этих облигаций составил 98,68%, 91,5%, 78,99% соответственно.

а) Рассчитайте расходы банка по формированию портфеля (без учета комиссий и других дополнительных затрат), если структура портфеля должна выглядеть следующим образом: ГКО – 1000 шт.; ОФЗ-ПД – 2000 шт.; ОФЗ-ФД – 100000 шт.

б) Рассчитайте доходность данного портфеля.

Параметры соответствующих облигаций представлены в таблице.

Параметры ОФЗ-ПД №25021RMFS5

Номинал – 1000 руб.

Дата аукциона или дата выплаты купона	Номер купонного периода	Купонный период	Величина купона, % годовых	Объявленный купон, руб.
21.01.16	-	-	-	-
21.07.16	1	182	15	74,79
20.01.16	2	182	15	74,79
21.07.16	3	182	15	74,79
19.01.17	4	182	15	74,79
19.07.17	5	182	15	74,79
17.01.18	6	182	15	74,79

Параметры ОФЗ-ФД №27001RMFS5

Номинал – 10 руб.

Дата аукциона или дата выплаты купона	Номер купонного периода	Купонный период	Величина купона, % годовых	Объявленный купон, руб.
19.08.16				
10.02.17	1	175	30	1,44
12.05.17	2	91	30	0,75
11.08.17	3	91	30	0,75
10.11.17	4	91	25	0,62
09.02.18	5	91	25	0,62
10.05.18	6	91	25	0,62

Подкрепите свои рассуждения соответствующими моделями расчетов в среде MS Excel.

Вопросы для подготовки к зачету

1. Рынок ценных бумаг: понятие, классификация, правовое регулирование.
2. Правовое регулирование операций банка с ценными бумагами.
3. Виды деятельности банков на рынке ценных бумаг.
4. Виды деятельности банков как профессиональных участников рынка ценных бумаг.
5. Управление банковским портфелем ценных бумаг. Структура фондового портфеля банков Российской Федерации.
6. Деятельность банков как эмитентов на рынке ценных бумаг.
7. Деятельность банков как инвесторов на рынке ценных бумаг.
8. Процедура эмиссии акций коммерческого банка.
9. Требования, предъявляемые к акциям банка.
10. Процедура выпуска банками эмиссионных ценных бумаг.
11. Процедура выпуска банками неэмиссионных ценных бумаг.
12. Процедура выпуска банками собственных облигаций.
13. Процедура выпуска банками сберегательных сертификатов.
14. Процедура выпуска банками депозитных сертификатов.
15. Процедура выпуска банками собственных векселей.
16. Процедура выпуска банками собственных долговых обязательств.
17. Виды облигаций коммерческого банка.
18. Виды банковских векселей. Достоинства и недостатки банковского векселя.
19. Виды банковских сертификатов. Достоинства и недостатки банковских сертификатов.
20. Деятельность банка в качестве брокера на рынке ценных бумаг.
21. Деятельность банка в качестве дилера на рынке ценных бумаг.
22. Деятельность банка по доверительному управлению ценными бумагами.

23.Депозитарная деятельность банка как профессионального участника рынка ценных бумаг.

24.Совмещение видов профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг.

25.Ценные бумаги как объекты банковских инвестиций.

26.Типы портфелей ценных бумаг коммерческого банка.

27.Управление фондовым портфелем банка в современных условиях Российской Федерации.

28.Государственное регулирование инвестиционной деятельности банка на рынке ценных бумаг.

29.Переоценка вложений банка в ценные бумаги. Отражение ее результатов в учете банка.

30.Резервы на возможные потери под вложения банка в ценные бумаги.

31.Сравнительная характеристика выпуска банком собственных акций и векселей.

32.Сравнительная характеристика выпуска банком собственных векселей и сберегательных (депозитных) сертификатов.

33.Отличия в деятельности банка на рынке ценных бумаг в качестве брокера и дилера.

34.Отличия трастовых операций от операций доверительного управления.

35.Порядок и формы раскрытия банком информации по ценным бумагам в случае публичного размещения ценных бумаг.

36.Особенности выпуска банком конвертируемых эмиссионных ценных бумаг.

Соответствующие приказы, распоряжения ректората о контроле уровня освоения дисциплин и сформированности компетенций студентов

Приказ от 23.03.2017 №0557/о «Об утверждении Положения о проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся по программам бакалавриата и магистратуры в Финансовом университете».

Приказ от 28.04.2018 №0982/о «О внесении изменений в Положение о проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся по программам бакалавриата и магистратуры в Финансовом университете».

8. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

Нормативно-правовые акты

1. Федеральный закон «О Центральном Банке Российской Федерации (Банке России)» от 10.07.2002 №86-ФЗ (в действующей редакции).
2. Федеральный закон «О валютном регулировании и валютном контроле» от 10.12.2003г. №173-ФЗ 12 (в действующей редакции).
3. Федеральный закон от 22 апреля 1996 г. N 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг» (в действующей редакции).
4. Федеральный закон от 26 декабря 1995 г. N 208-ФЗ «Об акционерных обществах» (в действующей редакции).
5. Федеральный закон от 11 марта 1997 г. N 48-ФЗ «О переводном и простом векселе» (в действующей редакции).
6. Федеральный закон от 29 июля 1998 г. N 136-ФЗ «Об особенностях эмиссии и обращения государственных и муниципальных ценных бумаг» (ред. от 26.04.2007) (в действующей редакции).

Основная литература

1. Банковское дело: учебник/ под ред. О.И. Лаврушина. – М.: КноРус, 2013, 2016. – 800 с. (ЭБС Book.ru).
2. Банковский менеджмент: учебник/ под ред. О.И. Лаврушина. – 4-е изд., перераб. и доп. – М.: Кнорус, 2015, 2016. – 554 с. (ЭБС Book.ru).
3. Банковские операции: учебник. Ч. 1 / Н.Н. Мартыненко, О.М. Маркова, О.С. Рудакова, Н.Э. Соколинская. – М.: КноРус, 2018. – 295 с. (ЭБС Book.ru).

Дополнительная литература

4. Ковалева Н.А. Деятельность банка на рынке ценных бумаг: учеб.

пособие / Н.А. Ковалева. – М.: КноРус, 2019. – 222 с. (ЭБС Book.ru).

5. Операции банков с ценными бумагами. Валютные и сопутствующие операции: учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / Д. Г. Алексеева [и др.]; отв. ред. Д.Г. Алексеева, С.В. Пыхтин. — М.: Юрайт, 2019. – 182 с. (ЭБС Юрайт).

6. Теплова Т.В. Инвестиции: в 2 ч. Ч. 1: учебник и практикум для академического бакалавриата/ Т.В. Теплова. – 2-е изд., перераб. и доп. – М.: Юрайт, 2017. – 409 с. (ЭБС Юрайт).

7. Теплова Т.В. Инвестиции: в 2 ч. Ч. 2: учебник и практикум для академического бакалавриата/ Т.В. Теплова. – 2-е изд., перераб. и доп. – М.: Юрайт, 2017. – 382 с. (ЭБС Юрайт).

8. Шарп У. Инвестиции/ У. Шарп, Г. Александер, Бэйли, Дж.; пер. с англ. – М.: Инфра-М, 2016. – 1040 с. (ЭБС Znanium.com).

9. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины

1. <http://soc.lib.ru/books.htm>

2. http://www.ecsoc.ru/books_description_ru/php

3. Портал «Экономика, Социология, Менеджмент» <http://www.ecsocman.edu.ru> См. «Журнальный зал» портала, а также другие рубрики

4. Электронно-библиотечная система издательства «ЮРАЙТ» <https://www.biblio-online.ru/>

5. Электронно-библиотечная система Znanium <http://www.znanium.com>

10. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Для управления самостоятельной работой студентов используются следующие формы контроля:

- тематические консультации, в ходе которых студенты осмысливают

полученную информацию, преподаватель определяет степень понимания темы и оказывает необходимую помощь;

- следящий контроль осуществляется на лекциях и практических занятиях, который проводится в форме бесед, устных ответов студентов, проверочных работ, тестов, организации дискуссий, опросов;

- текущий контроль осуществляется в ходе проверки и анализа отдельных видов самостоятельных работ, выполненных во внеаудиторное время;

- написание контрольной работы;

- промежуточный контроль осуществляется через зачет, предусмотренный учебным планом.

Методические рекомендации по освоению лекционного материала

Для более эффективного изучения теоретического курса дисциплины студентам рекомендуется ведение конспекта лекций, документирования результатов самостоятельной работы и фиксации практических примеров, рассматриваемых в ходе проведения лекционных занятий.

Ведение конспекта лекций позволит студенту всегда иметь под рукой краткий справочник по изучаемой дисциплине, так как при подготовке материалов лекций использовано большое количество различных источников информации, на поиск и изучение которых может потребоваться много времени. Кроме того, конспект также может быть использован студентом:

- при подготовке к семинарским занятиям;

- при выполнении тестов и заданий по разделам и темам дисциплины, составленным для самостоятельной работы;

- в ходе подготовки и выполнения аудиторной работы;

- в процессе подготовки к зачету;

- в практической деятельности; материалы лекций могут помочь молодому специалисту решать на первых этапах карьерного роста задачи, поставленные руководством компании-работодателя.

После проведения лекционного занятия по той или иной теме рекомендуется самостоятельно изучить (проработать) данную тему с

использованием основной и дополнительной литературы и внесением дополнений (например: схем, рисунков, диаграмм) и пояснений в конспект лекций.

Планирование проведения занятий в интерактивной форме (дискуссия)

Дискуссия по презентации, сделанной докладчиком, с обязательными выступлениями назначенных и инициативных дискуссантов.

Доклад (презентация) должен содержать анализ:

- 1) имеющихся точек зрения по вопросу, а также личного отношения автора к этим точкам зрения;
- 2) методов исследований;
- 3) обзор состояния фактологической базы.

Ведущим семинара по конкретной теме является преподаватель. Ведущий семинара осуществляет подбор и назначение дискуссантов, курирует подготовку доклада и организует содержательный ход дискуссии. Ведущий также подводит итоги и оценивает качество участия докладчика и дискуссантов.

Методические указания по выполнению внеаудиторной самостоятельной работы

Самостоятельная работа студентов – это средство вовлечения студента в самостоятельную познавательную деятельность, формирующую у него психологическую потребность в систематическом самообразовании.

Основные задачи самостоятельной работы:

- развитие и привитие навыков студентам самостоятельной учебной работы и формирование потребностей в самообразовании;
- освоение содержания дисциплины в рамках тем, выносимых на самостоятельное изучение студента;
- осознание, углубление содержания и основных положений курса в ходе конспектирования материала на лекциях, отработки в ходе подготовки к семинарским и практическим занятиям;

- использование материала, собранного и полученного в ходе самостоятельных занятий, при написании работ, для эффективной подготовки к зачету.

В учебном процессе выделяют два вида самостоятельной работы: аудиторная и внеаудиторная. Аудиторная самостоятельная работа по дисциплине выполняется на учебных занятиях под непосредственным руководством преподавателя и по его заданиям. Внеаудиторная самостоятельная работа выполняется студентом по заданию преподавателя, но без его непосредственного участия.

В рамках изучения дисциплины используются следующие виды заданий для самостоятельной работы:

- самостоятельное изучение темы теоретического курса;
- подготовка устных ответов на вопросы темы;
- подготовка к практическим занятиям;
- подготовка докладов;
- подготовка к тестовым заданиям по усвоению материала;
- решение ситуационных задач.

Методические рекомендации по подготовке доклада группой

Для подготовки доклада студентам необходимо:

1. Распределить работы по подготовке доклада между участниками группы, отладить механизмы координации работ.
2. Изучить существующую основную литературу по данной теме.
3. В форме тезисов оформить наиболее важные и интересные теории, факты, примеры по данной теме.
4. Оформить доклад в письменной форме, выделив в нем: вступление, основной материал, иллюстрационные примеры, выводы.
5. Подготовить раздаточный материал и презентацию в электронном виде.
6. Определить основного докладчика и участие в этом процессе остальных членов группы.

Работа должна состоять из нескольких частей:

1. Введения, в котором обосновывается актуальность темы, определяется цель работы и задачи, объект и предмет исследования.
2. Основной части: анализ существующих материалов из печатных и электронных источников информации по заданной теме;
3. Заключение, которое включает основные выводы и результаты.

Методические указания по выполнению контрольной работы

Учебным планом дисциплины предусмотрено выполнение контрольной работы. Контрольная работа – одна из форм обучения и контроля знаний студентов и допуска к сдаче зачета по дисциплине. Она является эффективным средством усвоения учебного материала, овладения знаниями по изучаемому предмету, умения работать с источниками.

Структура контрольной работы включает следующие компоненты:

- титульный лист;
- содержание;
- введение;
- основную часть;
- заключение;
- перечень использованной литературы.

Во введении обосновывается актуальность выбранной темы.

В основной части необходимо осветить те или иные стороны проблемы. Материал основной части рекомендуется излагать в форме параграфов. Вначале излагается теоретический материал: описываются рабочие термины, рассматриваются имеющиеся в научной литературе теоретические концепции, важные положения, аспекты. Затем приводятся фактические данные: наблюдения специалистов, наблюдения студента. Хорошо, если удастся критически проанализировать и сопоставить теоретические и фактические данные. В заключении формулируются выводы, дается оценка проведенного анализа, изученного материала.

Контрольная работа оформляется на стандартной бумаге формата А4

компьютерным способом. Шрифт Times New Roman, размер – 14, зеркальные поля. Объем – 10-15 с. Нумерация – по центру внизу. Список литературы составляется в алфавитном порядке методом библиографического описания по ГОСТу. В случае использования материалов Интернет необходимо указывать электронные сайты. В тексте в случае использования цитат необходимо делать сноски с указанием библиографических данных и соответствующей страницы. Титульный лист оформляется в соответствии с образцами, представленными в УМК.

11. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень необходимого программного обеспечения и информационных справочных систем

Комплект лицензионного программного обеспечения:

Windows Microsoft Office

Антивирус ESET Endpoint Security

Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы:

Консультант Плюс

Гарант

Электронная библиотека eLIBRARY

12. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине

В соответствии с требованиями ОС ВО Финуниверситета в число необходимых условий для осуществления учебной деятельности включаются:

1) аудитории для проведения лекций, семинарских занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, которые оснащены компьютером и видеопроектором для демонстрации слайд-презентаций, укомплектованы специализированной мебелью и техническими средствами обучения, служащими для представления информации большой аудитории;

2) помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду организации.


Обучающимся и педагогическим работникам обеспечен доступ (удаленный доступ) к современным профессиональным базам данных (в том числе международным реферативным базам данных научных изданий) и информационным справочным системам.

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ БЮДЖЕТНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
**ФИНАНСОВЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПРИ ПРАВИТЕЛЬСТВЕ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**

АЛТАЙСКИЙ ФИЛИАЛ

УТВЕРЖДАЮ

Директор филиала

 В.А. Иванова

«02» сентября 2020 г.

ПРИЛОЖЕНИЕ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ
Операции коммерческого банка на рынке ценных бумаг

(наименование дисциплины)

Направление подготовки

38.04.02 «Менеджмент»

Профиль(и)/направленность

**Финансовый менеджмент и рынок
капиталов**

Ответственный за актуализацию
РПД

Е.А. Маслихова

Год утверждения РПД

2018

СОДЕРЖАНИЕ ПРИЛОЖЕНИЯ

1. Объем дисциплины в зачетных единицах и в академических часах
выделением объема аудиторной (лекции, семинары) и самостоятельн
работы обучающихся 3
2. Перечень основной и дополнительной учебной литературы,
необходимой для освоения дисциплины..... 3

1. Объем дисциплины в зачетных единицах и в академических часах с выделением объема аудиторной (лекции, семинары) и самостоятельной работы обучающихся

Вид учебной работы по дисциплине	Всего (в з.е. и часах)	Модуль 8 (в часах)
Общая трудоёмкость дисциплины	3 з.е. (108 ч.)	108
Контактная работа - Аудиторные занятия	16	16
<i>Лекции</i>	4	4
<i>Семинары, практические занятия</i>	12	12
Самостоятельная работа	92	92
Вид текущего контроля	Контрольная работа	Контрольная работа
Вид промежуточной аттестации	зачёт	зачёт

2. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

Основная

1. Банковские операции: учебник. Ч. 1 / Н.Н. Мартыненко, О.М. Маркова, О.С. Рудакова, Н.Э. Соколинская. – Москва: КноРус, 2018. – 295 с. – URL: <https://book.ru/book/930239>
2. Банковский менеджмент: учебник/ под ред. О.И. Лаврушина. – 5-е изд., перераб. и доп. – Москва: Кнорус, 2019. – 414 с.— URL: <https://book.ru/book/932496>
3. Банковское дело: учебник/ под ред. О.И. Лаврушина. – Москва: КноРус, 2014, 2018. – 800 с. – URL: <https://book.ru/book/925842>
4. Янина, О.Н. Деятельность банков на рынке ценных бумаг : учебное пособие / Янина О.Н. – Москва : Русайнс, 2019. – 197 с. – ISBN 978-5-4365-4452-6. – URL: <https://book.ru/book/934551>

Дополнительная

5. Фабоцци, Ф. Д. Рынок облигаций: Анализ и стратегии / Фабоцци Ф.Д., - 2-е изд. – Москва : Альпина Паблишер, 2016. – 950 с.: ISBN 5-9614-

0468-4. – Текст : электронный. – URL:
<https://znanium.com/catalog/product/923727>

6. Ковалева Н.А. Деятельность банка на рынке ценных бумаг: учебное пособие / Н.А. Ковалева. – Москва: КноРус, 2019. – 222 с. – URL: <https://book.ru/book/931004>

7. Операции банков с ценными бумагами. Валютные и сопутствующие операции: учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / Д. Г. Алексеева и др.; под ред. Д.Г. Алексеева, С.В. Пыхтин. – Москва: Юрайт, 2019. – 182 с. – URL: <https://urait.ru/bcode/437621>

8. Теплова Т.В. Инвестиции: в 2 ч. Ч. 1: учебник и практикум для академического бакалавриата/ Т.В. Теплова. – 2-е изд., перераб. и доп. – Москва: Юрайт, 2019. – 409 с. – URL: <https://urait.ru/bcode/434189>

9. Теплова Т.В. Инвестиции: в 2 ч. Ч. 2: учебник и практикум для академического бакалавриата/ Т.В. Теплова. – 2-е изд., перераб. и доп. – Москва: Юрайт, 2019. – 382 с. – URL: <https://urait.ru/bcode/434190>

10. Шарп У. Инвестиции/ У. Шарп, Г. Александер, Бэйли, Дж.; пер. с англ. – Москва: Инфра-М, 2019. – XII, 1028 с. – URL: <https://znanium.com/catalog/product/1023723>