

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации

ФИО: Макуев Валентин Анатольевич

Мытищинский филиал

Должность: Заместитель директора по учебной работе

федерального государственного бюджетного образовательного учреждения высшего

Дата подписания: 14.07.2024 15:00:31

Уникальный программный ключ:

образования «Московский государственный технический университет имени Н. Э. Баумана

a0887579b7e63594c87851bc1bb030c7c4482fa1

(национальный исследовательский университет)»

(МФ МГТУ им. Н.Э. Баумана)



Заместитель директора

по учебной работе

МФ МГТУ им. Н.Э. Баумана

Макуев В.А.

«25» июня 2021 г.

Факультет К «Космический факультет»

Кафедра К4 «Экономика и управление»

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Основы портфельного инвестирования

Автор программы:

Белякова Е.И., доцент (к.н.), кандидат экономических наук, ebelyakova@bmstu.ru

Утверждена на заседании кафедры «Экономика и управление»
Протокол № 10 заседания кафедры «К4» от 09.06.2021 г.

Начальник Отдела образовательных программ
Шевлякова А.А



Рабочая программа одобрена на 2022/2023 учебный год.
Протокол № 8 заседания кафедры «К4» от 15.04.2022 г.
Лист переутверждения рабочей программы дисциплины / практики.

Рабочая программа одобрена на 2023/2024 учебный год.
Протокол № 8 заседания кафедры «К4» от 17.04.2023 г.
Лист переутверждения рабочей программы дисциплины / практики.

Рабочая программа одобрена на 2024/2025 учебный год.
Протокол № 9 заседания кафедры «К4» от 16.04.2024 г.
Лист переутверждения рабочей программы дисциплины / практики.

ОГЛАВЛЕНИЕ

	с.
1. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю), соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы.....	4
2. Место дисциплины в структуре образовательной программы.....	6
3. Объем дисциплины	7
4. Содержание дисциплины, структурированное по модулям учебной дисциплины с указанием отведенного на них количества академических или астрономических часов и видов учебных занятий	8
5. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов	15
6. Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации студентов по дисциплине.....	16
7. Перечень учебной литературы и дополнительных материалов, необходимых для освоения дисциплины	17
8. Перечень ресурсов сети интернет, рекомендуемых для самостоятельной работы при освоении дисциплины.....	18
9. Методические указания для студентов по освоению дисциплины.....	19
10. Перечень информационных технологий, используемых при изучении дисциплины, включая перечень программного обеспечения, информационных справочных систем и профессиональных баз данных	20
11. Описание материально-технической базы, необходимой для изучения дисциплины..	21

1. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ), СООТНЕСЕННЫЕ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Настоящая рабочая программа дисциплины устанавливает требования к знаниям и умениям студента, а также определяет содержание и виды учебных занятий и отчетности.

Программа разработана в соответствии с:

- Самостоятельно устанавливаемым образовательным стандартом (СУОС 3++) по направлению подготовки (уровень бакалавриата): 38.03.01 «Экономика»;
- Основной профессиональной образовательной программой по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика»;
- Учебным планом МГТУ им. Н.Э. Баумана по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика».

При освоении дисциплины планируется формирование компетенций, предусмотренных ОПОП на основе СУОС 3++ по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика» (уровень бакалавриата)

Код компетенции по СУОС 3++	Формулировка компетенции
Профессиональные компетенции собственные	
ПКС-4 (38.03.01/32 Финансы и кредит)	Способен разрабатывать мероприятия по воздействию на риск в разрезе отдельных видов и осуществлять их экономическую оценку
ПКС-6 (38.03.01/32 Финансы и кредит)	Способен проводить мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, страхования и недвижимости

Для категорий «знать, уметь, владеть» планируется достижение результатов обучения (РО), вносящих на соответствующих уровнях вклад в формирование компетенций, предусмотренных основной профессиональной образовательной программой (табл. 1).

Таблица 1. Индикаторы достижения компетенции

1	2	3
Компетенция: код по СУОС 3++, формулировка	Индикаторы	Формы и методы обучения, способствующие формированию и развитию компетенции
<p>ПКС-4 (38.03.01/32 Финансы и кредит) Способен разрабатывать мероприятия по воздействию на риск в разрезе отдельных видов и осуществлять их экономическую оценку</p>	<p>ЗНАТЬ - инструменты анализа существующих методов контроля рисков, управления рисками и их достаточности; инструментарий анализа последствий рисков</p>	<p>Лекции Семинары Самостоятельная работа Активные и интерактивные формы (методы) обучения: обсуждение практических примеров на лекциях и семинарах</p>
<p>ПКС-6 (38.03.01/32 Финансы и кредит) Способен проводить мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, страхования и недвижимости</p>	<p>ЗНАТЬ - конъюнктуру и механизмы функционирования финансовых рынков УМЕТЬ - осуществлять информационно-аналитический анализ и оценку рынка банковских, финансовых продуктов и услуг - получать, интерпретировать и документировать результаты исследований - проводить мониторинг источников финансовой информации ВЛАДЕТЬ - методами экономической диагностики рынка банковских и финансовых услуг - навыками проведения исследования финансового рынка и методами изучения предложений финансовых услуг, в том числе действующих правил и условий, тарифной политики и действующих форм документации</p>	<p>Лекции Семинары Самостоятельная работа Активные и интерактивные формы (методы) обучения: обсуждение практических примеров на лекциях и семинарах</p>

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Дисциплина входит в блок Б1 «Дисциплины (модули)» образовательной программы бакалавриата по направлению 38.03.01 «Экономика».

Изучение дисциплины предполагает предварительное освоение следующих дисциплин учебного плана:

- Финансовые вычисления;
- Финансы.

Освоение данной дисциплины необходимо как предшествующее для следующих дисциплин образовательной программы:

- Управление рисками;
- Финансовый менеджмент.

Освоение учебной дисциплины связано с формированием компетенций с учетом матрицы компетенций ОПОП для направления (уровень бакалавриата): 38.03.01 Экономика.

3. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ

Общий объем дисциплины составляет 4 зачетные единицы(з.е.), 144 академических часа (108 астрономических часов). В том числе: 1 семестр – 4 з.е. (144 ак.ч.).

Таблица 2. Объём дисциплины по видам учебных занятий (в академических часах)

Виды учебной работы	Объем по семестрам, акад. ч.	
	Всего	Количество семестров освоения дисциплины
		1
Объем дисциплины	144	144
Аудиторная работа*	72	72
Лекции (Л)	36	36
Семинары (С)	36	36
Самостоятельная работа (СР)	72	72
Проработка учебного материала лекций	4.5	4.5
Подготовка к семинарам	4.5	4.5
Подготовка к контрольной работе	6	6
Подготовка к рубежному контролю	3	3
Другие виды самостоятельной работы	54	54
Вид промежуточной аттестации		Зачёт

*в том числе, в форме практической подготовки

4. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ, СТРУКТУРИРОВАННОЕ ПО МОДУЛЯМ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ С УКАЗАНИЕМ ОТВЕДЕННОГО НА НИХ КОЛИЧЕСТВА АКАДЕМИЧЕСКИХ ИЛИ АСТРОНОМИЧЕСКИХ ЧАСОВ И ВИДОВ УЧЕБНЫХ ЗАНЯТИЙ

Таблица 3. Содержание дисциплины

№ п/п	Тема (название) модуля	Виды занятий*, часы				Активные и интерактивные формы проведения занятий		Компетенции, закрепленные за темой (код по СУОС 3++)	Текущий контроль результатов обучения		
		Л	С	ЛР	СР	Форма проведения занятий	Часы		Срок (неделя)	Формы	Баллы (мин/макс)
1 семестр											
1	Портфельные инвестиции	12	12	0	24	обсуждение практических примеров на лекциях и семинарах	4	ПКС-4, ПКС-6	6	Контрольная работа	18/30
										ИТОГО:	18/30
2	Ценные бумаги и производные финансовые инструменты: характеристика и доходность.	12	12	0	24	обсуждение практических примеров на лекциях и семинарах	4	ПКС-4, ПКС-6	12	Контрольная работа	18/30
										ИТОГО:	18/30
3	Профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг	12	12	0	24	обсуждение практических примеров на лекциях и семинарах	4	ПКС-4, ПКС-6	18	Рубежный контроль	24/40
										ИТОГО:	24/40
	ИТОГО за семестр	36	36	0	72	-	12	-	-	-	60/100

*в том числе, в форме практической подготовки

Содержание дисциплины, структурированное по темам (модулям)

№, п/п	Наименование модуля, содержание	Часы
1	«Портфельное инвестирование»	
	Лекции	12
1.1	Инвестиционный портфель Понятие инвестиционного портфеля, типы портфеля, принципы и этапы формирования. Классификация инвестиций. Портфельные инвестиции. Цель формирования портфеля ценных бумаг. Доход. Тип инвестора и тип портфеля.	2
1.2	Доходность и риск по портфелю Общий обзор по доходности и рискам. Текущая и полная доходность. Систематический и несистематический риски. Диверсификация. Хеджирование.	2
1.3	Модели формирования портфеля Модель Блека. Модель Шарпа. Модель Марковица. Характеристика сути, графики и математический аппарат.	2
1.4	Стратегия управления портфелем Активная и пассивная стратегия управления портфелем. Анализ ценных бумаг. Портфельный анализ. Этапы инвестиционного процесса.	2
1.5	Рынок ценных бумаг и его структура Сущность и история развития рынка ценных бумаг. Рынок ценных бумаг и его структура: первичный и вторичный, биржевой и внебиржевой рынки. Первичный рынок ценных бумаг и его характеристика. Вторичный биржевой рынок. Участники рынка ценных бумаг:	2
1.6	Государственное регулирование рынка ценных бумаг Органы государственного надзора, законодательно-правовая база регулирования, национальные особенности регулирования рынка. Формы и задачи государственного регулирования.	2
	Семинары	12
С1.1	Инвестиционный портфель Понятие инвестиционного портфеля, типы портфеля, принципы и этапы формирования. Классификация инвестиций. Портфельные инвестиции. Цель формирования портфеля ценных бумаг. Доход. Тип инвестора и тип портфеля.	2
С1.2	Доходность и риск по портфелю Общий обзор по доходности и рискам. Текущая и полная доходность. Систематический и несистематический риски. Диверсификация. Хеджирование.	2
С1.3	Модели формирования портфеля Модель Блека. Модель Шарпа. Модель Марковица. Характеристика сути, графики и математический аппарат.	2
С1.4	Стратегия управления портфелем Активная и пассивная стратегия управления портфелем. Анализ ценных бумаг. Портфельный анализ. Этапы инвестиционного процесса.	2
С1.5	Рынок ценных бумаг и его структура	2

	Сущность и история развития рынка ценных бумаг. Рынок ценных бумаг и его структура: первичный и вторичный, биржевой и внебиржевой рынки. Первичный рынок ценных бумаг и его характеристика. Вторичный биржевой рынок. Участники рынка ценных бумаг:	
C1.6	Государственное регулирование рынка ценных бумаг Органы государственного надзора, законодательно-правовая база регулирования, национальные особенности регулирования рынка. Формы и задачи государственного регулирования.	2
	Самостоятельная работа	24
CP1.1	Проработка учебного материала лекций	1.5
CP1.2	Подготовка к семинарам	1.5
CP1.3	Подготовка к контрольной работе	3
CP1.4	Другие виды самостоятельной работы	18
2	« Ценные бумаги и производные финансовые инструменты: характеристика и доходность »	
	Лекции	12
2.1	Ценные бумаги Понятие ценной бумаги. История появления ценных бумаг. Классификация ценных бумаг. Понятие первичного размещения ценных бумаг (эмиссии). Процедура эмиссии ценных бумаг. Проспект эмиссии ценных бумаг. Раскрытие информации на рынке ценных бумаг. Механизм функционирования первичного рынка ценных бумаг.	2
2.2	Акции Акция: происхождение акций. Акционерные Общества. Виды, сущность. Доходность. Классификация акций: обыкновенные и привилегированные, их свойства. Номинальная и рыночная стоимость акций. Виды оценок акций. Дивиденды и способы их выплаты. Механизм первичного размещения акций. Андеррайтинг. Конвертируемые акции и облигации. Акционерные общества. Сравнительный анализ акций, показатели. Капитализация компании.	2
2.3	Облигации Виды, сущность. Доходность. Облигация: происхождение облигаций и их виды. Государственные и муниципальные, банковские, корпоративные частные, купонные и, бескупонные с постоянным и переменным купоном с амортизацией долга, конвертируемые и неконвертируемые, кратко-, средне- и долгосрочные облигации. Доходность облигаций. Государственные ценные бумаги. Государственные и муниципальные бумаги. Виды современных бумаг и характеристика рынков.	2
2.4	Вексель Вексель: определение, происхождение и классификация. Реквизиты векселя. Коммерческие, финансовые и обеспечительные векселя. Процентные и дисконтные векселя. Простой и переводной вексель. Обращение векселей. Субъекты вексельного обращения. Простой вексель: векселедатель и векселедержатель. Переводной вексель: трассант, ремитент, трассат. Индоссамент, индоссант, индоссат. Гарантия платежа по векселю (аваль). Акцепт переводного векселя.	2

	Опротестование векселей. Право регресса. Роль векселей в рыночной экономике.	
2.5 2.6	Производные ценные бумаги и их характеристика Общая характеристика и история возникновения производных ценных бумаг. Срочный рынок, срочные сделки. Доходность. Характеристика рынка Структура. Понятие финансового инструмента. Финансовые инструменты на срочном рынке. Форвард: основные понятия, заключение сделки. Фьючерс: основные понятия. Хеджирование и спекуляция на фьючерсах. Сравнительная характеристика форвардов и фьючерсов. Опцион: основные понятия. Заключение опционной сделки. Покупатель (держатель) и продавец (подписчик) опциона. Виды опционов: КОЛЛ и ПУТ. Американский и европейский опцион. Цена (стоимость) опциона и страйк-цена (цена исполнения). Структура премии. Внутренняя и внешняя стоимость опциона. Хеджирование и спекуляция на опционах. Прочие производные ценные бумаги: свопы, варранты, депозитарные расписки, стрипы.	4
	Семинары	12
С 2.1	Понятие ценной бумаги История появления ценных бумаг. Исторические формы ценных бумаг. Современная классификация и виды ценных бумаг: долевые и долговые, государственные, муниципальные и корпоративные ценные бумаги. Производные ценные бумаги.	2
С 2.2	Эмиссия ценных бумаг Процедура эмиссии ценных бумаг. Проспект эмиссии ценных бумаг. Раскрытие информации на рынке ценных бумаг. Эволюция формы выпуска ценных бумаг.	2
С 2.3	Акции Обыкновенные и привилегированные акции, их свойства. Виды оценок акций. Сплит и консолидация акций. Дивиденды и способы их выплаты. Капитализация компании.	2
С 2.4	Облигации Виды облигаций. Государственные и муниципальные, банковские, корпоративные частные, купонные и бескупонные с постоянным и переменным купоном с амортизацией долга, конвертируемые и неконвертируемые, кратко-, средне- и долгосрочные облигации. Доходность облигаций.	2
С 2.5	Вексель Простой и переводной вексель. Реквизиты векселя. Коммерческие, финансовые и обеспечительные векселя. Процентные и дисконтные векселя. Обращение векселей. Учет векселей.	2
С 2.6	Производные ценные бумаги и их характеристика Понятие финансового инструмента. Свойство производных финансовых инструментов (ПФИ). Срочный рынок, срочные сделки. Доходность. Форвард: основные понятия, заключение сделки. Фьючерс: основные понятия. Опционы, свопы, варранты, депозитарные расписки.	2

	Самостоятельная работа	24
CP2.1	Проработка учебного материала лекций	1.5
CP2.2	Подготовка к семинарам	1.5
CP2.3	Подготовка к контрольной работе	3
CP2.4	Другие виды самостоятельной работы	18
3	« Профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг »	
	Лекции	12
	Профессиональные участники	
3.1	Виды профессиональных участников на рынке ценных бумаг. Правовая основа деятельности профессиональных участников. Брокерская фирма как важнейший элемент рыночной и биржевой инфраструктуры. Основные функции брокерской фирмы. Схемы обслуживания клиентов: классическая и Интернет-трейдинг. Торговая сессия. Подача заявок и заключение сделок. Виды клиентских поручений: лимитированная, рыночная и стоп-заявка. Виды операций с ценными бумагами в брокерской фирме: торговля с полным покрытием и на марже. Тарифы клиентского обслуживания. Биржевой сбор, комиссия брокерской фирмы и депозитарный сбор.	2
3.2	Профессиональные участники Плата за инвестиционное консультирование, информационное обслуживание и пользование программами Интернет-трейдинга. Дилерская деятельность на рынке ценных бумаг, обзор функций, правила. Депозитарная деятельность, характеристика. Деятельность по доверительному управлению. Клиринговая деятельность, организация и правила. Деятельность по организации торговли.	2
3.3	Фондовая биржа Возникновение бирж как организованных площадок для торговли товаром по упорядоченным правилам в Западной Европе в XV – XVI вв. и в Японии – XVII в. Понятие биржевого товара и его эволюция. Ценные бумаги как этап в развитии биржевого товара. Биржевая торговля валютой. Органы управления, организационная структура и функции фондовой биржи. Клиринговая палата. Биржевой депозитарий. Биржевой арбитраж. Котировальная комиссия. Права и обязанности фондовой биржи и её членов. Биржевая терминология. Биржевая информация. Ценные бумаги на бирже. Листинг как процедура допуска ценных бумаг к торговле. Российские фондовые биржи.	2
3.4	Внебиржевой рынок ценных бумаг Информационное и техническое обеспечение биржевой торговли. Компьютерные системы и средства телекоммуникаций. Биржевые и внебиржевые торгово-информационные системы. Системы мониторинга портфеля ценных бумаг.	2
3.5	Основы технического анализа, биржевые котировки, индексы Понятие биржевой котировки. Таблицы котировок. Чтение финансовой информации. Понятие биржевого индекса. История появления и предназначение биржевых индексов. Классификация биржевых индексов: среднеарифметические, средневзвешенные и портфельные. Понятие биржевого графика. Основные форматы	2

	<p>графиков. Основы технического анализа. Анализ графиков. Построение графиков. Масштабы. Сопротивление и поддержка. Тренд и коридор цен. Линии трендов. Разрывы. Фигуры. Интерпретация объёма. Индикаторы и осцилляторы. Экзотические методики анализа рынка. Общее состояние и перспективы развития методов анализа фондового рынка.</p>	
3.6	<p>Фундаментальный анализ рынка ценных бумаг</p> <p>Механизм принятия решений на рынке ценных бумаг. Фундаментальный анализ рынка. Анализ факторов, относящихся к предприятию-эмитенту. История развития эмитента. Текущее финансовое и экономическое состояние эмитента. Перспективы его дальнейшего развития. Качество менеджмента, человеческий фактор. Структура акционерного капитала. Отраслевые факторы. Бухгалтерский баланс и отчёт о прибылях и убытках. Финансовая устойчивость. Рейтинговые оценки. Кредитная история. Дивидендная история. Система финансовых показателей. Анализ внутренних факторов, относящихся к стране, где функционирует предприятие-эмитент. Общая политическая и экономическая ситуация в стране. Динамика ВВП. Государственный бюджет. Динамика внешнеторгового баланса. Рейтинговые оценки российских эмитентов и России в целом. Природные факторы. Биржевые кризисы и потрясения. История и причины биржевых кризисов и потрясений.</p>	2
	Семинары	12
С 3.1	<p>Профессиональные участники</p> <p>Виды профессиональных участников на рынке ценных бумаг. Правовая основа деятельности профессиональных участников. Брокерская, дилерская виды деятельности.</p>	2
С 3.2	<p>Профессиональные участники</p> <p>Виды профессиональных участников на рынке ценных бумаг. Правовая основа деятельности профессиональных участников. Депозитарная, клиринговая виды деятельности, доверительное управление, деятельность по ведению реестра.</p>	2
С 3.3	<p>Фондовая биржа</p> <p>Права и обязанности фондовой биржи и её членов. Биржевая терминология. Биржевая информация. Ценные бумаги на бирже. Листинг как процедура допуска ценных бумаг к торговле. Российские фондовые биржи.</p>	2
С 3.4	<p>Биржевые котировки, индексы и графики</p> <p>Понятие биржевой котировки, таблицы котировок, чтение финансовой информации. Биржевой индекс, методики расчета, известные мировые и российские фондовые индексы. Понятие биржевого графика. Биржевые и внебиржевые торгово-информационные системы.</p>	2
С 3.5	<p>Основы технического анализа рынка ценных бумаг</p> <p>Основные форматы графиков: столбиковая диаграмма и «японские свечи». Основы технического анализа. Построение графиков. Масштабы. Сопротивление и поддержка. Тренд и коридор цен. Линии трендов. Разрывы. Фигуры. Интерпретация объёма. Информационное</p>	2

	и техническое обеспечение биржевой торговли. Системы мониторинга портфеля ценных бумаг.	
С 3.6	Фундаментальный анализ рынка ценных бумаг Механизм принятия решений на рынке ценных бумаг. Анализ факторов, относящихся к предприятию-эмитенту. История развития эмитента. Текущее финансовое и экономическое состояние эмитента. Перспективы его дальнейшего развития. Качество менеджмента, человеческий фактор.	2
	Самостоятельная работа	24
СР3.1	Проработка учебного материала лекций	1.5
СР3.2	Подготовка к семинарам	1.5
СР3.3	Подготовка к рубежному контролю	3
СР3.4	Другие виды самостоятельной работы	18

5. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ СТУДЕНТОВ

Самостоятельная работа студентов по дисциплине обеспечивается следующими учебно-методическими материалами:

1. Рабочая программа дисциплины.
2. Учебная литература и дополнительные материалы [Раздел 7 Рабочей программы дисциплины].
3. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» [Раздел 8 Рабочей программы дисциплины].
4. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины [Раздел 9 Рабочей программы дисциплины], обеспечивающие самостоятельную работу студента при подготовке к учебным занятиям, выполнении домашних работ, подготовке к контрольным мероприятиям и аттестациям.
5. Комплект индивидуальных заданий.

Студенты получают доступ к указанным материалам начиная с первого занятия по дисциплине.

6. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ СТУДЕНТОВ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Фонд оценочных средств (ФОС) для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине базируется на перечне компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы (раздел 1). ФОС обеспечивает объективный контроль достижения всех результатов обучения, запланированных для дисциплины.

ФОС включает в себя:

- перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы;
- описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания;
- типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, владений и (или) опыта деятельности, характеризующие этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы;
- методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, владений и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций.

Контроль освоения дисциплины производится в соответствии с Положением о текущем контроле успеваемости и промежуточной аттестации студентов МГТУ им. Н.Э. Баумана.

ФОС является приложением к данной рабочей программе дисциплины.

7. ПЕРЕЧЕНЬ УЧЕБНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ И ДОПОЛНИТЕЛЬНЫХ МАТЕРИАЛОВ, НЕОБХОДИМЫХ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Литература по дисциплине

1. ОСНОВЫ ПОРТФЕЛЬНОГО ИНВЕСТИРОВАНИЯ 2-е изд., испр. и доп. Учебник для вузов / Никитина Т. В. , Репета-Турсунова А. В. , Фрёммель М. , Ядрин А. В. - 2020. - URL: <https://urait.ru/book/6013C179-DF88-4F69-B602-B9479E5E0AAB>.
2. ИНВЕСТИЦИИ В 2 Ч. ЧАСТЬ 1 2-е изд., пер. и доп. Учебник и практикум для вузов / Теплова Т. В. - 2021. - URL: <https://urait.ru/book/0485190C-2C7D-4AEF-AB06-9D90888F6EAD>.

Дополнительные материалы

3. Рынок ценных бумаг Учебно-методическое пособие / Коришева О.В. - 2020. - URL: <http://www.iprbookshop.ru/115890.html>.
4. Рынок ценных бумаг Практикум для СПО / Балтин В.Э., Булатова Ю.И. - 2020. - URL: <http://www.iprbookshop.ru/92163.html>.
5. Инструменты рынка ценных бумаг Учебное пособие для СПО / Гонов А.А., Луценко А.В., Медведева М.А. - 2019. - URL: <http://www.iprbookshop.ru/87806.html>.
6. Объекты и субъекты рынка ценных бумаг Учебное пособие / Алтунина Т.М. - 2017. - URL: <http://www.iprbookshop.ru/106433.html>.

8. ПЕРЕЧЕНЬ РЕСУРСОВ СЕТИ ИНТЕРНЕТ, РЕКОМЕНДУЕМЫХ ДЛЯ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ ПРИ ОСВОЕНИИ ДИСЦИПЛИНЫ

1. Сайт кафедры «Экономика и управление»: <https://mf.bmstu.ru/info/faculty/kf/caf/k4/>
2. Открытая информационная группа кафедры в социальной сети: https://www.instagram.com/k4_bmstu/
3. Российская государственная библиотека. <http://www.rsl.ru>.
4. Государственная публичная научно-техническая библиотека России. <http://www.gpntb.ru>.
5. Библиотека МГТУ им. Н.Э. Баумана. <http://library.bmstu.ru>.
6. Научно-техническая библиотека КФ МГТУ им. Н.Э. Баумана. <http://library.bmstu-kaluga.ru>.
7. Научная электронная библиотека <http://eLIBRARY.RU>.
8. Электронно-библиотечная система издательства «Лань» <http://e.lanbook.com>.
9. Электронно-библиотечная система «Университетская библиотека онлайн» <http://biblioclub.ru>.
10. Электронно-библиотечная система «IPRbooks» <http://www.iprbookshop.ru>.
11. Электронно-библиотечная система (ЭБС) «Юрайт» <https://biblio-online.ru>.
12. Центральная библиотека образовательных ресурсов Минобрнауки РФ. www.edulib.ru.
13. Единая коллекция цифровых образовательных ресурсов <http://school-collection.edu.ru>.
14. Федеральный центр информационно-образовательных ресурсов. <http://fcior.edu.ru>.
15. Информационные сайты:
 - Рейтинговое агентство Эксперт РА <http://www.raexpert.ru>
 - Рейтинговое агентство Standard & Poor's www.standardandpoors.ru
 - Информационное агентство Интерфакс www.interfax.ru
 - Информационное агентство РБК www.rbc.ru
 - Национальная ассоциация участников фондового рынка НАУФОР www.naufor.ru
 - Брокерская компания ФИНАМ www.finam.ru
 - Инвестиционная компания БКС www.bcs.ru

9. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ СТУДЕНТОВ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

Приступая к работе, каждый студент должен принимать во внимание нижеследующие положения.

Дисциплина построена по модульному принципу, каждый модуль представляет собой логически завершенный раздел курса. Дисциплина делится на три модуля.

На первом занятии студент получает информацию для доступа к комплексу учебно-методических материалов по дисциплине.

Лекционные занятия посвящены рассмотрению ключевых, базовых положений курса и разъяснению учебных заданий, выносимых на самостоятельную проработку.

Семинарские занятия проводятся для закрепления усвоенной информации, приобретения навыков ее применения для решения практических задач в предметной области дисциплины.

Практическая подготовка при реализации учебной дисциплины организуется путем проведения практических занятий, практикумов, лабораторных работ и индивидуальных и(или) групповых консультаций, предусматривающих участие обучающихся в выполнении отдельных элементов работ, связанных с будущей профессиональной деятельностью.

Практическая подготовка может включать в себя отдельные занятия лекционного типа, которые предусматривают передачу учебной информации обучающимся, необходимой для последующего выполнения работ, связанных с будущей профессиональной деятельностью.

Самостоятельная работа студентов включает следующие виды: проработка учебного материала лекций, подготовка к семинарам, подготовка к контрольной работе, подготовка к рубежному контролю. Результаты всех видов работы студентов формируются в виде их личного рейтинга, который учитывается на промежуточной аттестации. Самостоятельная работа предусматривает не только проработку материалов лекционного курса, но и их расширение в результате поиска, анализа, структурирования и представления в компактном виде современной информации из всех возможных источников.

Текущий контроль проводится в течение каждого модуля, его итоговые результаты складываются из оценок по следующим видам контрольных мероприятий:

- Контрольная работа
- Рубежный контроль.

Освоение дисциплины и ее успешное завершение на стадии промежуточной аттестации возможно только при регулярной работе во время семестра и планомерном прохождении текущего контроля. Набрать рейтинг по всем модулям в каждом семестре, пройти по каждому модулю плановые контрольные мероприятия в течение экзаменационной сессии невозможно.

Для завершения работы в семестре студент должен выполнить все контрольные мероприятия.

Промежуточная аттестация по дисциплине проходит в форме зачета.

Методика оценки по рейтингу

Студент, выполнивший все предусмотренные учебным планом задания и сдавший все контрольные мероприятия, получает итоговую оценку по дисциплине за семестр в соответствии со шкалой:

Рейтинг	Оценка на зачете
85 – 100	Зачтено
71 – 84	Зачтено
60 – 70	Зачтено
0 – 59	Не зачтено

Оценивание дисциплины ведется в соответствии с Положением о текущем контроле успеваемости и промежуточной аттестации студентов МГТУ им. Н.Э. Баумана.

10. ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ИЗУЧЕНИИ ДИСЦИПЛИНЫ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ, ИНФОРМАЦИОННЫХ СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ И ПРОФЕССИОНАЛЬНЫХ БАЗ ДАННЫХ

Информационные технологии:

- Электронная информационно-образовательная среда МГТУ им. Н.Э. Баумана обеспечивает доступ к учебным планам, рабочим программам дисциплин (модулей), программам практик, электронным учебным изданиям и электронным образовательным ресурсам, указанным в рабочих программах дисциплин (модулей), программах практик, формирование электронного портфолио обучающегося, в том числе сохранение его работ и оценок за эти работы. Предусмотрена возможность синхронного и асинхронного взаимодействия студентов и преподавателей посредством технологий и служб по пересылке и получению электронных сообщений между пользователями компьютерной сети Интернет.
- e-mail преподавателя для оперативной связи: belyakova@mf.bmstu.ru

Программное обеспечение:

- PowerPoint
- Windows
- Word
- КонсультантПлюс

Информационные справочные системы:

- Информационно-правовая система «Гарант» <http://www.garant.ru>;
- Информационно-правовая система «Консультант Плюс» <http://www.consultant.ru>;

Профессиональные базы данных:

- Банк России <http://www.cbr.ru>
- Московская биржа <http://www.moex.com>

11. ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ИЗУЧЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Перечень материально-технического обеспечения дисциплины

№, п/п	Вид занятий	Вид и наименование оборудования
1	Лекции	специально оборудованные аудитории с мультимедийными средствами, средствами звуковоспроизведения и имеющими выход в сеть Интернет; помещения для проведения аудиторных занятий, оборудованные учебной мебелью; аудитории оснащенные компьютерами с доступом к базам данных и сети Интернет; студии; компьютерные классы.
2	Семинары	специально оборудованные аудитории с мультимедийными средствами, средствами звуковоспроизведения и имеющими выход в сеть Интернет; помещения для проведения аудиторных занятий, оборудованные учебной мебелью; аудитории оснащенные компьютерами с доступом к базам данных и сети Интернет; студии; компьютерные классы.
3	Самостоятельная работа	библиотека, имеющая рабочие места для студентов; выставочные залы; аудитории, оснащенные компьютерами с доступом к сети Интернет. Социокультурное пространство университета позволяет студенту качественно выполнять самостоятельную работу.

ЛИСТ ВНЕСЕНИЯ ИЗМЕНЕНИЙ

1). П.7. ПЕРЕЧЕНЬ ОСНОВНОЙ И ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ УЧЕБНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ, ЧИТАТЬ В СЛЕДУЮЩЕЙ РЕДАКЦИИ:

7. Перечень учебной литературы и дополнительных материалов, необходимых для освоения дисциплины

Литература по дисциплине:

1. ИНВЕСТИЦИИ В 2 Ч. ЧАСТЬ 1 2-е изд., пер. и доп. Учебник и практикум для вузов / Теплова Т. В. - 2021. - URL: <https://urait.ru/book/0485190C-2C7D-4AEF-AB06-9D90888F6EAD>.
2. ОСНОВЫ ПОРТФЕЛЬНОГО ИНВЕСТИРОВАНИЯ 2-е изд., испр. и доп. Учебник для вузов / Никитина Т. В. , Репета-Турсунова А. В. , Фрёммель М. , Ядрин А. В. - 2020. - URL: <https://urait.ru/book/6013C179-DF88-4F69-B602-B9479E5E0AAB>.

2). П.10. ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ИЗУЧЕНИИ ДИСЦИПЛИНЫ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ИНФОРМАЦИОННЫХ СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ, ЧИТАТЬ В СЛЕДУЮЩЕЙ РЕДАКЦИИ:

10. Перечень информационных технологий, используемых при изучении дисциплины, включая перечень программного обеспечения, информационных справочных систем и профессиональных баз данных

Программное обеспечение:

- LibreOffice
- OpenOffice
- КонсультантПлюс

Преподаватель кафедры:

Белякова Е.И., доцент (к.н.), кандидат экономических наук, ebelyakova@bmstu.ru

ЛИСТ ВНЕСЕНИЯ ИЗМЕНЕНИЙ

1). П.7. ПЕРЕЧЕНЬ ОСНОВНОЙ И ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ УЧЕБНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ, ЧИТАТЬ В СЛЕДУЮЩЕЙ РЕДАКЦИИ:

7. Перечень учебной литературы и дополнительных материалов, необходимых для освоения дисциплины

Литература по дисциплине:

1. Куликова Е. В., Пилюгина А. В. Управление инвестициями : учебно-методическое пособие / Куликова Е. В., Пилюгина А. В. ; МГТУ им. Н. Э. Баумана (национальный исследовательский ун-т). - М. : Изд-во МГТУ им. Н. Э. Баумана, 2019. - 63 с. : рис., табл. - Библиогр.: с. 63. - ISBN 978-5-7038-5155-5.
2. Селюков В. К. Анализ рынка ценных бумаг : учеб. пособие / Селюков В. К. ; МГТУ им. Н. Э. Баумана. - М. : Изд-во МГТУ им. Н. Э. Баумана, 2008. - 90 с. : ил. - Библиогр.: с. 89. - ISBN 978-5-7038-3141-0.
3. Рынок ценных бумаг. Инструменты и механизмы функционирования / Ивасенко А. Г., Никонова Я. И., Павленко В. А. - 2022. - URL: <https://book.ru/book/942972>.
4. Деятельность банков на рынке ценных бумаг / Янина О. Н. - 2023. - URL: <https://book.ru/book/946000>.
5. Выполнение операций с ценными бумагами. Практикум / Мартыненко Н. Н., под ред, Ковалева Н. А., Соколинская Н. Э., Терновская Е. П., Варламова С. Б., Маркова О. М., Васильев И. И., Ушанов А. Е., Горькова Н. М., Рябов Д. Ю. - 2022. - URL: <https://book.ru/book/943180>.
6. Фундаментальный анализ на рынке ценных бумаг / Семенкова Е. В., под ред, Мазаев Н. М., Помаскина О. В., Эдилбаев А. Н., Перепелица Д. Г., Финогенова Ю. Ю. - 2021. - URL: <https://book.ru/book/939077>.

2). П.10. ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ИЗУЧЕНИИ ДИСЦИПЛИНЫ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ИНФОРМАЦИОННЫХ СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ, ЧИТАТЬ В СЛЕДУЮЩЕЙ РЕДАКЦИИ:

10. Перечень информационных технологий, используемых при изучении дисциплины, включая перечень программного обеспечения, информационных справочных систем и профессиональных баз данных

Программное обеспечение:

- КонсультантПлюс
- Р7-Офис.Профессиональный

Преподаватель кафедры:

Белякова Е.И., доцент (к.н.), кандидат экономических наук, ebelyakova@bmstu.ru

ЛИСТ ВНЕСЕНИЯ ИЗМЕНЕНИЙ

1). П.7. ПЕРЕЧЕНЬ ОСНОВНОЙ И ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ УЧЕБНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ, ЧИТАТЬ В СЛЕДУЮЩЕЙ РЕДАКЦИИ:

7. Перечень учебной литературы и дополнительных материалов, необходимых для освоения дисциплины

Литература по дисциплине:

1. Куликова Е. В., Пилюгина А. В. Управление инвестициями : учебно-методическое пособие / Куликова Е. В., Пилюгина А. В. ; МГТУ им. Н. Э. Баумана (национальный исследовательский ун-т). - М. : Изд-во МГТУ им. Н. Э. Баумана, 2019. - 63 с. : рис., табл. - Библиогр.: с. 63. - ISBN 978-5-7038-5155-5.
2. Селюков В. К. Анализ рынка ценных бумаг : учеб. пособие / Селюков В. К. ; МГТУ им. Н. Э. Баумана. - М. : Изд-во МГТУ им. Н. Э. Баумана, 2008. - 90 с. : ил. - Библиогр.: с. 89. - ISBN 978-5-7038-3141-0.
3. Рынок ценных бумаг. Инструменты и механизмы функционирования / Ивасенко А. Г., Никонова Я. И., Павленко В. А. - 2022. - URL: <https://book.ru/book/942972>.
4. Деятельность банков на рынке ценных бумаг / Янина О. Н. - 2023. - URL: <https://book.ru/book/946000>.
5. Выполнение операций с ценными бумагами. Практикум / Мартыненко Н. Н., под ред, Ковалева Н. А., Соколинская Н. Э., Терновская Е. П., Варламова С. Б., Маркова О. М., Васильев И. И., Ушанов А. Е., Горькова Н. М., Рябов Д. Ю. - 2022. - URL: <https://book.ru/book/943180>.
6. Фундаментальный анализ на рынке ценных бумаг / Семенкова Е. В., под ред, Мазаев Н. М., Помаскина О. В., Эдилбаев А. Н., Перепелица Д. Г., Финогенова Ю. Ю. - 2021. - URL: <https://book.ru/book/939077>.

2). П.10. ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ИЗУЧЕНИИ ДИСЦИПЛИНЫ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ИНФОРМАЦИОННЫХ СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ, ЧИТАТЬ В СЛЕДУЮЩЕЙ РЕДАКЦИИ:

10. Перечень информационных технологий, используемых при изучении дисциплины, включая перечень программного обеспечения, информационных справочных систем и профессиональных баз данных

Программное обеспечение:

- LibreOffice

Преподаватель кафедры:

Белякова Е.И., доцент (к.н.), кандидат экономических наук, ebelyakova@bmstu.ru