

Министерство образования и науки Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный экономический университет»

Институт коммерции, маркетинга и сервиса

Кафедра коммерции, сервиса и туризма

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом института (факультета)

(протокол № 1 от 29.08.2016 г.)

Директор института (декан факультета)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

по дисциплине

Наименование дисциплины Организация биржевой торговли

Направление подготовки/специальность 38.03.06 «Торговое дело»
(указывается код и наименование направления подготовки/специальности)

Образовательная программа Коммерция
(указывается наименование программы бакалавриата/магистратуры/специализации)

Согласовано:

Зав. выпускающей кафедрой

« » 20 г.

 / Чернова Д.В./

Рассмотрено к утверждению

на заседании кафедры коммерции,
сервиса и туризма

(протокол № 1 от 29.08.2016 г.)

Зав. кафедрой / Чернова Д.В./

Методический отдел УМУ

« » 20 г.

 /

Размещено в ЭИОС СГЭУ

Рег. № 2016.0013

«30» ноября 2016 г.

Начальник ОДОТиЭО

Научная библиотека СГЭУ

« » 20 г.

 /

Квалификация (степень) выпускника бакалавр
(указывается квалификация (степень) выпускника в соответствии с ФГОС ВО)

Самара 2016

1. Цели и задачи дисциплины
2. Место дисциплины в структуре ОП
3. Планируемые результаты обучения по дисциплине
4. Объем и виды учебной работы
5. Содержание дисциплины
6. Методические указания по освоению дисциплины
7. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации по дисциплине
8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины
9. Материально-техническое обеспечение дисциплины

1. Цели и задачи дисциплины

Рабочая программа по дисциплине «Организация биржевой торговли» разработана в соответствии с требованиями ФГОС ВО, компетентностным подходом, реализуемым в системе высшего образования.

Целью дисциплины «Организация биржевой торговли» является ознакомить студентов с биржевыми функциями, показать роль и место биржи в рыночной экономике, тенденции развития биржевой торговли.

В соответствии с поставленными целями преподавание дисциплины реализует следующие задачи:

- ознакомить с видами, особенностями и порядком заключения биржевых сделок;
- изучить концепции и практики хеджирования, как составляющей части коммерческой деятельности фирмы;
- ознакомить с биржевыми посредниками, их функциями и задачами;
- изучить организационного механизма биржевой торговли.

2. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Б1.В.ДВ.10.02 «Организация биржевой торговли» входит в вариативную часть блока Б.1 «Дисциплины (модули)».

Изучение дисциплины основывается на знаниях, умениях и навыках, приобретенных обучающимся при изучении следующих дисциплин: Б1.Б14 «Коммерческая деятельность»; Б1.Б 12 «Маркетинг»; Б1.В17 «Коммерческая логистика», Б1.В18 «Товароведение товаров однородных групп», Б1.В 12«Электронная коммерция».

Знания, умения и навыки, формируемые дисциплиной «Организация биржевой торговли», являются необходимыми для изучения последующих дисциплин (таблица 1).

Таблица 1

Междисциплинарные связи с последующими дисциплинами

№ п/п	Наименование обеспечиваемых (последующих) дисциплин	№№ разделов данной дисциплины, необходимых для изучения обеспечиваемых (последующих) дисциплин	
		1	2
1	Коммерция услуг	+	+

3. Планируемые результаты обучения по дисциплине

Изучение дисциплины «Организация биржевой торговли» в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

- профессиональные:

вид деятельности организационно-управленческая:

ПК 6 - способностью выбирать деловых партнеров, проводить с ними деловые переговоры, заключать договора и контролировать их выполнение - этап формирования промежуточный.

ПК 7 - способностью организовывать и планировать материально-техническое обеспечение предприятий, закупку и продажу товаров - этап формирования промежуточный;

ПК 8 - готовностью обеспечивать необходимый уровень качества торгового обслуживания - этап формирования завершающий.

вид деятельности: логистическая:

ПК 15 - готовностью участвовать в выборе и формировании логистических цепей и схем в торговых организациях, способностью управлять логистическими процессами и изыскивать оптимальные логистические системы - этап формирования завершающий.

В результате изучения дисциплины обучающийся должен:

знать:

- организационную структуру и тенденции развития российских и ведущих зарубежных бирж (ПК-15);
 - принципы регулирования биржевого механизма в Российской Федерации и за рубежом(ПК-6);
 - нормативно-правовую базу, регулирующую биржевую деятельность в Российской Федерации(ПК-6);
 - сущность и виды биржевых сделок(ПК-7);
 - порядок заключения сделок на бирже(ПК-6);
 - основные проблемы современного этапа развития российских бирж(ПК-8);
 - специфические черты фьючерсной и опционной торговли(ПК-8).
- уметь:
- ориентироваться в особенностях и правилах заключения договоров купли-продажи(ПК-6);
 - использовать возможность страхования от неблагоприятных изменений цен(ПК-15);
 - анализировать результаты сделки и определять ее эффективность(ПК-8);
 - управлять рисками, с которыми сопряжены биржевые сделки(ПК-15).
- владеть: _
- механизмом расчета по биржевым сделкам на современной бирже(ПК-8);
 - методикой анализа основных показателей деятельности ведущих мировых и отечественных бирж(ПК-8),
 - техникой и стратегиями хеджирования(ПК-15);
 - методами анализа и прогнозирования конъюнктуры биржевого рынка(ПК-6).

4. Объем и виды учебной работы

Учебным планом предусматриваются следующие виды учебной работы по дисциплине:

Таблица 2

Объем и виды учебной работы

Вид учебной работы	Всего часов/з.е.
	Семестр 7
Аудиторные занятия	54/1,5
в том числе:	
Лекции	18/0,5
Практические занятия (ПЗ)	36/1
Лабораторные работы (ЛР)	
Самостоятельная работа	80/2,22
Курсовая работа/курсовой проект/контрольная работа	
Расчетно-графические работы	
Реферат/эссе	
Другие виды самостоятельной работы	80/2,22
Вид промежуточной аттестации (экзамен)	10/0,27
Общая трудоемкость 144 часы 4 зачетные единицы	144/4

5. Содержание дисциплины

5.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий

Тематический план дисциплины «Организация биржевой торговли» представлен в таблице

3.

Таблица 3

Разделы, темы дисциплины и виды занятий

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Лекции	Практические занятия	СР	Контроль	Всего
Раздел. 1 Место и роль биржи в системе рыночных отношений						
1.	Биржевой механизм и его место в национальной и международной торговле	2	4	12		18
2.	Государственное регулирование биржевой деятельности	2	4	8		14
3.	Виды биржевых сделок и их классификация	4	8	12		24
Раздел 2. Современный аспект организации биржевой торговли						
4.	Хеджирование на биржевом рынке	2	4	10		16
5.	Биржевая спекуляция	2	4	10		16
6.	Клиринговые расчеты и котировальная работа на биржевом рынке	2	4	8		14
7.	Электронная биржевая торговля	2	4	10		16
8.	Конъюнктура биржевого рынка и ее анализ	2	4	10		16
Контроль					10	10
Итого		18	36	80	36	144

5.2. Содержание разделов и тем

Раздел. 1 Место и роль биржи в системе рыночных отношений.

Тема 1. Биржевой механизм и его место в национальной и международной торговле

Предпосылки возникновения биржевой торговли. Возникновение бирж за рубежом. Первоначальные формы биржевой торговли. Центры международной биржевой торговли. Экономическая основа возникновения срочной торговли.

Развитие биржевой торговли в России. Возникновение биржевой торговли в 90-х XX века, особенности развития товарных бирж с 1990 г. в России.

Система рынков: рынок товаров и услуг, финансовый рынок, рынок рабочей силы. Специфические особенности бирж труда.

Черты биржи реального товара и фьючерсной биржи. Направления деятельности и функции бирж: посредническая деятельность, регулирование рыночных цен, хеджирование и спекуляция.

Виды биржевых структур. Товарная биржа. Фондовая биржа. Валютная биржа.

Тема 2. Государственное регулирование биржевой деятельности

Правовые основы регулирования биржевой деятельности. Современное российское законодательство, регулирующее деятельность бирж. Функции и задачи Банка России в регулировании деятельности бирж.

Особенности биржевого регулирования в зарубежных странах: США, Великобритания, Франция, Япония, Сингапур.

Тема 3. Виды биржевых сделок и их классификация

Биржевая сделка. Виды биржевых сделок. Особенности форвардных, фьючерсных, опционных сделок. Срочные контракты.

Раздел 2. Современный аспект организации биржевой торговли

Тема 4. Хеджирование на биржевом рынке

Значение и техника хеджирования. Преимущества и недостатки хеджирования. Виды хеджирования: по технике осуществления операций, в зависимости от стратегии. Классическое и современное хеджирование. Полное и частичное хеджирование. Прямое и перекрестное хеджирование. Единичное и множественное хеджирование. Короткое и длинное хеджирование.

Стратегии хеджирования: обычное (чистое), арбитражное, селективное, превосходящее. Стратегии множественного хеджирования. Хеджирование с использованием базиса. Сделки типа А-А. Хеджирование в онкольных сделках.

Тема 5. Биржевая спекуляция

Понятие и экономическая сущность биржевой спекуляции. Роль и значение биржевой спекуляции. Виды спекулянтов. Спекулятивные стратегии: простые спекулятивные стратегии, арбитраж.

Структура рынка и спрединг. Виды спрединга: внутрирыночный спрединг, межтоварный спрединг, межбиржевой спрединг.

Тема 6. Клиринговые расчеты и котировальная работа на биржевом рынке

Понятие биржевых расчетов. Функции Расчетной (клиринговой) палаты.

Клиринговые фирмы. Виды маржевых платежей. Составление отчета о состоянии счета клиента.

Биржевая и котировальная цена. Типичная цена. Значение котировальной работы биржи. Котировочные цены для фьючерсных контрактов. Методы выведения котировальных цен.

Тема 7. Электронная биржевая торговля

Электронно-цифровые технологии в биржевой торговле. Исторический аспект развития электронной торговли. Психологические факторы использования современных технологий в биржевой торговле. Крупные электронные торговые площадки.

Тема 8. Конъюнктура биржевого рынка и ее анализ

Сущность и взаимосвязь фундаментального и технического видов анализа. Роль и задачи технического анализа биржевого рынка. Виды графиков в техническом анализе. Методы и инструменты технического анализа. Ценовые модели в техническом анализе. Теории Доу и Эллиота в биржевом анализе. Индикаторы и осцилляторы в техническом анализе. Современные программные продукты анализа биржевой торговли.

6. Методические указания по освоению дисциплины

6.1. Учебно-методическое обеспечение дисциплины

Основная литература

1. Чалдаева, Л.А. Биржевое дело [Текст] : учебник для бакалавров / Л. А. Чалдаева, Т. К. Блохина, А. Б. Шемякин ; Под ред. Л.А.Чалдаевой. - УМО. - М. : Юрайт, 2014. - 372 с.

Дополнительная литература

1. Ключников И.К. Фондовые биржи: вводный курс. — Москва: Финансы и статистика 2013 г.— 200 с. — Электронное издание. — ISBN 978-5-279-03338-6 <http://ibooks.ru/reading.php?productid=335383>
2. Маскаева, А. И. Биржа и биржевое дело [Текст] : учеб. пособие / Н. Н. Туманова. - М. : ИНФРА-М, 2015. - 118 с.
3. Пономарева З. М. Деловые игры в коммерческой деятельности. Темы: “Аукцион”, “Биржа”. — Москва: Дашков и К 2013 г.— 184 с. — Электронное издание. — ISBN 978-5-394-01830-5 <http://ibooks.ru/reading.php?productid=342378>

Резго Г.Я., Кетова И.А. Биржевое дело. — Москва: Финансы и статистика 2014 г.— 288 с. — Электронное издание. — ISBN 978-5-279-03404-8 <http://ibooks.ru/reading.php?productid=345057>

Конспект лекций представлен в информационно-образовательной среде СГЭУ:

6.2. Методические рекомендации по самостоятельной работе студентов

Самостоятельная работа студентов по данной дисциплине является составной частью учебного процесса. Самостоятельная работа студентов направлена на освоение образовательной программы без прямого участия преподавателя. Самостоятельная работа студентов может проводиться как в аудитории, так и во внеаудиторное время.

Основной целью самостоятельной работы студентов предусматривается проработку основной и дополнительной научной, учебной, нормативной литературы и периодических изданий по данной дисциплине.

Самостоятельная подготовка обеспечивает формирование следующих навыков:

- 1) закреплению и углублению знаний по рассматриваемым темам;
- 2) развитию способностей самостоятельно получать и анализировать биржевую информацию;
- 3) овладению умением связывать теорию с практической деятельностью;
- 4) освоению инструментов биржевой торговли;
- 5) формированию навыков критической оценки разных точек зрения по исследуемой проблематике.

Самостоятельная подготовка студентов включает следующие направления:

1. Изучение теоретического материала:

- для самостоятельного изучения разделов курса, не излагаемых на лекциях;
- для подготовки докладов и сообщений по отдельным разделам курса.

2. Закрепление практических навыков:

- при выполнении индивидуальных практических заданий;
- при подготовке к семинарским занятиям.

3. Приобретение навыков научно-исследовательской работе:

- при сборе информации и ее обработке;
- при изучении учебно-методической и справочной литературы.

2. Формы контроля самостоятельной работы студентов

Существуют следующие виды контроля внеаудиторной работы студентов:

1. При изучении теоретического материала:

- устный опрос на семинарских занятиях;
- заслушивание докладов и сообщений на лекциях и семинарских занятиях;
- проверка конспектов по отдельным темам, заданным на самостоятельное изучение.

2. При закреплении практических навыков:

- контрольные работы;
- проверка домашних заданий;
- тестирование.

3. Виды самостоятельной работы студентов

Самостоятельная работа по дисциплине «Организация биржевой торговли» включает следующие виды работ:

- подготовку сообщений и докладов;
- выполнение контрольных работ;

Доклады

Доклад- это устное сообщение по какой-либо теме. Доклад является самым простым видом научной работы. Доклад должен представлять собой результат реферирования одной или нескольких книг по определенной теме, то есть краткий обзор основного содержания этих книг.

Для того, чтобы написать доклад необходимо первоначально составить план работы, затем подобрать литературные источники по изучаемому вопросу и воспользоваться ими для раскрытия темы доклада.

Объемы докладов составляют 5-25 страниц машинописного текста. Если доклад составляет 5-10 страниц и предназначен для чтения на рядовом семинарском занятии, он называется «сообщением».

В докладе должен присутствовать титульный лист, оглавление и список использованных литературных источников.

Доклады выступают в качестве зачетных работ, то есть таких работ, без которых зачет студентам не выставляется.

Контрольные работы

Контрольные работы выступают как зачетные работы - за них ставят влияющую на зачет оценку.

Контрольная работа включает перечень вопросов по пройденному материалу и предполагает письменные ответы на поставленные вопросы.

4. Оформление самостоятельной работы

Любая самостоятельная работа должна быть выполнена с использованием компьютера и принтера на одной стороне листа белой бумаги формата А4 через полтора интервала. Цвет шрифта должен быть черным. Размер шрифта (кегель) – 14.

Тест работы следует печатать, соблюдая следующие размеры полей: правое – 10 мм, верхнее и нижнее – 20 мм, левое – 30 мм.

Разрешается использовать компьютерные возможности акцентирования внимания на определенных терминах, формулах, применяя шрифты разной гарнитуры.

Опечатки и графические неточности, обнаруженные в процессе подготовки самостоятельной работы, допускается исправлять подчисткой или закрашиванием белой краской и нанесением на том же месте исправленного текста (графики) машинописным способом или черными чернилами, пастой или тушью – рукописным способом.

Основную часть работы следует делить на разделы, подразделы и пункты. Пункты, при необходимости, могут делиться на подпункты. При делении текста на пункты и подпункты необходимо, чтобы каждый пункт содержал законченную информацию.

Разделы, подразделы, пункты и подпункты следует нумеровать арабскими цифрами и записывать с абзацного отступа.

Разделы должны иметь порядковую нумерацию в пределах всего текста, за исключением приложений. Точка в конце порядкового номера не ставится.

Номер подраздела включает номер раздела и порядковый номер подраздела, разделенные точкой.

Пример: 1.1, 1.2, 1.3 и т.д.

Разделы и подразделы должны иметь заголовки, в которых четко и кратко отражается содержание разделов, подразделов.

Страницы отчета следует нумеровать арабскими цифрами, соблюдая сквозную нумерацию по всему тексту отчета. Номер страницы проставляют в центре нижней части листа без точки.

Титульный лист включают в общую нумерацию страниц. Номер страницы на титульном листе не проставляют.

Иллюстрации и таблицы, расположенные на отдельных листах, включают в общую нумерацию страниц отчета. Иллюстрации и таблицы на листе формата А3 учитывают, как одну страницу.

Иллюстрации (чертежи, графики, схемы, диаграммы) следует располагать в отчете непосредственно после текста, в котором они упоминаются впервые, или на следующей странице.

Иллюстрации могут быть в компьютерном исполнении, в том числе и цветные. На все иллюстрации должны быть даны ссылки в отчете.

Иллюстрации следует нумеровать арабскими цифрами сквозной нумерацией. Допускается нумеровать иллюстрации в пределах раздела. В этом случае номер иллюстрации состоит из номера раздела и порядкового номера иллюстрации, разделенных точкой.

Например, Рисунок 1.1.

Иллюстрации, при необходимости, могут иметь наименование и пояснительные данные (подрисовочный текст). Слово «Рисунок» и наименование помещают после пояснительных данных и располагают следующим образом:

Рисунок 1 – Название

При ссылках на иллюстрации следует писать «... в соответствии с рисунком 2» при сквозной нумерации и «... в соответствии с рисунком 1.2.» при нумерации в пределах раздела.

Таблицы применяют для лучшей наглядности и удобства сравнения показателей. Название таблицы должно отражать ее содержание, быть точным, кратким. Название таблицы следует помещать над таблицей слева, без абзачного отступа в одну строку с ее номером через тире.

При переносе части таблицы название помещают только над первой частью таблицы, нижнюю горизонтальную черту, ограничивающую таблицу, не проводят. Над другими частями пишут слово «Продолжение» и указывают номер таблицы, например: «Продолжение таблицы 1»

Таблицу следует располагать непосредственно после текста, в котором она упоминается впервые, или на следующей странице. На все таблицы должны быть ссылки в отчете.

Таблицы следует нумеровать арабскими цифрами сквозной нумерацией. Допускается нумеровать таблицы в пределах раздела. В этом случае номер таблицы состоит из номера раздела и порядкового номера таблицы, разделенных точкой.

Таблицы слева, справа и снизу, как правило, ограничивают линиями. Допускается применять размер шрифта в таблице меньший, чем в тексте. Шапка таблицы должна быть отделена линией от остальной части таблицы.

Уравнения и формулы следует выделять из текста в отдельную строку. Выше и ниже каждой формулы или уравнения должно быть оставлено не менее одной свободной строки.

Формулы следует нумеровать порядковой нумерацией в пределах всего отчета арабскими цифрами в круглых скобках в крайнем правом положении на строке.

Ссылки в тексте на порядковые номера формул дают в скобках. Пример – в формуле (1).

В работе допускается выполнение формул и уравнений рукописным способом черными чернилами.

Приложения оформляют как продолжение работы на последующих его листах. В тексте на все приложения должны быть даны ссылки. Приложения располагают в порядке ссылок на них в тексте отчета.

Каждое приложение следует начинать с новой страницы с указанием наверху посередине страницы слова «Приложение». Приложения обозначают заглавными буквами русского алфавита, начиная с А, за исключением букв Ё, З, Й, О, Ч, Ь, Ы, Ъ.

Приложение должно иметь заголовок, который записывают симметрично относительно текста с пропиской буквы отдельной строкой

При оформлении списка использованной литературы в начале помещаются законы Российской Федерации, затем в алфавитном порядке остальная литература.

Сведения об учебниках, методической и нормативной литературе должно включать фамилию и инициалы автора или авторов, заглавие книги (без кавычек), место издания, издательство, год издания, количество страниц.

Ссылки на журнальную статью оформляются следующим образом: фамилия и инициалы автора или авторов, название статьи, название журнала, номер журнала, год издания, страницы.

5. Тематика докладов

1. Товарные биржи в российских условиях.
2. Зарождение и развитие биржевой торговли в США.
3. Особенности функционирования интернет-бирж.
4. Современное состояние государственного регулирования сбыта зерна с участием биржи.
5. Перспективы развития фондовых бирж в свете появления новых организаторов торговли и Интернет.
6. Валютные биржи России.
7. Основные экономические показатели деятельности товарной биржи.
8. Фондовая биржа как системообразующий центр и ведущее звено фондового рынка.
9. Слияние и поглощение мировых биржевых структур.
10. Влияние биржевой торговли в Японии на международный рынок.

6.3. Методические рекомендации по практическим и/или лабораторным занятиям

1. Организационно-методический раздел

Студент к семинарскому занятию должен подготовить устные вопросы, приведенные к каждому занятию, ознакомиться с основной и дополнительной литературой по изучаемой теме.

В ходе подготовки к семинарским занятиям студент должен уметь анализировать представленные в научных изданиях, учебной литературе, а также в периодических изданиях различные точки зрения на рассматриваемую проблему, сопоставлять факты, события и уметь давать собственную оценку изучаемой теме.

По отдельным темам предусмотрено решение задач, практических ситуаций, а также проведение биржевых торгов в игровой форме. При подготовке к данным видам работ рекомендуется внимательно прочитать условия задачи или практической ситуации, а также проанализировать современные тенденции биржевого рынка.

2. Темы практических занятий. Порядок подготовки к занятиям

Раздел. 1 Место и роль биржи в системе рыночных отношений.

Тема 1. Биржевой механизм и его место в национальной и международной торговле

1. Предпосылки возникновения биржевой торговли.
2. Возникновение и развитие бирж за рубежом.
3. Центры международной биржевой торговли.
4. Развитие биржевой торговли в России.
5. Виды биржевых структур
6. Тенденции и перспективы развития современных товарных бирж.

Порядок проведения занятий:

- 1) опрос; 2) тестирование

Тема 2. Государственное регулирование биржевой деятельности

1. Механизмы биржевого регулирования
2. Государственное регулирование и саморегулирование биржевой деятельности в России.
3. Биржевое регулирование в зарубежных странах.

Порядок проведения занятий:

- 1) опрос; 2) тестирование

Тема 3. Виды биржевых сделок и их классификация

1. Сущность понятия «биржевая сделка».
2. Виды биржевых сделок и их характеристика.

Порядок проведения занятий:

- 1) опрос; 2) тестирование

Раздел 2. Современный аспект организации биржевой торговли

Тема 4. Хеджирование на биржевом рынке

1. Содержание и техника хеджирования.
2. Виды современного хеджирования

3. Стратегии хеджирования
4. Хеджирование с использованием базиса.
5. Другие виды предохранительных сделок.

Порядок проведения занятий:

- 1) опрос; 2) решение задач и практических ситуаций

Тема 5. Биржевая спекуляция

1. Роль и значение биржевой спекуляции.
2. Виды биржевых спекулянтов.
3. Спекулятивные стратегии
4. Структура рынка и спрединг.

Порядок проведения занятий:

- 1) опрос; 2) решение задач и практических ситуаций

Тема 6. Клиринговые расчеты и котировальная работа на биржевом рынке

1. Понятие биржевых расчетов.
2. Функции Расчетной (клиринговой) палаты.
3. Виды маржевых платежей.
4. Биржевая и котировальная цена.
5. Методы выведения котировальных цен.

Порядок проведения занятий:

- 1) опрос; 2) решение практических ситуаций и проведение деловой игры

Тема 7. Электронная биржевая торговля

1. Исторический аспект развития электронной торговли.
2. Психологические факторы использования современных технологий в биржевой торговле.
3. Крупные электронные торговые площадки.

Порядок проведения занятий:

- 1) опрос; 2) решение практических ситуаций и проведение деловой игры

Тема 8. Конъюнктура биржевого рынка и ее анализ

1. Особенности конъюнктуры биржевого рынка
2. Методы анализа биржевой конъюнктуры
3. Методы и инструменты технического анализа.
4. Современные программные продукты анализа биржевой торговли.

Порядок проведения занятий:

- 1) опрос; 2) решение практических ситуаций и проведение деловой игры

6.4. Методические рекомендации по написанию курсовых работ/курсовых проектов/контрольных работ

1. Методические рекомендации по написанию курсовых работ

Данная дисциплина не предусматривает написание курсовой работы для студентов дневной формы обучения.

2. Методические рекомендации по написанию контрольных работ

Контрольная работа выполняется с целью закрепления теоретических знаний, полученных студентами на лекциях и в процессе самостоятельного изучения специальной литературы и практических материалов.

Контрольная работа состоит из наиболее важных для усвоения данной дисциплины вопросов.

Не зачитывается контрольная работа, в которой содержание вопроса дословно переписано из прослушанных студентом лекций, учебника или монографии. При выполнении контрольной работы следует творчески подходить к имеющейся информации, уметь выразить свое мнение по исследуемому вопросу.

Контрольная работа должна быть аккуратно оформлена, иметь нумерацию страниц и список использованных литературных источников.

В списке литературы указываются все использованные студентом источники, расположенные в алфавитном порядке и пронумерованные.

Студенты выполняют контрольную работу по варианту, номер которого совпадает с последней цифрой номера зачетной книжки (или студенческого билета), то есть цифры 1, 2, 3, ..., 0 соответствуют вариантам контрольных работ № 1, 2, 3, ..., 10. Зачтенная контрольная работа позволяет допустить студента к сдаче экзамена.

Если содержание контрольной работы отвечает предъявленным требованиям, то она зачитывается. При неудовлетворительном выполнении контрольной работы она возвращается студенту на доработку.

Преподаватель пишет рецензию на контрольную работу, указывая основные замечания, которые студент должен учесть при подготовке и сдаче экзамена.

Варианты контрольных работ

Вариант № 1

1. Современные тенденции в развитии биржевой торговли.
2. Органы управления биржей.
3. Разработать пример предвосхищающего хеджа покупателя.

Вариант № 2

1. Основные признаки биржевого товара.
2. Учредители и члены товарных бирж.
3. Разработать пример классического хеджа продавца.

Вариант № 3

1. Правила биржевой торговли товарных бирж.
2. Процедура листинга, делистинг.
3. Разработать пример селективного хеджа продавца.

Вариант № 4

1. Функции и черты биржевых брокеров.
2. Классификация бирж.
3. . Разработать пример классического хеджа покупателя.

Вариант № 5

1. Особенности и сравнительная характеристика форвардных и фьючерсных контрактов.
2. Функции и задачи Банка России в организации биржевой торговли.
3. Разработать пример внутрирыночного спреда.

Вариант № 6

1. Развитие фьючерсной и опционной торговли в России и за рубежом
2. Значение и типы биржевых индексов.
3. Разработать пример перекрестного хеджа продавца.

Вариант № 7

1. Виды биржевых сделок и их характеристика.
2. Маржа и её виды.
3. Разработать пример предвосхищающего хеджа продавца.

Вариант № 8

1. Роль биржи в рыночной экономике.
2. Котировальная работа биржи, методы выведения котировок.
3. Разработать пример селективного хеджа покупателя

Вариант № 9

1. Органы государственного регулирования биржевой торговли.
2. Порядок заключения и исполнения фьючерсных сделок.
3. Разработать пример перекрестного хеджа покупателя.

Вариант № 10

1. Виды деятельности и источники доходов биржевых посредников.
2. Механизм заключения сделок с валютой.
3. Разработать пример хеджа «без одного».

ЗАКРЕПЛЕНИЕ ВАРИАНТА

Выбор варианта контрольной работы: по первой букве фамилии студента.

первые буквы фамилии	вариант контрольной работы
А, П, Л	1

Б,Р,Щ	2
В,С, Я	3
Г,Т	4
Д,У	5
Е,Ф,М	6
Ж,Х,Э	7
З,Ц,Н	8
И,Ч,Ю	9
К,Ш,О	10

7. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации по дисциплине

Перечень контролирующих мероприятий для проведения промежуточного контроля по дисциплине «Организация биржевой торговли» представлен в таблице 4.

Таблица 4

Фонд оценочных средств по дисциплине «Организация биржевой торговли»

Промежуточная аттестация (в конце семестра)						
Курсовая работа	Курсовой проект	Контрольная работа (для заочной формы обучения)	Промежуточное тестирование	Зачет	Зачет с оценкой	Экзамен
1	2	3	4	5	6	7
		+	+			+

Контролирующие мероприятия:

1. Контрольная работа

Цель - закрепление теоретических знаний, полученных студентами на лекциях и в процессе самостоятельного изучения специальной литературы и практических материалов.

Процедура – студент самостоятельно в печатной форме подготавливает ответы на два вопроса по дисциплине. Преподаватель пишет рецензию на контрольную работу, указывая основные замечания, которые студент должен учесть при подготовке и сдаче экзамена.

Содержание – контрольная работа состоит из наиболее важных для усвоения данной дисциплины вопросов.

При написании работы желательно приводить цитаты, статистические данные, графики и диаграммы, которые должны иметь ссылки на информационный источник (фамилия, инициалы автора, название цитируемого источника, том, часть, выпуск, издательство, год, страница).

Желательно показать значимость раскрываемых вопросов на примере практических материалов, связанных с местом работы студента.

Контрольная работа должна быть аккуратно оформлена, иметь нумерацию страниц и список использованных литературных источников.

Если содержание контрольной работы отвечает предъявленным требованиям, то она зачитывается. При неудовлетворительном выполнении контрольной работы она возвращается студенту на доработку.

Выбор варианта контрольной работы производится по первой букве фамилии студента в соответствии с таблицей.

Варианты контрольных работ

Вариант № 1

1. Современные тенденции в развитии биржевой торговли.
2. Органы управления биржей.
3. Разработать пример предвосхищающего хеджа покупателя.

Вариант № 2

1. Основные признаки биржевого товара.
2. Учредители и члены товарных бирж.
3. Разработать пример классического хеджа продавца.

Вариант № 3

1. Правила биржевой торговли товарных бирж.
2. Процедура листинга, делистинг.
3. Разработать пример селективного хеджа продавца.

Вариант № 4

1. Функции и черты биржевых брокеров.
2. Классификация бирж.
3. . Разработать пример классического хеджа покупателя.

Вариант № 5

1. Особенности и сравнительная характеристика форвардных и фьючерсных контрактов.
2. Функции и задачи Банка России в организации биржевой торговли.
3. Разработать пример внутрирыночного спреда.

Вариант № 6

1. Развитие фьючерсной и опционной торговли в России и за рубежом
2. Значение и типы биржевых индексов.
3. Разработать пример перекрестного хеджа продавца.

Вариант № 7

1. Виды биржевых сделок и их характеристика.
2. Маржа и её виды.
3. Разработать пример предвосхищающего хеджа продавца.

Вариант № 8

1. Роль биржи в рыночной экономике.
2. Котировальная работа биржи, методы выведения котировок.
3. Разработать пример селективного хеджа покупателя

Вариант № 9

1. Органы государственного регулирования биржевой торговли.

2. Порядок заключения и исполнения фьючерсных сделок.
3. Разработать пример перекрестного хеджа покупателя.

Вариант № 10

1. Виды деятельности и источники доходов биржевых посредников.
2. Механизм заключения сделок с валютой.
3. Разработать пример хеджа «без одного».

ЗАКРЕПЛЕНИЕ ВАРИАНТА

Выбор варианта контрольной работы: по первой букве фамилии студента.

первые буквы фамилии	вариант контрольной работы
А,П, Л	1
Б,Р,Щ	2
В,С, Я	3
Г,Т	4
Д,У	5
Е,Ф,М	6
Ж,Х,Э	7
З,Ц,Н	8
И,Ч,Ю	9
К,Ш,О	10

Шкала и критерии оценки

<p>Зачтено (отлично, хорошо, удовлетворительно)</p>	<p>Студентом в целом раскрыто содержание вопроса, продемонстрировано владение терминами дисциплины, в ответе приведены практические примеры транспортного обеспечения коммерческой деятельности.</p>
<p>Не зачтено (неудовлетворительно)</p>	<p>Студент не владеет основными терминами и определениями в области транспортного обеспечения коммерческой деятельности и не может ответить на контрольные вопросы, компетенции не сформированы</p>

2. Промежуточное тестирование

Цель – оценка уровня освоения студентами понятийно-категориального аппарата в области организации биржевой торговли по соответствующим разделам дисциплины, сформированности умений и навыков.

Процедура - проводится на последнем практическом занятии после изучения всех тем дисциплины. Время тестирования составляет от 35 до 50 минут в зависимости от количества вопросов.

Содержание- примерные тестовые задание приведены ниже.

1. Порядок проведения торговли на товарной бирже:

- а) в форме гласных публичных торгов
- б) в заранее определенном месте
- в) в определенное время
- г) во время, в которое может присутствовать как продавец, так и покупатель
- д) в форме, определяемой учредителями биржи

- е) в промежуток с 11 до 17 часов
2. Основные черты фондовой биржи:
- а) функционирует как некоммерческая организация
 - б) равноправными членами могут быть только профессиональные участники рынка ценных бумаг
 - в) равноправными членами могут быть только юридические лица, с уставным капиталом более 1 миллиона рублей
 - г) функционирует как коммерческая организация
3. Вид бирж наиболее жестко регулируемых государством в России:
- а) валютные
 - б) товарные
 - в) фондовые
 - г) специализированные
4. Виды бирж, в зависимости от принципа организации:
- государственные
- а) частные
 - б) смешанные
 - в) специализированные
 - г) неспециализированные
5. Страны, в которых сконцентрированы государственные биржи:
- а) Бельгия
 - б) Франция
 - в) Нидерланды
 - г) Великобритания
 - д) США
 - е) Россия
6. Страны, в которых распространены частные биржи:
- а) США
 - б) Бельгия
 - в) Франция
 - г) Нидерланды
 - д) Великобритания
7. Вид бирж, получивший наибольшее распространение в современной Европе:
- а) смешанные фондовые
 - б) государственные
 - в) частные
 - г) коммерческие
 - д) наличного товара
8. Вид бирж, деятельность которых регулируется законом РФ "Об организованных торгах":
- а) товарные
 - б) валютные
 - в) фондовые
 - г) товарно-фондовые
 - д) универсальные
9. Биржа вправе осуществлять деятельность:
- а) непосредственно связанную с организацией и регулированием биржевой торговли
 - б) торговую
 - в) торгово-посредническую
 - г) все ответы верны
10. Высший орган, руководящий деятельностью биржи:
- а) общее собрание учредителей и членов биржи
 - б) биржевой комитет
 - в) правление биржи
 - г) расчетно-клиринговая палата

11. Информация, подлежащая обязательному разглашению по результатам заключенных сделок с реальным товаром:

- а) наименование товара и его количество
- б) общая стоимость сделки
- в) срок исполнения сделки и условиях сделки
- г) пункт доставки товара
- д) распределение расходов по транспортировке и хранению товара
- е) форма оплаты за купленный товар

12. Опционные сделки – это:

- а) сделки с реальным товаром,
- б) сделки с ценными бумагами,
- в) сделки с премией,
- г) сделки с залогами.

13. Хеджирование заключается в:

- а) сохранении издержек поставки;
- б) совершении на фьючерсном рынке операций, равной по объёму, но противоположной по направлению операций на реальном рынке;
- в) получение кредита на льготных условиях;
- г) иное.

14. Фьючерсным рынкам нужны спекулянты, поскольку они:

- а) увеличивают ликвидность рынков;
- б) способствуют процессу выявления цены;
- в) облегчают хеджирование;
- г) все выше указанное вместе.

15. Фьючерсные цены определяются:

- а) методом подачи заявки в процессе столкновения предложений на продажу и покупку;
- б) руководителями бирж;
- в) расчетной палатой;
- г) приказами клиентов.

16. Как называется оплата услуг брокерских фирм?

- а) биржевой сбор;
- б) комиссионное вознаграждение;
- в) маржа;
- г) дополнительная прибыль.

17. Брокерская деятельность – это совершение сделок:

- а) биржевым посредником от имени клиента и за его счет, от имени клиента и за свой счет, от своего имени, но за счет клиента;
- б) биржевым посредником от своего имени и за свой счет;
- в) между производителем и потребителем;
- г) между оптовиком и производителем.

18. Спрэд, возникший при одновременной продаже фьючерсного контракта данного вида на один срок и продаже фьючерсного контракта другой срочности по одному и тому же товару на другой срок:

- а) внутрирыночный
- б) межрыночный
- в) межтоварный
- г) стрип

19. Спрэд, возникший при одновременной покупке и продаже фьючерсного контракта одного срока на разных, но взаимосвязанных фьючерсных рынках:

- а) межрыночный
- б) внутрирыночный
- в) межтоварный
- г) стрип

20. Примером межтоварного спреда НЕ является:

- а) покупка августовского фьючерса на сою - бобы и продажа августовского фьючерса на соевую муку;
- б) покупка майского фьючерса на овес и продажа майского фьючерса на кукурузу;
- в) покупка июльского фьючерса на пшеницу и продажа июльского фьючерса на кукурузу;
- г) покупка декабрьского фьючерса на кукурузу и продажа декабрьского фьючерса на пшеницу.

Шкала и критерии оценки.

Шкала (% правильных ответов)	Традиционная система
менее 55	неудовлетворительно
55 – 70	удовлетворительно
71 – 85	хорошо
86 -100	отлично

3. Экзамен

Цель - оценка качества усвоения учебного материала и сформированности компетенций в результате изучения дисциплины.

Процедура – проводится во время экзаменационной сессии (экзамен). Студент получает вопрос или экзаменационный билет и 15-20 минут на подготовку. По итогам экзамена выставляется оценка.

Содержание: экзаменационный билет содержит 2 вопроса.

Вопросы к экзамену.

1. Черты и функции бирж.
2. Характеристика биржевого товара
3. Виды биржевых сделок.
4. Классификация бирж.
5. История развития бирж в России, перспективы развития биржевой торговли.
6. История развития бирж за рубежом.
7. Регулирование биржевой деятельности.
8. Понятие и техника хеджирования.
9. Виды современного хеджирования.
10. Хеджирование с использованием базиса.
11. Онкольные сделки и сделки типа А-А.
12. Значение биржевой спекуляции. Место спекулятивных сделок в биржевой практике.
13. Виды биржевых спекулянтов.
14. Техника биржевой спекулятивной игры.
15. Структура рынка и спрединг.
16. Задачи котировальной комиссии. Сущность биржевых котировок.
17. Содержание котировальной работы биржи.
18. Органы управления и структурные подразделения биржи.
19. Электронная биржевая торговля.
20. Порядок и техника ведения биржевых торгов.
21. Сущность и виды маржи.
22. Задачи и функции расчетной палаты.
23. Биржевые посредники: виды и функции.
24. Договор на оказание брокерских услуг, его характеристика.
25. Договор поручения и договор комиссии.
26. Методы анализа конъюнктура биржевого рынка.
27. Роли и задачи технического анализа биржевого рынка.
28. Инструменты технического анализа.
29. Листинг, котировка, курс ценных бумаг.
30. Биржевые индексы.
31. Валютные биржи, их роль и функции.

Шкала и критерии оценки.

Критерии оценки	"Отлично"	"Хорошо"	"Удовлетворительно"	"Неудовлетворительно"
1. Понимание вопроса, соответствие содержания ответа поставленным проблемам	Понимание вопроса, соответствует содержанию поставленной проблеме	В целом понимание вопроса и соответствие содержания поставленной проблеме	Большой частью понимание вопроса и соответствие содержания поставленной проблеме	Частичное понимание вопроса и соответствие содержания поставленной проблеме
2. Полнота ответа, логичность изложения материала	Материал излагается логично, последовательно и не требует дополнительных пояснений	В целом материал излагается логично, последовательно, требует незначительных дополнительных пояснений	Допускается нарушение в последовательности изложения, требуются значительные дополнительные пояснения	Материал излагается нелогично, требуется большой объем дополнительных пояснений
3. Использование необходимых профессиональных терминов и понятий при ответе	Свободное владение профессиональными терминами и понятиями	Владение профессиональными терминами и понятиями в достаточном объеме	В целом владение профессиональными терминами и понятиями	Частичное владение профессиональными терминами и понятиями
4. Использование основной и дополнительной литературы при подготовке ответа, точность в передаче материала	Использование информации из основных и дополнительных источников литературы	Использование информации из основной и большей части дополнительной литературы	Использование информации в большей части из основной литературы	Использование информации только из основной литературы
5. Аргументированность суждения, убедительность приводимых примеров	Суждения аргументированы, выводы обоснованы, множество приводимых примеров из профессиональной деятельности	В целом суждения аргументированы, выводы обоснованы, приведено достаточно примеров из профессиональной деятельности	Большой частью суждения, выводы обоснованы, примеры из профессиональной деятельности присутствуют	Суждения недостаточно аргументированы, выводы не обоснованы, невозможность приведения примеров

Промежуточный контроль по дисциплине позволяет оценить степень выраженности (сформированности) компетенций:

Таблица 5

Уровни сформированности компетенций

Компетенции (код, наименование)	Уровни сформированности компетенции	Основные признаки уровня (дескрипторные характеристики)
ПК-6 способностью выбирать деловых партнеров, проводить с ними деловые переговоры, заключать договора и	1. Пороговый	Знать: принципы регулирования биржевого механизма в Российской Федерации и за рубежом Уметь: анализировать правильность оформления биржевой сделки Владеть: методами анализа конъюнктуры биржевого рынка

контролировать их выполнение	2. Повышенный	Знать: нормативно-правовую базу, регулирующую биржевую деятельность в Российской Федерации Уметь: ориентироваться в особенностях и правилах заключения договоров купли-продажи Владеть: методами анализа и прогнозирования конъюнктуры биржевого рынка
ПК-7 способностью организовывать и планировать материально-техническое обеспечение предприятий, закупку и продажу товаров	1. Пороговый	Знать: принципиальные отличия видов биржевых сделок Уметь: оценивать ситуацию на биржевом рынке Владеть: принципами хеджирования
	2. Повышенный	Знать: специфику спекулятивной и посреднической деятельности Уметь: прогнозировать ситуацию на биржевом рынке Владеть: техникой хеджирования
ПК-8 готовностью обеспечивать необходимый уровень качества торгового обслуживания	1. Пороговый	Знать: основные проблемы современного этапа развития российских бирж Уметь: анализировать результаты биржевой сделки Владеть: механизмом расчета по биржевым сделкам на современной бирже
	2. Повышенный	Знать: специфические черты фьючерсной и опционной торговли Уметь: определять эффективность биржевой торговли Владеть: методикой анализа основных показателей деятельности ведущих мировых и отечественных бирж
ПК-15 готовностью участвовать в выборе и формировании логистических цепей и схем в торговых организациях, способностью управлять логистическими процессами и изыскивать оптимальные логистические системы	1. Пороговый	Знать: организационную структуру российских бирж Уметь: использовать возможность страхования от неблагоприятных изменений цен Владеть: стратегиями хеджирования
	2. Повышенный	Знать: организационную структуру и тенденции развития российских и ведущих зарубежных бирж Уметь: управлять рисками, с которыми сопряжены биржевые сделки Владеть: методами анализа и прогнозирования результатов биржевой торговли для оптимизации деятельности коммерческого предприятия

8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

8.1. Рекомендуемая литература

Основная литература

2. Чалдаева, Л.А. Биржевое дело [Текст] : учебник для бакалавров / Л. А. Чалдаева, Т. К. Блохина, А. Б. Шемякин ; Под ред. Л.А.Чалдаевой. - УМО. - М. : Юрайт, 2014. - 372 с.

Дополнительная литература

4. Ключников И.К. Фондовые биржи: вводный курс. — Москва: Финансы и статистика 2013 г.— 200 с. — Электронное издание. — ISBN 978-5-279-03338-6 <http://ibooks.ru/reading.php?productid=335383>
5. Маскаева, А. И. Биржа и биржевое дело [Текст] : учеб. пособие / Н. Н. Туманова. - М. : ИНФРА-М, 2015. - 118 с.
6. Пономарева З. М. Деловые игры в коммерческой деятельности. Темы: “Аукцион”, “Биржа”. — Москва: Дашков и К 2013 г.— 184 с. — Электронное издание. — ISBN 978-5-394-01830-5 <http://ibooks.ru/reading.php?productid=342378>
7. Резго Г.Я., Кетова И.А. Биржевое дело. — Москва: Финансы и статистика 2014 г.— 288 с. — Электронное издание. — ISBN 978-5-279-03404-8 <http://ibooks.ru/reading.php?productid=345057>

8.2. Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

1. Сайт журнала «Еженедельник Форекс трейдера» <http://www.fxmag.ru>
2. Сайт инвестиционной компании «Финам» <http://www.finam.ru/>
3. Сайт компании «Алпари», аналитика <http://www.alpari.ru/ru/analytics>
4. Сайт Московской биржи <http://moex.com/>
5. Форум трейдеров Российской Федерации [http://форум-трейдеров. рф/](http://форум-трейдеров.рф/)

9. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Учебные занятия по дисциплине «Организация биржевой торговли» проводятся в учебных классах. При проведении лекционных занятий используются наглядные (раздаточный материал), общепользовательские цифровые инструменты учебной деятельности (текстовый редактор, редактор создания презентаций) и технические средства обучения (экран на штативе навесной или на штативе, мультимедийный компьютер (ноутбук), мультимедиапроектор).

В целях подготовки к практическим занятиям используются компьютерные средства и программные средства, такие как Internet Explorer, Word, Excel.

При проведении учебных занятий использование лабораторий не предусмотрено.

Разработчики:

К.э.н., доцент

Кафедра коммерции, сервиса и туризма _____

подпись

Крючкова Н.А.