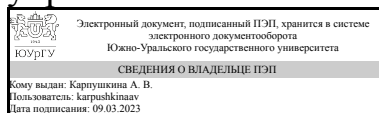


ЮЖНО-УРАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

УТВЕРЖДАЮ:
Директор института
Высшая школа экономики и
управления



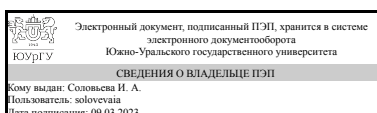
А. В. Карпушкина

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины Б.1.27 Рынок ценных бумаг
для направления 38.03.02 Менеджмент
уровень бакалавр тип программы Прикладной бакалавриат
профиль подготовки Управление проектами
форма обучения заочная
кафедра-разработчик Экономика и финансы

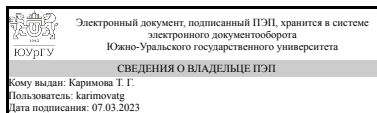
Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент, утверждённым приказом Минобрнауки от 12.01.2016 № 7

Зав.кафедрой разработчика,
Д.ЭКОН.Н., доц.



И. А. Соловьева

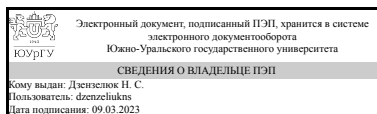
Разработчик программы,
к.ЭКОН.Н., доц., доцент



Т. Г. Каримова

СОГЛАСОВАНО

Зав.выпускающей кафедрой
Экономика промышленности и
управление проектами
к.ЭКОН.Н., доц.



Н. С. Дзензелюк

1. Цели и задачи дисциплины

Цели изучения дисциплины: • формирование теоретических знаний об экономической сущности ценных бумаг, механизме и законах функционирования рынка ценных бумаг с учетом регулирующей его законодательной и налоговой базы, • овладение методикой численного анализа различных ситуаций на рынке ценных бумаг и обоснования инвестиций в те или иные виды ценных бумаг. Задачи изучения дисциплины: • изучить фундаментальные вопросы теории ценных бумаг; • ознакомить студентов с природой ценных бумаг, их функциями, классификацией, особенностями традиционных и новых видов ценных бумаг, их инвестиционными качествами; • осветить вопросы функционирования торговой системы рынка ценных бумаг, информационного обеспечения, регулирования обращения ценных бумаг; • изучить основные методы экономических расчетов по оценке эффективности вложений в ценные бумаги и операций с ними; • ознакомить с основами портфельного инвестирования и страхования финансовых рисков операций с ценными бумагами.

Краткое содержание дисциплины

Предмет изучения дисциплины. Задачи курса. Эмиссия ценных бумаг. Виды профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг. Понятие ценной бумаги. Характеристика ценной бумаги как товара особого рода. Функции и роль ценных бумаг в развитии рыночной экономики. Первичный рынок ценных бумаг и его характеристика. Вторичный биржевой рынок ценных бумаг (фондовая биржа). Акции обыкновенные, привилегированные, их выпуск и обращение. Стоимость и доходность акций: курс, дивидендная доходность, полная доходность. Классификация облигаций, порядок их выпуска и обращения. Стоимость и доходность облигаций: купон, купонная доходность, дисконт, текущая доходность, полная доходность. Государственные и муниципальные ценные бумаги: экономическое содержание и роль, виды государственных ценных бумаг и их характеристика. Муниципальные ценные бумаги: цели и формы их выпуска. Прочие ценные бумаги: векселя, чеки, депозитные, сберегательные сертификаты. Векселя. Вторичные ценные бумаги: депозитарные расписки, варранты, стрипы. Производные ценные бумаги: форвардные, фьючерсные контракты, опционы. Фондовая биржа как организатор торговли и регулятор рынка ценных бумаг. Основные операции и сделки на бирже. Биржевые стратегии и страхование рисков. Механизм принятия решений на рынке ценных бумаг. Фундаментальный анализ ценных бумаг. Технический анализ рыночной конъюнктуры, основные методы. Рейтинговые оценки. Биржевые индексы, их виды, характеристика и методы расчета. Сущность «портфельного» подхода при организации работы инвесторов на рынке ценных бумаг. Цели инвестирования. Типы инвесторов. Виды портфелей. Обзор портфельных теорий: модель Марковитца, индексная модель Шарпа, модель выравненной цены. Система государственного регулирования рынка ценных бумаг: органы государственного надзора, законодательно-правовая база регулирования, национальные особенности регулирования рынка.

2. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины

| | |
|---------------------------------|------------------------|
| Планируемые результаты освоения | Планируемые результаты |
|---------------------------------|------------------------|

| ОП ВО (компетенции) | обучения по дисциплине (ЗУНы) |
|--|--|
| ОК-3 способностью использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности | Знать:- основные понятия дисциплины, - основные принципы взаимодействия субъектов рынка ценных бумаг, - основные виды ценных бумаг, их сущность и особенности обращения, - законодательную базу рынка ценных бумаг. |
| | Уметь:- охарактеризовать особенности отдельных видов ценных бумаг, - описать основные виды деятельности на рынке ценных бумаг и ее субъектов, - проводить экономические расчеты эффективности вложений финансовых средств в различные виды ценных бумаг. |
| | Владеть:методами расчета эффективности вложений в ценные бумаги, - основными методами портфельного анализа. |
| ПК-16 владением навыками оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов | Знать:- понятие, виды, принципы расчета фондовых индексов, - понятие, виды, методы расчета рейтинговых оценок, - методику фундаментального анализа эмитента, - методы технического анализа фондового рынка. |
| | Уметь: проводить оценку текущей конъюнктуры фондового рынка, - прогнозировать движение курсов ценных бумаг на фондовом рынке методами фундаментального и технического анализа. |
| | Владеть:методами фундаментального и технического анализа, - методами сбора экономической и статистической информации для целей анализа фондового рынка. |
| ОПК-1 владением навыками поиска, анализа и использования нормативных и правовых документов в своей профессиональной деятельности | Знать:-правовые основы деятельности субъектов и участников рынка ценных бумаг, порядок заключения сделок, основные направления и органы государственного регулирования рынка ценных бумаг. |
| | Уметь:- применять на практике знания правовых основ деятельности на рынке ценных бумаг. |
| | Владеть:- методами сбора экономической и статистической информации для целей анализа фондового рынка |

3. Место дисциплины в структуре ОП ВО

| Перечень предшествующих дисциплин, видов работ учебного плана | Перечень последующих дисциплин, видов работ |
|---|---|
| Б.1.12 Макроэкономика | Б.1.29 Финансовый менеджмент |

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

| Дисциплина | Требования |
|-----------------------|--|
| Б.1.12 Макроэкономика | Знать: -роль государства на финансовом рынке, - меры денежно-кредитной политики государства, |

| | |
|--|---|
| | - структуру, роль, функции основных государственных органов, регулирующих деятельность на финансовом рынке. Владеть навыками сбора, обработки, анализа макроэкономической информации. |
|--|---|

4. Объём и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 з.е., 108 ч.

| Вид учебной работы | Всего часов | Распределение по семестрам в часах | |
|--|-------------|------------------------------------|--|
| | | Номер семестра | |
| | | 7 | |
| Общая трудоёмкость дисциплины | 108 | 108 | |
| <i>Аудиторные занятия:</i> | 12 | 12 | |
| Лекции (Л) | 8 | 8 | |
| Практические занятия, семинары и (или) другие виды аудиторных занятий (ПЗ) | 4 | 4 | |
| Лабораторные работы (ЛР) | 0 | 0 | |
| <i>Самостоятельная работа (СРС)</i> | 96 | 96 | |
| Подготовка к зачету | 36 | 36 | |
| Конспектирование учебной и научной литературы | 30 | 30 | |
| Реферат | 30 | 30 | |
| Вид итогового контроля (зачет, диф.зачет, экзамен) | - | зачет | |

5. Содержание дисциплины

| № раздела | Наименование разделов дисциплины | Объем аудиторных занятий по видам в часах | | | |
|-----------|--|---|---|----|----|
| | | Всего | Л | ПЗ | ЛР |
| 1 | Теоретические основы функционирования рынка ценных бумаг | 6 | 4 | 2 | 0 |
| 2 | Практические основы функционирования рынка ценных бумаг | 6 | 4 | 2 | 0 |

5.1. Лекции

| № лекции | № раздела | Наименование или краткое содержание лекционного занятия | Кол-во часов |
|----------|-----------|---|--------------|
| 1 | 1 | Рынок ценных бумаг: понятия и содержание дисциплины. Выпуск и обращение ценных бумаг. | 2 |
| 2 | 1 | Виды ценных бумаг и особенности их обращения. | 2 |
| 3 | 2 | Стратегии и сделки на рынке ценных бумаг | 2 |
| 4 | 2 | Регулирование Рынка ценных бумаг | 2 |

5.2. Практические занятия, семинары

| № | № | Наименование или краткое содержание практического занятия, семинара | Кол-во |
|---|---|---|--------|
|---|---|---|--------|

| | | | |
|---------|---------|--|-------|
| занятия | раздела | | часов |
| 1 | 1 | Корпоративные ценные бумаги. Решение задач | 2 |
| 2 | 2 | Прочие ценные бумаги. Решение задач. | 2 |

5.3. Лабораторные работы

Не предусмотрены

5.4. Самостоятельная работа студента

| Выполнение СРС | |
|---|--|
| Вид работы и содержание задания | Список литературы (с указанием разделов, глав, страниц) |
| Подготовка к зачету | 1. Рынок ценных бумаг Текст учебник для вузов по экон. направлениям и специальностям / Н. И. Берзона и др.; под общ. ред. Н. И. Берзона ; Высш. шк. экономики (Нац. исслед. ун-т). - перераб. и доп. - М.: Юрайт, 2016. - 442, [1] с. ил. 2. Каримова, Т. Г., Рынок ценных бумаг и биржевое дело [Электронный ресурс] : учеб. пособие для бакалавров направления 38.03.01 "Экономика" / Т. Г. Каримова ; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Финансы, денежное обращение и кредит ; ЮУрГУ, Челябинск , 2018 Режим доступа: https://lib.susu.ru/ftd?base=SUSU_METHOD&key=000562412?base=SUSU_METHOD& |
| Конспектирование учебной и научной литературы | 1. Бердникова, Т. Б. Рынок ценных бумаг : прошлое, настоящее, будущее [Текст] монография / Т. Б. Бердникова. - М.: ИНФРА-М, 2015. - 397, [1] с. ил., табл. 22 см 1 электрон. опт. диск 2. Рынок ценных бумаг: Учебник для бакалавров. [Электронный ресурс] / В.А. Зверев, А.С.Г. Евсюков, А.В. Макеев. — Электрон. дан. — М. : Дашков и К, 2015. — 256 с. — Режим доступа: http://e.lanbook.com/book/61064 3. Каримова, Т. Г. Рынок ценных бумаг [Текст] сб. задач для студентов направлений "Экономика" и "Менеджмент" Т. Г. Каримова ; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Финансы, денежное обращение и кредит ; ЮУрГУ. - Челябинск: Издательский Центр ЮУрГУ, 2018. - 200 с. - 1 электрон. версия 4. Каримова, Т. Г., Рынок ценных бумаг и биржевое дело [Электронный ресурс] : учеб. пособие для бакалавров направления 38.03.01 "Экономика" и др. / Т. Г. Каримова ; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Финансы, денежное обращение и кредит ; ЮУрГУ, Челябинск , 2018 Режим доступа: https://lib.susu.ru/ftd?base=SUSU_METHOD&key=000562412?base=SUSU_METHOD& 5. Михайленко, М. Н. Рынок ценных бумаг [Текст] учебник и практикум для вузов по направлению "Экономика" и специальностям М. Н. Михайленко ; Гос. ун-т упр. - М.: Юрайт, 2017. - 383 с. ил. 6. Рынок ценных бумаг [Текст] учебник для вузов по экон. направлениям и специальностям / Н. И. Берзона и др.; под общ. ред. Н. И. Берзона ; Высш. шк. экономики (Нац. исслед. ун-т). - перераб. и доп. - М.: Юрайт, 2016. - 442, [1] с. ил. 7. Рынок ценных бумаг [Текст] учебник для бакалавров по экон. направлениям и специальностям под ред. Ю. А. Соколова ; Финанс. ун-т при Правительстве Рос. Федерации. - М.: Юрайт, 2016. - 383 с. ил. 8. Селищев, А. С. Рынок ценных бумаг и биржевое дело учебник и практикум для вузов по экон. направлениям и специальностям А. С. Селищев ; А. С. Селищев ; С.- Петерб. гос. экон. ун-т. - 3-е изд., перераб. и доп. - М.: Юрайт, 2016. - 383 с. ил. 9. Сребник, Б. В. Рынок ценных бумаг [Текст] учеб. пособие для вузов по специальности 080105 "Финансы и кредит" Б. В. Сребник ; Финанс. ун-т при Правительстве Рос. Федерации. - М.: КНОРУС, 2016. - 287, [1] с. ил. 10. Шарп, У. Ф. Инвестиции Текст учебник для вузов по специальности У. Ф. Шарп, Г. Д. Александер, Д. В. Бейли ; пер. с англ. А. Н. Буренин ; М.: Васина. - М.: ИНФРА-М, 2014. - XII, 1027 с. ил. |
| Реферат | Самостоятельный поиск |

6. Инновационные образовательные технологии, используемые в учебном процессе

| Инновационные формы учебных занятий | Вид работы (Л, ПЗ, ЛР) | Краткое описание | Кол-во ауд. часов |
|-------------------------------------|------------------------|------------------|-------------------|
| | | | |

| | | | |
|--|---------------------------------|--|---|
| Использование информационных ресурсов и баз данных | Практические занятия и семинары | Поиск информации для выполнения фундаментального анализа фондового рынка и отдельного эмитента | 2 |
|--|---------------------------------|--|---|

Собственные инновационные способы и методы, используемые в образовательном процессе

| | |
|---|---|
| Инновационные формы обучения | Краткое описание и примеры использования в темах и разделах |
| Использование проблемно-ориентированного междисциплинарного подхода к изучению наук | Использование задач-кейсов, формирующих навыки комплексного использования экономических знаний и навыков. |

Использование результатов научных исследований, проводимых университетом, в рамках данной дисциплины: нет

7. Фонд оценочных средств (ФОС) для проведения текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины

7.1. Паспорт фонда оценочных средств

| Наименование разделов дисциплины | Контролируемая компетенция ЗУНы | Вид контроля (включая текущий) | №№ заданий |
|--|--|--------------------------------|------------------|
| Теоретические основы функционирования рынка ценных бумаг | ОК-3 способностью использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности | тесты | все |
| Практические основы функционирования рынка ценных бумаг | ПК-16 владением навыками оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов | тест | все |
| Практические основы функционирования рынка ценных бумаг | ОК-3 способностью использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности | Контрольная работа | согласно заданию |
| Все разделы | ОПК-1 владением навыками поиска, анализа и использования нормативных и правовых документов в своей профессиональной деятельности | Реферат | Темы рефератов |
| Все разделы | ОК-3 способностью использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности | зачет | все |
| Все разделы | ОПК-1 владением навыками поиска, анализа и использования нормативных и правовых документов в своей профессиональной деятельности | зачет | все |
| Все разделы | ПК-16 владением навыками оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов | зачет | все |

7.2. Виды контроля, процедуры проведения, критерии оценивания

| | | |
|--------------|-----------------------------------|---------------------|
| Вид контроля | Процедуры проведения и оценивания | Критерии оценивания |
|--------------|-----------------------------------|---------------------|

| | | |
|--------------------|---|--|
| зачет | <p>На зачете происходит оценивание учебной деятельности обучающихся по дисциплине на основе полученных оценок за контрольно-рейтинговые мероприятия текущего контроля.</p> <p>Обучающийся может повысить свой рейтинг путем компьютерного тестирования в системе АСТ-тест или онлайн. Студентам предъявляется 40 вопросов по всем темам курса. Время выполнения 1 час. Максимальное количество баллов - 20 баллов. При оценивании результатов учебной деятельности обучающегося по дисциплине используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179) .</p> | <p>Зачтено: рейтинг обучающегося за мероприятие больше или равно 60 %.</p> <p>Не зачтено: рейтинг обучающегося за мероприятие меньше 60 %.</p> |
| Реферат | <p>Оценивается полнота раскрытия темы, количество использованных источников литературы, качество оформления. При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179). Максимальное количество баллов - 10. Весовой коэффициент 1.</p> | <p>Зачтено: рейтинг обучающегося за мероприятие больше или равно 60 %.</p> <p>Не зачтено: рейтинг обучающегося за мероприятие меньше 60 %.</p> |
| тесты | <p>Тесты проводятся на платформе Электронный ЮУрГУ. Студентам предъявляются 20 вопросов по контролируемой теме. Оценивается правильность выбранных вариантов ответов. При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179). Максимальное количество баллов за тест - 10. За каждый правильный ответ начисляется 0,5 балла. Весовой коэффициент - 1</p> | <p>Зачтено: рейтинг обучающегося за мероприятие больше или равно 60 %.</p> <p>Не зачтено: рейтинг обучающегося за мероприятие меньше 60 %.</p> |
| Контрольная работа | <p>Предъявляется 10 задач по всем темам курса. Оценивается ход и результат решения. При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179). Максимальное количество баллов - 10. За каждую правильно решенную задачу 1 балл. Весовой коэффициент 1.</p> | <p>Зачтено: рейтинг обучающегося за мероприятие больше или равно 60 %.</p> <p>Не зачтено: рейтинг обучающегося за мероприятие меньше 60 %.</p> |

7.3. Типовые контрольные задания

| Вид контроля | Типовые контрольные задания |
|--------------------|-----------------------------|
| зачет | РЦБ_тесты.doc |
| Реферат | Темы рефератов.docx |
| тесты | Тест РЦБ.docx |
| Контрольная работа | |

8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

Печатная учебно-методическая документация

а) основная литература:

Не предусмотрена

б) *дополнительная литература:*

Не предусмотрена

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

1. Журнал "Рынок ценных бумаг"

г) *методические указания для студентов по освоению дисциплины:*

1. Каримова, Т. Г. Рынок ценных бумаг Текст сб. задач для решения на практ. занятиях Т. Г. Каримова ; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Экономика и финансы ; ЮУрГУ. - Челябинск: Издательский Центр ЮУрГУ, 2010. - 40, [3] с. ил. электрон. версия

из них: учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студента:

1. Каримова, Т. Г. Рынок ценных бумаг Текст сб. задач для решения на практ. занятиях Т. Г. Каримова ; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Экономика и финансы ; ЮУрГУ. - Челябинск: Издательский Центр ЮУрГУ, 2010. - 40, [3] с. ил. электрон. версия

Электронная учебно-методическая документация

| № | Вид литературы | Наименование ресурса в электронной форме | Библиографическое описание |
|---|--|---|---|
| 1 | Основная литература | Электронно-библиотечная система издательства Лань | Зверев, В.А. Рынок ценных бумаг: Учебник для бакалавров. [Электрон. дан.] / В.А. Зверев, С.Г. Евсюков, А.В. Макеев. — Электрон. дан. — М. : Дашин и др., 2010. — 1 файл. — URL: http://e.lanbook.com/book/61064 |
| 2 | Дополнительная литература | Электронный каталог ЮУрГУ | Каримова, Т. Г. Рынок ценных бумаг Текст сб. задач для решения на практ. занятиях Т. Г. Каримова ; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Экономика и финансы ; ЮУрГУ. - Челябинск: Издательский Центр ЮУрГУ, 2010. - 40, [3] с. ил. http://lib.susu.ru/ftd?base=SUSU_METHOD1&key=000554002&dtype=F |
| 3 | Методические пособия для самостоятельной работы студента | Электронный каталог ЮУрГУ | Каримова, Т. Г. Рынок ценных бумаг и биржевое дело [Электронный ресурс] / Т. Г. Каримова ; ЮУрГУ. - Челябинск : ЮУрГУ, 2018. - 1 файл. - URL: https://lib.susu.ru/ftd?base=SUSU_METHOD&key=000562412?base=SUSU |

9. Информационные технологии, используемые при осуществлении образовательного процесса

Перечень используемого программного обеспечения:

1. Microsoft-Windows(бессрочно)
2. Microsoft-Office(бессрочно)

Перечень используемых информационных справочных систем:

Нет

10. Материально-техническое обеспечение дисциплины

| Вид занятий | № ауд. | Основное оборудование, стенды, макеты, компьютерная техника, предустановленное программное обеспечение, используемое для различных видов занятий |
|---------------------------------|------------|--|
| Лекции | 502 (1) | мультимедийное оборудование |
| Зачет, диф.зачет | 501 (1) | Компьютерная техника (персональные компьютеры) 20 шт |
| Самостоятельная работа студента | 312 (1) | ПК с выходом в Интернет и электронную информационно-образовательную среду университета 12 штук |
| Практические занятия и семинары | 410 (1) | Компьютеры с выходом в Интернет (12 штук) Мультимедийное оборудование (1 штука) |