ЮЖНО-УРАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

УТВЕРЖДАЮ:
Заведующий выпускающей кафедрой

Электронный документ, подписанный ПЭП, хранится в системе электронного документооборота Южно-Уральского государственного университета
СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПЭП
Кому выдан: Соловьева И. А.
Пользователь: solovevaia
Дата подписания: 17.05.2023

И. А. Соловьева

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины 1.Ф.М0.02 Финансовые инструменты и ценные бумаги
для направления 38.04.08 Финансы и кредит
уровень Магистратура
магистерская программа Финансовые рынки и институты
форма обучения очная
кафедра-разработчик Экономика и финансы

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

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

Электронный документ, подписанный ПЭП, хранится в системе электронного документооборота Южно-Уральского государственного университета
СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПЭП
Кому выдан: Соловьева И. А.
Пользователь: solovevaia
Дата подписания: 17.05.2023

И. А. Соловьева

Разработчик программы,
старший преподаватель

Электронный документ, подписанный ПЭП, хранится в системе электронного документооборота Южно-Уральского государственного университета
СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПЭП
Кому выдан: Кузьмин М. Г.
Пользователь: kuzminmg
Дата подписания: 16.05.2023

М. Г. Кузьмин

Челябинск

1. Цели и задачи дисциплины

Цель дисциплины – дать целостное представление о ценных бумагах и производных финансовых инструментах. Задачи дисциплины 1. Выяснить экономическую сущность ценных бумаг, рассмотреть особенности конкретных видов ценных бумаг, условия их выпуска и обращения, возможности использования в практике экономических субъектов. 2. Рассмотреть структуру рынка ценных бумаг, виды его участников (профессиональных участников, инвесторов, эмитентов), их взаимодействие, а также операции различных категорий участников с ценными бумагами. 3. Дать представление об основах инвестирования в ценные бумаги, методах инвестиционного анализа и оценки финансовых рисков, связанных с ценными бумагами.

Краткое содержание дисциплины

2. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины

Планируемые результаты освоения ОП ВО (компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине
ПК-4 Способен осуществлять поиск, анализ и оценку финансовой и экономической информации для формирования финансового плана и целевого инвестиционного портфеля клиента (ПК-4)	Знает: основные виды ценных бумаг: акции и облигации, основные отличия между ними, их роль в формировании диверсифицированного инвестиционного портфеля; принципы расчета доходности различных типов активов Умеет: оценивать доходность основных финансовых инструментов в процессе формирования целевого инвестиционного портфеля; определять порядок проведения финансовых операций в зависимости от вида финансовых продуктов Имеет практический опыт: расчета целевой доходности в зависимости от финансовых целей и начального капитала

3. Место дисциплины в структуре ОП ВО

Перечень предшествующих дисциплин, видов работ учебного плана	Перечень последующих дисциплин, видов работ
Нет	Оценка инвестиционной привлекательности бизнеса, Производные финансовые инструменты на биржевых рынках, Мировые финансовые рынки, Производственная практика (преддипломная) (4 семестр), Учебная практика (ознакомительная) (2 семестр)

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

Нет

4. Объём и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 з.е., 108 ч., 56,5 ч. контактной работы

Вид учебной работы	Всего часов	Распределение по семестрам в часах
		Номер семестра
		1
Общая трудоёмкость дисциплины	108	108
Аудиторные занятия:	48	48
Лекции (Л)	16	16
Практические занятия, семинары и (или) другие виды аудиторных занятий (ПЗ)	32	32
Лабораторные работы (ЛР)	0	0
Самостоятельная работа (СРС)	51,5	51,5
Подготовка к семинарам	36,5	36.5
Подготовка к экзамену	15	15
Консультации и промежуточная аттестация	8,5	8,5
Вид контроля (зачет, диф.зачет, экзамен)	-	экзамен

5. Содержание дисциплины

№ раздела	Наименование разделов дисциплины	Объем аудиторных занятий по видам в часах			
		Всего	Л	ПЗ	ЛР
1	Экономическая сущность ценных бумаг	4	2	2	0
2	Основные ценные бумаги	28	8	20	0
3	Вторичные ценные бумаги	4	2	2	0
4	Производные ценные бумаги	8	2	6	0
5	Размещение и обращение эмиссионных ценных бумаг	4	2	2	0

5.1. Лекции

№ лекции	№ раздела	Наименование или краткое содержание лекционного занятия	Кол-во часов
1	1	Экономическая сущность ценных бумаг и их классификация	2
2	2	Акции	2
3	2	Облигации	2
4	2	Векселя	2
5	2	Государственные ценные бумаги	1
6	2	Другие основные ценные бумаги	1
7	3	Вторичные ценные бумаги	2
8	4	Производные финансовые инструменты	2
9	5	Размещение и обращение эмиссионных ценных бумаг	2

5.2. Практические занятия, семинары

№ занятия	№ раздела	Наименование или краткое содержание практического занятия, семинара	Кол-во часов
1	1	Экономическая сущность ценных бумаг и их классификация	2
2	2	Акции	6
3	2	Облигации	6
4	2	Векселя	6
5	2	Государственные ценные бумаги	2
6	3	Вторичные ценные бумаги	2
7	4	Производные финансовые инструменты	6
8	5	Размещение и обращение эмиссионных ценных бумаг	2

5.3. Лабораторные работы

Не предусмотрены

5.4. Самостоятельная работа студента

Выполнение СРС			
Подвид СРС	Список литературы (с указанием разделов, глав, страниц) / ссылка на ресурс	Семестр	Кол-во часов
Подготовка к семинарам	Павлова, Е. В. Ценные бумаги и производные финансовые инструменты : учебное пособие / Е. В. Павлова. — Тольятти : ТГУ, 2016. — 182 с. — ISBN 978-5-8259-0957-8. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: https://e.lanbook.com/book/139777	1	36,5
Подготовка к экзамену	Павлова, Е. В. Ценные бумаги и производные финансовые инструменты : учебное пособие / Е. В. Павлова. — Тольятти : ТГУ, 2016. — 182 с. — ISBN 978-5-8259-0957-8. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: https://e.lanbook.com/book/139777	1	15

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

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

6.1. Контрольные мероприятия (КМ)

№ КМ	Се-местр	Вид контроля	Название контрольного мероприятия	Вес	Макс. балл	Порядок начисления баллов	Учи-тыва-ется в

							ПА
1	1	Текущий контроль	Тестирование по теме "Ценные бумаги. Понятия и виды"	1	20	Студентам предлагается тест из 20 вопросов. Время для прохождения теста - 30 минут. За каждый верный ответ начисляется 1 балл. За неверный ответ - 0 баллов. Максимальное количество баллов - 20.	экзамен
2	1	Текущий контроль	Тестирование по теме "Акции"	1	20	Студентам предлагается тест из 20 вопросов. Время для прохождения теста - 30 минут. За каждый верный ответ начисляется 1 балл. За неверный ответ - 0 баллов. Максимальное количество баллов - 20.	экзамен
3	1	Текущий контроль	Тестирование по теме "Облигации"	1	20	Студентам предлагается тест из 20 вопросов. Время для прохождения теста - 30 минут. За каждый верный ответ начисляется 1 балл. За неверный ответ - 0 баллов. Максимальное количество баллов - 20.	экзамен
4	1	Текущий контроль	Тестирование по теме "Вексель"	1	20	Студентам предлагается тест из 20 вопросов. Время для прохождения теста - 30 минут. За каждый верный ответ начисляется 1 балл. За неверный ответ - 0 баллов. Максимальное количество баллов - 20.	экзамен
5	1	Текущий контроль	Тестирование по теме "Государственные ценные бумаги"	1	5	Студентам предлагается тест из 5 вопросов. Время для прохождения теста - 10 минут. За каждый верный ответ начисляется 1 балл. За неверный ответ - 0 баллов. Максимальное количество баллов - 5.	экзамен
6	1	Текущий контроль	Тестирование по теме "Вторичные и другие ценные бумаги"	1	20	Студентам предлагается тест из 20 вопросов. Время для прохождения теста - 30 минут. За каждый верный ответ начисляется 1 балл. За неверный ответ - 0 баллов. Максимальное количество баллов - 20.	экзамен
7	1	Текущий контроль	Тестирование по теме "Производные ценные бумаги"	1	20	Студентам предлагается тест из 20 вопросов. Время для прохождения теста - 30 минут. За каждый верный ответ начисляется 1 балл. За неверный ответ - 0 баллов. Максимальное количество баллов - 20.	экзамен
8	1	Проме-жуточная аттестация	Итоговый тест	-	35	Студентам предлагается тест из 35 вопросов (по 5 вопросов из каждой темы). Время для прохождения теста - 60 минут. За каждый верный ответ начисляется 1 балл. За неверный ответ - 0 баллов. Максимальное количество баллов - 35.	экзамен

6.2. Процедура проведения, критерии оценивания

Вид	Процедура проведения	Критерии

промежуточной аттестации		оценивания
экзамен	На экзамене происходит оценивание знаний, умений и приобретенного опыта обучающихся по дисциплине на основе полученных оценок за контрольно-рейтинговые мероприятия текущего контроля. Прохождение контрольного мероприятия промежуточной аттестации не является обязательным для студента. При недостаточной и/или не устраивающей студента величине рейтинга ему может быть предложено пройти контрольно-рейтинговое мероприятие промежуточной аттестации. В результате складывается совокупный рейтинг студента, который дифференцируется в оценку и проставляется в ведомость, зачетную книжку студента.	В соответствии с пп. 2.5, 2.6 Положения

6.3. Паспорт фонда оценочных средств

Компетенции	Результаты обучения	№ КМ							
		1	2	3	4	5	6	7	8
ПК-4	Знает: основные виды ценных бумаг: акции и облигации, основные отличия между ними, их роль в формировании диверсифицированного инвестиционного портфеля; принципы расчета доходности различных типов активов	+	+	+	+	+	+	+	+
ПК-4	Умеет: оценивать доходность основных финансовых инструментов в процессе формирования целевого инвестиционного портфеля; определять порядок проведения финансовых операций в зависимости от вида финансовых продуктов		+	+	+	+	+	+	+
ПК-4	Имеет практический опыт: расчета целевой доходности в зависимости от финансовых целей и начального капитала		+	+	+	+	+	+	+

Типовые контрольные задания по каждому мероприятию находятся в приложениях.

7. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

Печатная учебно-методическая документация

а) основная литература:

1. Ценные бумаги Учеб. для экон. специальностей вузов В. И. Колесников, В. С. Торкановский, Л. С. Тарасевич и др.; Под ред.: В. И. Колесникова, В. С. Торкановского. - 2-е изд., перераб. и доп. - М.: Финансы и статистика, 2001. - 446,[1] с.

б) дополнительная литература:

1. Практикум по курсу "Ценные бумаги" Учеб. пособие для вузов для экон. специальностей В. И. Колесников, В. С. Торкановский, В. Д. Никифорова и др.; Под ред.: В. С. Торкановского, В. С. Колесникова. - М.: Финансы и статистика, 2000. - 298,[1] с.

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

Не предусмотрены

г) методические указания для студентов по освоению дисциплины:

1. Методическое пособие для СРС

из них: учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студента:

1. Методическое пособие для СРС

Электронная учебно-методическая документация

№	Вид литературы	Наименование ресурса в электронной форме	Библиографическое описание
1	Основная литература	Электронно-библиотечная система издательства Лань	Павлова, Е. В. Ценные бумаги и производные финансовые инструменты : учебное пособие / Е. В. Павлова. — Тольятти : ТГУ, 2016. — 182 с. — ISBN 978-5-8259-0957-8. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: https://e.lanbook.com/book/139777 (дата обращения: 01.12.2021). — Режим доступа: для авториз. пользователей.

Перечень используемого программного обеспечения:

Нет

Перечень используемых профессиональных баз данных и информационных справочных систем:

Нет

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Вид занятий	№ ауд.	Основное оборудование, стенды, макеты, компьютерная техника, предустановленное программное обеспечение, используемое для различных видов занятий
Контроль самостоятельной работы	410 (1)	Моноблоки - 13 шт., Проектор - 1 шт., Экран - 1 шт., Доска - 1 шт.
Экзамен	410 (1)	Моноблоки - 13 шт., Проектор - 1 шт., Экран - 1 шт., Доска - 1 шт.
Практические занятия и семинары	410 (1)	Моноблоки - 13 шт., Проектор - 1 шт., Экран - 1 шт., Доска - 1 шт.
Лекции	410 (1)	Моноблоки - 13 шт., Проектор - 1 шт., Экран - 1 шт., Доска - 1 шт.