

ЮЖНО-УРАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

УТВЕРЖДАЮ:
Директор института
Высшая школа экономики и
управления

_____ И. П. Савельева
09.05.2018

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА
к ОП ВО от 27.06.2018 №084-2112**

дисциплины Б.1.24 Рынок ценных бумаг
для специальности 38.05.01 Экономическая безопасность
уровень специалиста тип программы Специалитет
специализация Судебная экономическая экспертиза
форма обучения очная
кафедра-разработчик Финансы, денежное обращение и кредит

Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.05.01 Экономическая безопасность, утверждённым приказом Минобрнауки от 16.01.2017 № 20

Зав.кафедрой разработчика,
д.экон.н., проф.
(ученая степень, ученое звание)

_____ 08.05.2018
(подпись)

И. А. Баев

Разработчик программы,
к.экон.н., доц., доцент
(ученая степень, ученое звание,
должность)

_____ 07.05.2018
(подпись)

Т. Г. Каримова

СОГЛАСОВАНО
Зав.выпускающей кафедрой Экономическая безопасность
д.экон.н., доц.
(ученая степень, ученое звание)

_____ 08.05.2018
(подпись)

А. В. Карпушкина

Челябинск

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 цennыми 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)
ОПК-2 способностью использовать закономерности и методы экономической науки при решении профессиональных задач	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-31 способностью на основе статистических данных исследовать социально-экономические процессы в целях прогнозирования возможных угроз экономической безопасности	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.

3. Место дисциплины в структуре ОП ВО

Перечень предшествующих дисциплин, видов работ учебного плана	Перечень последующих дисциплин, видов работ
Б.1.25 Деньги, кредит, банки, Б.1.11.02 Макроэкономика, Б.1.27 Экономическая статистика	Б.1.30 Инвестиции и инвестиционный анализ, Б.1.35 Оценка рисков, Б.1.43 Риски управления портфелем финансовых активов

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

Дисциплина	Требования
Б.1.25 Деньги, кредит, банки	Знать : - правовые вопросы деятельности кредитных организаций на финансовом рынке, - экономическую сущность кредита и кредитных операций, - источники формирования ресурсной базы кредитной организации. Владеть навыками экономических расчетов в банковской деятельности.
Б.1.11.02 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.
Б.1.27 Экономическая статистика	Знать и владеть методами расчета основных макроэкономических показателей, относительных показателей, средних для оценки разного рода экономических процессов и явлений. - сущность и

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	
		5	
Общая трудоёмкость дисциплины	108	108	
<i>Аудиторные занятия</i>	48	48	
Лекции (Л)	32	32	
Практические занятия, семинары и (или) другие виды аудиторных занятий (ПЗ)	16	16	
Лабораторные работы (ЛР)	0	0	
<i>Самостоятельная работа (CPC)</i>	60	60	
Реферат	20	20	
Домашние задания	20	20	
Подготовка к зачету	20	20	
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	Рынок ценных бумаг: понятия и содержание дисциплины. Выпуск и обращение ценных бумаг	2	2	0	0
2	Институциональные и профессиональные участники рынка ценных бумаг.	4	4	0	0
3	Экономическая сущность, классификация ценных бумаг	2	2	0	0
4	Корпоративные ценные бумаги: акции, облигации.	8	4	4	0
5	Государственные ценные бумаги.	4	2	2	0
6	Прочие ценные бумаги.	4	2	2	0
7	Производные ценные бумаги.	6	4	2	0
8	Биржевой и внебиржевой рынок. Сделки на рынке ценных бумаг.	6	4	2	0
9	Методы анализа фондового рынка.	4	2	2	0
10	Биржевые индексы.	2	2	0	0
11	Фондовый портфель: понятие, формирование и модели	4	2	2	0

	управления.				
12	Регулирование рынка ценных бумаг.	2	2	0	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	2	Институциональные участники рынка ценных бумаг.	2
3	2	Профессиональные участники рынка ценных бумаг	2
4	3	Экономическая сущность, классификация ценных бумаг.	2
5	4	Корпоративные ценные бумаги: акции.	2
6	4	Корпоративные ценные бумаги: облигации.	2
7	5	Государственные ценные бумаги.	2
8	6	Прочие ценные бумаги.	2
9	7	Производные ценные бумаги: фьючерсы.	2
10	7	Производные ценные бумаги: опционы.	2
11	8	Биржевой и внебиржевой рынок.	2
12	8	Сделки на рынке ценных бумаг.	2
13	9	Методы анализа фондового рынка.	2
14	10	Биржевые индексы.	2
15	11	Фондовый портфель: понятие, формирование и модели управления.	2
16	12	Регулирование рынка ценных бумаг.	2

5.2. Практические занятия, семинары

№ занятия	№ раздела	Наименование или краткое содержание практического занятия, семинара	Кол-во часов
1	4	Акции. Решение задач. Тест.	2
2	4	Корпоративные облигации. Решение задач. Тест.	2
3	5	Государственные ценные бумаги. Задачи. Тест.	2
4	6	Вексель. Задачи. Тест.	2
5	7	Фьючерсные контракты. Задачи.	2
6	8	Опционные контракты. Задачи. Тест.	2
7	9	Фундаментальный анализ фондового рынка. Практическая работа.	2
8	11	Фондовый портфель: расчет параметров. Задачи. Тест.	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)	Кол-во часов
Реферат	Рынок ценных бумаг Текст учебник для вузов по экон. направлениям и	20

	<p>специальностям Н. И. Берзон и др.; под общ. ред. Н. И. Берзона ; Высш. шк. экономики (Нац. исслед. ун-т). - 4-е изд., перераб. и доп. - М.: Юрайт, 2016. - 442, [1] с. ил. Шарп, У. Ф. Инвестиции Текст учебник для вузов по экон. специальностям У. Ф. Шарп, Г. Д. Александр, Д. В. Бейли ; пер. с англ. А. Н. Буренина, А. А. Васина. - М.: ИНФРА-М, 2014. - XII, 1027 с. ил. Рынок ценных бумаг Учеб. В. А. Галанов, А. И. Басов, З. К. Голда и др.; Под ред. В. А. Галанова, А. И. Басова; Рос. экон. акад. им. Г. В. Плеханова. - 2-е изд., перераб. и доп. - М.: Финансы и статистика, 2006. - 446 с. ил. Рынок ценных бумаг и биржевое дело Учеб. для вузов О. И. Дегтярева, Н. М. Коршунов, Е. Ф. Жуков и др.; Под ред. О. И. Дегтяревой и др. - М.: ЮНИТИ, 2004. - 499,[2] с.</p>	
Домашние задания	<p>Каримова, Т. Г. Рынок ценных бумаг Учеб. пособие Т. Г. Каримова; Под ред. Е. Д. Вайсман; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Экономика и финансы; ЮУрГУ. - Челябинск: Издательство ЮУрГУ, 2004. - 89, [1] с. 2 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</p>	20
Подготовка к зачету	<p>Рынок ценных бумаг Текст учебник для вузов по экон. направлениям и специальностям Н. И. Берзон и др.; под общ. ред. Н. И. Берзона ; Высш. шк. экономики (Нац. исслед. ун-т). - 4-е изд., перераб. и доп. - М.: Юрайт, 2016. - 442, [1] с. ил. Шарп, У. Ф. Инвестиции Текст учебник для вузов по экон. специальностям У. Ф. Шарп, Г. Д. Александр, Д. В. Бейли ; пер. с англ. А. Н. Буренина, А. А. Васина. - М.: ИНФРА-М, 2014. - XII, 1027 с. ил. Рынок ценных бумаг Учеб. В. А. Галанов, А. И. Басов, З. К. Голда и др.; Под ред. В. А. Галанова, А. И. Басова; Рос. экон. акад. им. Г. В. Плеханова. - 2-е изд., перераб. и доп. - М.: Финансы и статистика, 2006. - 446 с. ил. Рынок ценных бумаг и биржевое дело Учеб. для вузов О. И. Дегтярева, Н. М. Коршунов, Е. Ф. Жуков и др.; Под ред. О. И. Дегтяревой и др. - М.: ЮНИТИ, 2004. - 499,[2] с.</p>	20

6. Инновационные образовательные технологии, используемые в учебном процессе

Инновационные формы учебных занятий	Вид работы (Л, ПЗ, ЛР)	Краткое описание	Кол-во ауд. часов
Деловые игры	Практические занятия и семинары	Деловая игра "Фондовая биржа". Деловая игра представляет собой имитацию торгов на фондовой бирже. Задача игрока: совершая сделки купли-продажи финансовых инструментов, максимально увеличить свой капитал.	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
Все разделы	ОПК-2 способностью использовать закономерности и методы экономической науки при решении профессиональных задач	контрольная работа	1-20
Все разделы	ПК-31 способностью на основе статистических данных исследовать социально-экономические процессы в целях прогнозирования возможных угроз экономической безопасности	тест	1-23
Все разделы	ОПК-2 способностью использовать закономерности и методы экономической науки при решении профессиональных задач	Зачет	все
Все разделы	ПК-31 способностью на основе статистических данных исследовать социально-экономические процессы в целях прогнозирования возможных угроз экономической безопасности	Зачет	все

7.2. Виды контроля, процедуры проведения, критерии оценивания

Вид контроля	Процедуры проведения и оценивания	Критерии оценивания
тест	проверка	Отлично: более 90% Хорошо: более 75% Удовлетворительно:

		более 60% Неудовлетворительно: менее 60%
контрольная работа	проверка	Отлично: более 90% Хорошо: более 75% Удовлетворительно: более 60% Неудовлетворительно: менее 60%
Зачет	Зачет проводится путем компьютерного тестирования в системе АСТ-тест. Студентам предъявляется 40 вопросов по всем темам курса. Время выполнения 1 час.	Зачтено: более 60% Не зачтено: менее 60%

7.3. Типовые контрольные задания

Вид контроля	Типовые контрольные задания
тест	Тест АО.docx
контрольная работа	Тест 3.doc
Зачет	РЦБ_тесты.doc

8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

Печатная учебно-методическая документация

а) основная литература:

1. Каримова, Т. Г. Рынок ценных бумаг Учеб. пособие Т. Г. Каримова; Под ред. Е. Д. Вайсман; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Экономика и финансы; ЮУрГУ. - Челябинск: Издательство ЮУрГУ, 2004. - 89, [1] с.
2. Каримова, Т. Г. Рынок ценных бумаг Текст сб. задач для решения на практик. 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
3. Рынок ценных бумаг [Текст] учебник для вузов по экон. направлениям и специальностям Н. И. Берзон и др.; под общ. ред. Н. И. Берзона ; Высш. шк. экономики (Нац. исслед. ун-т). - 4-е изд., перераб. и доп. - М.: Юрайт, 2016. - 442, [1] с. ил.

б) дополнительная литература:

1. Шарп, У. Ф. Инвестиции Текст учебник для вузов по экон. специальностям У. Ф. Шарп, Г. Д. Александр, Д. В. Бейли ; пер. с англ. А. Н. Буренина, А. А. Васина. - М.: ИНФРА-М, 2014. - XII, 1027 с. ил.
2. Рынок ценных бумаг Учеб. В. А. Галанов, А. И. Басов, З. К. Голда и др.; Под ред. В. А. Галанова, А. И. Басова; Рос. экон. акад. им. Г. В. Плеханова. - 2-е изд., перераб. и доп. - М.: Финансы и статистика, 2006. - 446 с. ил.
3. Рынок ценных бумаг и биржевое дело Учеб. для вузов О. И. Дегтярева, Н. М. Коршунов, Е. Ф. Жуков и др.; Под ред. О. И. Дегтяревой и др. - М.: ЮНИТИ, 2004. - 499,[2] с.

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 практик. 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:

2. Каримова, Т. Г. Рынок ценных бумаг Текст сб. задач для решения на практик. 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 разработки	На
1	Основная литература	Лялин, В.А. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс] : учеб. / В.А. Лялин, П.В. Воробьев. — Электрон. дан. — Москва : Проспект, 2015. — 400 с. — Режим доступа: https://e.lanbook.com/book/54874 .	Эл би си Из Ла
2	Дополнительная литература	Каримова, Т. Г. Рынок ценных бумаг Текст сб. задач для решения на практик. 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 (режим доступа http://lib.susu.ru/ftd?base=SUSU_METHOD1&key=000554002&dtype=F&etype=.pdf)	Эл кат Ю

9. Информационные технологии, используемые при осуществлении образовательного процесса

Перечень используемого программного обеспечения:

1. Microsoft-Office(бессрочно)

Перечень используемых информационных справочных систем:

1. -Консультант Плюс(31.07.2017)
2. -Гарант(31.12.2018)

10. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Вид занятий	№	Основное оборудование, стеллы, макеты, компьютерная техника,
-------------	---	--------------------------------------------------------------

	ауд.	предустановленное программное обеспечение, используемое для различных видов занятий
Лекции	401 (1a)	мультимедийное оборудование
Зачет,диф.зачет	501 (1a)	Компьютерная техника
Практические занятия и семинары	312 (1)	Мультимедийное оборудование
Контроль самостоятельной работы	312 (1)	Мультимедийное оборудование