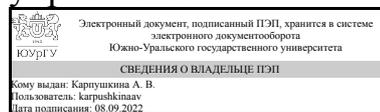


ЮЖНО-УРАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

УТВЕРЖДАЮ:
Директор института
Высшая школа экономики и
управления



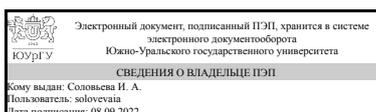
А. В. Карпушкина

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины Б.1.24 Рынок ценных бумаг
для направления 38.03.01 Экономика
уровень бакалавр тип программы Академический бакалавриат
профиль подготовки Финансы и кредит
форма обучения заочная
кафедра-разработчик Экономика и финансы

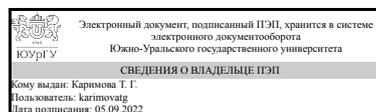
Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, утверждённым приказом Минобрнауки от 12.11.2015 № 1327

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



И. А. Соловьева

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



Т. Г. Каримова

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)
<p>ПК-6 способностью анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей</p>	<p>Знать:- понятие, виды, принципы расчета фондовых индексов, - понятие, виды, методы расчета рейтинговых оценок, - методику фундаментального анализа эмитента, - методы технического анализа фондового рынка.</p>
	<p>Уметь:- проводить оценку текущей конъюнктуры фондового рынка, - прогнозировать движение курсов ценных бумаг на фондовом рынке методами фундаментального и технического анализа.</p>
	<p>Владеть:- методами фундаментального и технического анализа, - методами сбора экономической и статистической информации для целей анализа фондового рынка.</p>
<p>ОК-3 способностью использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности</p>	<p>Знать:- понятия и особенности ценных бумаг различных видов, - участников рынка ценных бумаг и операции между ними, - законодательные основы деятельности на рынке ценных бумаг.</p>
	<p>Уметь:- применять знания по рынку ценных бумаг в практической деятельности, - осуществлять обоснованный выбор стратегий и операций на рынке ценных бумаг, - принимать инвестиционные решения на финансовом рынке.</p>
	<p>Владеть:- методами расчета экономической эффективности операций с ценными бумагами, - методами технического анализа фондового рынка, - методами фундаментального анализа эмитента.</p>
<p>ПК-7 способностью, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет</p>	<p>Знать:- понятие, виды, принципы расчета фондовых индексов, - понятие, виды, методы расчета рейтинговых оценок, - методику фундаментального анализа эмитента, - методы технического анализа фондового рынка.</p>
	<p>Уметь:- проводить оценку текущей конъюнктуры фондового рынка, - прогнозировать движение курсов ценных бумаг на фондовом рынке методами фундаментального и технического анализа.</p>
	<p>Владеть:- методами фундаментального и технического анализа, - методами сбора экономической и статистической информации для целей анализа фондового рынка.</p>

3. Место дисциплины в структуре ОП ВО

Перечень предшествующих дисциплин, видов работ учебного плана	Перечень последующих дисциплин, видов работ
Б.1.09 Макроэкономика	ДВ.1.08.03 Оценка стоимости бизнеса, ДВ.1.05.03 Биржевое дело, В.1.16 Риск-менеджмент

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

Дисциплина	Требования
Б.1.09 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	
Реферат	30	30	
Подготовка к зачету	36	36	
Изучение и конспектирование учебной и научной литературы	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 работы на рынке ценных бумаг.	6	4	2	0

5.1. Лекции

№ лекции	№ раздела	Наименование или краткое содержание лекционного занятия	Кол-во часов
1	1	Теоретические основы функционирования рынка ценных бумаг	2
2	1	Государственное регулирование рынка ценных бумаг	2

3	2	Практические основы работы на рынке ценных бумаг	2
4	2	Практические основы работы на рынке ценных бумаг	2

5.2. Практические занятия, семинары

№ занятия	№ раздела	Наименование или краткое содержание практического занятия, семинара	Кол-во часов
1	1	Теоретические основы функционирования рынка ценных бумаг	2
2	2	Практические основы работы на рынке ценных бумаг. 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	Р1. Рынок ценных бумаг Текст учебник для вузов по экон. направлениям и специально Берзон 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 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&k
Изучение и конспектирование учебной и научной литературы	1. Бердникова, Т. Б. Рынок ценных бумаг : прошлое, настоящее, будущее [Текст] монография 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. — Ре http://e.lanbook.com/book/61064 3. Каримова, Т. Г. Рынок ценных бумаг [Текст] сб. задач направлений "Экономика" и "Менеджмент" Т. Г. Каримова ; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. денежное обращение и кредит ; ЮУрГУ. - Челябинск: Издательский Центр ЮУрГУ, 2018 электрон. версия 4. Каримова, Т. Г., Рынок ценных бумаг и биржевое дело [Электронный учеб. пособие для бакалавров направления 38.03.01 "Экономика" и др. / Т. Г. Каримова гос. ун-т, Каф. Финансы, денежное обращение и кредит ; ЮУрГУ, Челябинск , 2018 Реж https://lib.susu.ru/ftd?base=SUSU_METHOD&key=000562412?base=SUSU_METHOD&k 5. Михайленко, М. Н. Рынок ценных бумаг [Текст] учебник и практикум для вузов по экон. направлениям и специальностям М. Н. Михайленко ; Гос. ун-т упр. - М.: Юрайт, 2017. - 397 с. ил. 6. Рынок ценных бумаг [Текст] учебник для вузов по экон. направлениям и специальностям Берзон 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 по экон. направлениям и специальностям под ред. Ю. А. Соколова ; Финанс. ун-т при ИР Рос. Федерации. - М.: Юрайт, 2016. - 383 с. ил. 8. Селищев, А. С. Рынок ценных бумаг учебник и практикум для вузов по экон. направлениям и специальностям А. С. Селищев Маховикова ; С.- Петерб. гос. экон. ун-т. - 3-е изд., перераб. и доп. - М.: Юрайт, 2016. - 397 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 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. Буренина 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
Все разделы	ПК-7 способностью, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет	зачет	все
Все разделы	ОК-3 способностью использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности	зачет	все
Все разделы	ПК-6 способностью анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей	зачет	все
Все разделы	ОК-3 способностью использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности	тесты	все
Все разделы	ПК-7 способностью, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет	Реферат	темы рефератов

7.2. Виды контроля, процедуры проведения, критерии оценивания

Вид контроля	Процедуры проведения и оценивания	Критерии оценивания
зачет	На зачете происходит оценивание учебной деятельности обучающихся по дисциплине на основе полученных оценок за контрольно-рейтинговые мероприятия текущего контроля и промежуточной аттестации. Промежуточная аттестация проводится путем компьютерного тестирования в системе АСТ-тест. К промежуточной аттестации допускаются студенты, успешно выполнившие контрольные мероприятия текущего контроля. Студентам предъявляется 40 вопросов по всем темам курса. Время выполнения 1 час. Максимальное количество баллов - 20 баллов. За каждый правильный ответ 0,5 балла. 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) .	Зачтено: Рейтинг обучающегося по дисциплине больше или равен 60% Не зачтено: Рейтинг обучающегося по дисциплине меньше 60%
Реферат	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 - 1. Весовой коэффициент 5. Тема раскрыта достаточно полно, использовано не менее 15 источников литературы, оформление соответствует стандарту - 1 балл. Тема раскрыта недостаточно, малое количество использованных источников литературы, оформление не соответствует стандарту. 0 баллов	Зачтено: Рейтинг обучающегося больше или равен 60% Не зачтено: Рейтинг обучающегося меньше 60%
тесты	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 - 5. За каждый правильный ответ начисляется 0,25 балла. Весовой коэффициент - 1	Зачтено: Рейтинг обучающегося больше или равен 60% Не зачтено: Рейтинг обучающегося меньше 60%

7.3. Типовые контрольные задания

Вид контроля	Типовые контрольные задания
зачет	РЦБ_тесты.doc
Реферат	Темы рефератов.docx
тесты	тесты_рынок ценных бумаг.pdf

8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

Печатная учебно-методическая документация

а) основная литература:

1. 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.

2. Рынок ценных бумаг [Текст] учебник для вузов по экон. специальностям Е. Ф. Жуков, Л. Т. Литвиненко, А. В. Печникова и др.; под ред. Е. Ф. Жукова. - 2-е изд., перераб. и доп. - М.: ЮНИТИ, 2007. - 463 с. ил.
3. Ивасенко, А. Г. Рынок ценных бумаг: Инструменты и механизмы функционирования [Текст] учеб. пособие для вузов А. Г. Ивасенко, Я. И. Никонова, В. А. Павленко. - 3-е изд., перераб. - М.: КНОРУС, 2007. - 271 с.

б) дополнительная литература:

1. Шарп, У. Ф. Инвестиции Текст учебник для вузов по экон. специальностям У. Ф. Шарп, Г. Д. Александер, Д. В. Бейли ; пер. с англ. А. Н. Буренина, А. А. Васина. - М.: ИНФРА-М, 2014. - XII, 1027 с. ил.
2. Рынок ценных бумаг [Текст] учебник для вузов по экон. направлениям и специальностям А. Б. Басс и др.; под ред. Ю. А. Соколова ; Финанс. ун-т при Правительстве Рос. Федерации. - М.: Юрайт, 2014. - 383 с. ил.
3. Батяева, Т. А. Рынок ценных бумаг [Текст] учеб. пособие для вузов по специальности 080105 "Финансы и кредит" Т. А. Батяева, И. И. Столяров ; Моск. гос. ун-т им. М. В. Ломоносова, Фак. гос. упр. - М.: ИНФРА-М, 2010. - 304, [1] с. ил.
4. Мишарев, А. А. Рынок ценных бумаг [Текст] учеб. пособие по специальностям "Финансы и кредит", "Бухгалт. учет, анализ и аудит" А. А. Мишарев. - СПб. и др.: Питер, 2007. - 250, [1] с.
5. Селищев, А. С. Рынок ценных бумаг [Текст] учебник и практикум для вузов по экон. направлениям и специальностям А. С. Селищев, Г. А. Маховикова ; С.- Петерб. гос. экон. ун-т. - 3-е изд., перераб. и доп. - М.: Юрайт, 2016. - 483 с. ил., табл.

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	Дополнительная	Электронный	Каримова, Т. Г. Рынок ценных бумаг Текст сб. задач для решения на пр

