

МИНОБРНАУКИ РОССИИ

федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«Кузбасский государственный технический университет имени Т. Ф. Горбачева»

Институт экономики и управления



ПОДПИСАНО ЭП КУЗГТУ

Подразделение: кафедра экономики

Должность: доцент (к.н., спд)

Дата: 16.05.2022 16:38:06

Якунина Юлия Сергеевна

Рабочая программа дисциплины

Рынок ценных бумаг

Специальность 38.05.01 Экономическая безопасность

Специализация / направленность (профиль) Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Присваиваемая квалификация
"Экономист"

Формы обучения
заочная, очная

Кемерово 2022 г.



1550962962

Рабочую программу составил:

ПОДПИСАНО ЭП КУЗГТУ

Подразделение: кафедра финансов и кредита

Должность: заведующий кафедрой (д.н)

Дата: 14.03.2022 03:10:25

Лубкова Эльмира Миннулловна

Рабочая программа обсуждена на заседании кафедры финансов и кредита

Протокол № 3/1 от 14.03.2022

ПОДПИСАНО ЭП КУЗГТУ

Подразделение: кафедра финансов и кредита

Должность: заведующий кафедрой (д.н)

Дата: 14.03.2022 16:49:22

Лубкова Эльмира Миннулловна

Согласовано учебно-методической комиссией по направлению подготовки (специальности)
38.05.01 Экономическая безопасность

Протокол № 4/1 от 04.04.2022

ПОДПИСАНО ЭП КУЗГТУ

Подразделение: кафедра финансов и кредита

Должность: заведующий кафедрой (д.н)

Дата: 04.04.2022 06:32:07

Лубкова Эльмира Миннулловна



1550962962

1 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине "Рынок ценных бумаг", соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Освоение дисциплины направлено на формирование:
обще профессиональных компетенций:

ОПК-2 - способностью использовать закономерности и методы экономической науки при решении профессиональных задач

профессиональных компетенций:

ПК-34 - способностью проводить комплексный анализ угроз экономической безопасности при планировании и осуществлении инновационных проектов

Результаты обучения по дисциплине определяются индикаторами достижения компетенций

Индикатор(ы) достижения:

Результаты обучения по дисциплине:

экономические риски, природу и сущность угроз экономической безопасности; методы оценки уровня рисков и угроз государственными органами власти в системе экономической безопасности; правовую основу финансовой деятельности в Российской Федерации на макро- и микроуровне осуществлять выбор инструментальных средств для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные выводы;

оценивать затраты и результаты финансовой деятельности организации

навыками выявления, оценки, локализации и нейтрализации угроз экономической безопасности, формирования модели органов государственной власти в системе экономической безопасности.

навыками ведения аналитической работы, способами сбора и анализа информации финансового состояния организации

2 Место дисциплины "Рынок ценных бумаг" в структуре ОПОП специалитета

Для освоения дисциплины необходимы знания умения, навыки и (или) опыт профессиональной деятельности, полученные в рамках изучения следующих дисциплин: Бухгалтерский учет, Деньги, кредит, банки, Статистика, Финансы.

Дисциплина «Рынок ценных бумаг» относится к профессиональному циклу (вариативная часть). «Рынок ценных бумаг» представляет собой дисциплину, формирующую базовые знания для усвоения дисциплин «Международные финансы», «Международные финансово-кредитные отношения».

3 Объем дисциплины "Рынок ценных бумаг" в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам занятий) и на самостоятельную работу обучающихся

Общая трудоемкость дисциплины "Рынок ценных бумаг" составляет 3 зачетных единицы, 108 часов.

Форма обучения	Количество часов		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ
Курс 4/Семестр 7			
Всего часов	108		
Контактная работа обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий):			
Аудиторная работа			
Лекции	16		
Лабораторные занятия			
Практические занятия	34		
Внеаудиторная работа			
Индивидуальная работа с преподавателем:			
Консультация и иные виды учебной деятельности			
Самостоятельная работа	22		



1550962962

Форма обучения	Количество часов		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ
Форма промежуточной аттестации	экзамен /36		
Курс 4/Семестр 8			
Всего часов		108	
Контактная работа обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий):			
Аудиторная работа			
Лекции		4	
Лабораторные занятия			
Практические занятия		6	
Внеаудиторная работа			
Индивидуальная работа с преподавателем:			
Консультация и иные виды учебной деятельности			
Самостоятельная работа		89	
Форма промежуточной аттестации		экзамен /9	

4 Содержание дисциплины "Рынок ценных бумаг", структурированное по разделам (темам)

4.1. Лекционные занятия

Раздел дисциплины, темы лекций и их содержание	Трудоемкость в часах	
	ОФ	ЗФ
1. Общая характеристика рынка ценных бумаг. Понятия рынка. Классификация рынка ценных бумаг. Рынок ценных бумаг как рынок капитала. Функции рынка ценных бумаг. Участники рынка ценных бумаг.	2	1
2. Ценная бумага и её классификации. Понятие ценной бумаги. Ценная бумага как юридическая вещь. Ценная бумага как фиктивная форма стоимости. Экономические виды ценных бумаг. Классификация ценных бумаг.	2	1
3. Виды ценных бумаг и инструментов на их основе. Акция и вторичные документы на ее основе. Облигация. Государственная облигация. Вексель. Закладная и другие ипотечные ценные бумаги. Коносамент. Производные финансовые инструменты на ценные бумаги.	2	
4. Первичный рынок ценных бумаг. Понятие первичного рынка. Эмиссия ценных бумаг. Размещение ценных бумаг и его классификация. Андеррайтинг. Раскрытие информации.	2	1
5. Профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг. Понятие и виды профессиональной деятельности. Брокерская деятельность. Деятельность по управлению ценными бумагами. Депозитарная деятельность. Фондовая биржа как организатор торгов.	2	1
6. Вторичный рынок ценных бумаг. Общее представление о вторичном рынке ценных бумаг обращение ценных бумаг. Эмитенты. Листинг ценных бумаг. Ликвидность ценных бумаг. Виды сделок по ценным бумагам. Инвестирующие и спекулятивные операции. Капитализация фондового рынка.	2	1
7. Регулирование рынка ценных бумаг. Государственное регулирование российского рынка ценных бумаг. Саморегулирование на рынке ценных бумаг. Модели формирования портфеля ценных бумаг.	2	1



1550962962

8. Портфель ценных бумаг. Понятие портфеля ценных бумаг. Управление портфелем ценных бумаг. Модели формирования портфеля ценных бумаг.	2	
--	---	--

4.2 Практические (семинарские) занятия

Тема занятия	Трудоемкость в часах	
	ОФ	ЗФ
1.Общая характеристика рынка ценных бумаг. Ценная бумага и ее классификация	2	1
2.Ценная бумага и ее классификация. Текущий контроль по темам1-2	2	1
3.Виды ценных бумаг и инструментов на их основе	2	1
4.Первичныйрынокценныхбумаг.Текущий контроль по 3-4 темам	2	1
5.Профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг. Разбор конкретных приемов	2	-
6.Вторичный рынок ценных бумаг. Разбор конкретных примеров. Текущий контроль по 5-6 теме	2	1
7.Регулирование рынка ценных бумаг	2	-
8.Портфель ценных бумаг. Текущий контроль по7-8 темам	4	1

4.3 Контрольная работа (для студентов заочного обучения)

Контрольная работа состоит из одного теоретического вопроса и одного практического (расчетного) задания. Темы теоретических вопросов отражают содержание тех разделов, которые не рассматривались на лекциях, но которые предусмотрены для самостоятельного изучения (в объеме часов очной формы). Все вопросы, рассматриваемые в контрольной работе, изучаются студентами самостоятельно. Задание выдается на установочной лекции. Изучение вопросов и выполнение работы производится в течение нескольких месяцев перед сессией, в которой изучается эта дисциплина и на знаниях с преподавателем, что соответствует принципам заочного обучения.

4.4 Самостоятельная работа студента и перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

Очное обучение

Вид СРС	Трудоемкость, час
Д31 Изучить тему «Сравнительная характеристика российских ценных бумаг»	5
Д32 Изучить тему «Закладная и другие ипотечные ценные бумаги»	5
Д33 Изучить тему «Организация процесса торговли ценными бумагами»; Практическое задание на тему «Расчет дохода по ценным бумагам»	5
Д34 Изучить тему «Модели формирования портфеля ценных бумаг: Модель Марковитца. Индексная модель Шарпа. Модель выравнивания цены»	7

Заочное обучение

Вид СРС	Трудоемкость, час
Изучение теоретического материала. Выполнение теоретической части контрольной работы43	43
Выполнение практической (расчетной) части контрольной работы.	43

5 Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине "Рынок ценных бумаг"

5.1 Паспорт фонда оценочных средств

№ п/п	Контролируемые разделы	Содержание (темы) раздела	Код компетенции	Показатель (уровень) освоения	Форма контроля
-------	------------------------	---------------------------	-----------------	-------------------------------	----------------



1550962962

- 10 баллов – при правильном и полном ответе на два вопроса;
 8...9 баллов – при правильном и полном ответе на один из вопросов и правильном, но не полном ответе на другой из вопросов;
 6...7 баллов – при правильном и неполном ответе на два вопроса или правильном и полном ответе только на один из вопросов;
 3...5 баллов – при правильном и неполном ответе только на один из вопросов;
 0...2 баллов – при отсутствии правильных ответов на вопросы.

Шкала оценивания:

Количество баллов	0...5	6...7	8...9	10
Шкала оценивания	неудовлетворительно	удовлетворительно	хорошо	отлично

Примерные вопросы для выполнения контрольных работ

1. Рынок опционов.
2. Определить доходность акции, приобретенной в начале года за 100 руб., в конце года ее цена составила 220 руб., а в конце второго года акция котировалась 180 руб.

Каждый вариант контрольной работы состоит из двух частей по темам, предусмотренным рабочей программой дисциплины. В первой части предлагается ответить на один теоретический вопрос; во второй – решить задачу.

Критерии оценивания:

Каждому вопросу и заданию присваивается 50 баллов. Максимальное количество баллов 100. Работа считается зачтенной, если общее количество баллов не меньше порогового минимума, равного 70 %. Если оценка меньше порогового минимума, то работа возвращается на доработку.

Шкала оценивания:

0 _____ 70% _____ 100%
 Не зачтено _____ Зачтено

5.2.2 Оценочные средства при промежуточной аттестации.

Промежуточная аттестация по дисциплине «Рынок ценных бумаг» проводится в соответствии с учебным планом в виде экзамена.

Студент допускается к экзамену по дисциплине в случае выполнения им учебного плана по дисциплине: выполнения коллоквиумов и рефератов. В случае наличия учебной задолженности студент отрабатывает пропущенные занятия в форме, предложенной преподавателем.

Экзамен принимает лектор. Экзамен проводится в письменной форме по билетам. Экзаменатору предоставляется право задавать студентам дополнительные вопросы сверх билета, а также, помимо теоретических вопросов, давать задачи и примеры, связанные с курсом. На экзамене дается 2 теоретических вопроса и задача. Время подготовки студента 1 академический час.

В процессе подготовки студента к ответу использование дополнительной методической литературы, мобильных устройств связи и других источников информации не допускается.

Основой для определения оценки служит уровень усвоения студентами материала, предусмотренного рабочей программой дисциплины.

Перечень вопросов для проведения промежуточной аттестации студентов:

1. Классификация рынка ценных бумаг.
2. Рынок ценных бумаг как рынок особого товара.
3. Участники рынка ценных бумаг.
4. Понятие ценной бумаги.
5. Экономические виды ценных бумаг.
6. Классификация ценных бумаг.
7. Акция.
8. Облигация.
9. Депозитарные риски.
10. Государственные ценные бумаги.
11. Вексель.
12. Переводной вексель.
13. Опцион.
14. Фьючерсный контракт.
15. Понятие первичного рынка.



1550962962

16. Эмиссия ценных бумаг.
17. Андеррайтинг.
18. Понятие и виды профессиональной деятельности.
19. Брокерская деятельность.
20. Деятельность по ведению реестра владельцев ценных бумаг.
21. Депозитарная деятельность.
22. Фондовая биржа как организатор торгов
23. Вторичный рынок ценных бумаг.
24. Расчетная палата.
25. Виды сделок на фондовой бирже.
26. Листинг.
27. Делистинг.
28. Котировка ценных бумаг и фондовые индексы.
29. Виды рисков по ценным бумагам.
30. Инвестиционный процесс и управление инвестиционным портфелем.
31. Понятие инвестиционного процесса.
32. Управление портфелем ценных бумаг.
33. Модель формирования инвестиционного портфеля.
34. Основные правила диверсификации портфеля ценных бумаг.
35. Государственное регулирование рынка ценных бумаг.
36. Саморегулирование на рынке ценных бумаг.

Критерием оценки уровня сформированности компетенций в рамках учебной дисциплины является экзамен:

Оценка «отлично» - от 90 до 100 баллов - выставляется студенту, если он глубоко и прочно усвоил программный материал, исчерпывающе, последовательно, четко и логически стройно его излагает, умеет тесно увязывать теорию с практикой, свободно справляется с задачами, вопросами и другими видами применения знаний, причем не затрудняется с ответом при видоизменении заданий, правильно обосновывает принятое решение, владеет разносторонними навыками и приемами выполнения практических задач.

Оценка «хорошо» - от 80 до 89 баллов - выставляется студенту, если он твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос, правильно применяет теоретические положения при решении практических вопросов и задач, владеет необходимыми навыками и приемами их выполнения

Оценка «удовлетворительно» - от 65 до 79 баллов - выставляется студенту, если он имеет знания только основного материала, но не усвоил его деталей, допускает неточности, недостаточно правильные формулировки, нарушения логической последовательности в изложении программного материала, испытывает затруднения при выполнении практических работ.

Оценка «неудовлетворительно» - от 0 до 64 баллов - выставляется студенту, который не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки, неуверенно, с большими затруднениями выполняет практические работы. Как правило, оценка «неудовлетворительно» ставится студентам, которые не могут продолжить обучение без дополнительных занятий по соответствующей дисциплине.

Шкала оценивания:

Количество баллов	0...64	65...79	80...89	90-100
Шкала оценивания	неудовл.	удовл.	хорошо	отлично

Итоговая оценка (экзамен) выставляется с учетом:

- оценки за работу в семестре - 60 %;
- оценки итоговых знаний в ходе экзамена - 40 %.

5.2.3 Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующие этапы формирования компетенций

Изучение дисциплины «Рынок ценных бумаг» предусматривает чтение лекций, проведение практических занятий, самостоятельное изучение специальной литературы и нормативно-правовых актов по вопросам программы, подготовку к практическим занятиям, а также выполнение домашних заданий и контрольных работ.

Для проведения текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины « Рынок ценных бумаг» созданы фонды оценочных средств, включающие



1550962962

контрольные вопросы для проведения коллоквиумов, для выполнения контрольных работ, домашних заданий.

6 Учебно-методическое обеспечение

6.1 Основная литература

1. Алиев, А. Р. Рынок ценных бумаг в России / А. Р. Алиев. – Москва : Юнити-Дана, 2015. – 199 с. – ISBN 9785238019215. – URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=436686 (дата обращения: 10.01.2022). – Текст : электронный.

2. Базиков, А. А. Рынок ценных бумаг / А. А. Базиков, М. К. Чистякова. – Москва, Берлин : Директ-Медиа, 2016. – 251 с. – ISBN 9785447586331. – URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=446537 (дата обращения: 10.01.2022). – Текст : электронный.

6.2 Дополнительная литература

1. Самков, Т. Л. Рынок ценных бумаг : конспект лекций / Т. Л. Самков ; Т. Л. Самков ; Новосиб. гос. техн. ун-т. – Новосибирск : Изд-во НГТУ, 2012. – 86, [1] с. – URL: <http://library.kuzstu.ru/meto.php?n=175652&type=nstu:common> (дата обращения: 10.01.2022). – Текст : электронный.

2. Хазанович, Э. С. Рынок ценных бумаг (практикум в Excel) / Э. С. Хазанович. – Москва, Берлин : Директ-Медиа, 2016. – 111 с. – ISBN 9785447577391. – URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=452986 (дата обращения: 10.01.2022). – Текст : электронный.

6.3 Методическая литература

1. Рынок ценных бумаг : методические материалы для обучающихся специальности 38.05.01 "Экономическая безопасность" всех форм обучения / Министерство науки и высшего образования Российской Федерации, Кузбасский государственный технический университет им. Т. Ф. Горбачева, Кафедра финансов и кредита ; составитель А. Б. Киселев. – Кемерово : КузГТУ, 2019. – 20 с. – URL: <http://library.kuzstu.ru/meto.php?n=9756> (дата обращения: 10.01.2022). – Текст : электронный.

6.4 Профессиональные базы данных и информационные справочные системы

1. Электронная библиотечная система «Университетская библиотека онлайн» <http://biblioclub.ru/>
2. Электронная библиотечная система «Юрайт» <https://urait.ru/>
3. Справочная правовая система «КонсультантПлюс» <http://www.consultant.ru/>
4. Национальная электронная библиотека <https://rusneb.ru/>

6.5 Периодические издания

1. Финансовый директор : практический журнал по управлению финансами компании (печатный)
2. Финансы : теоретический и научно-практический журнал (печатный)

7 Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

При изучении дисциплины « Рынок ценных бумаг» могут быть использованы следующие информационно-справочные и поисковые системы:

- Справочная правовая система « Консультант Плюс»
- Справочная правовая система «Гарант»
- Яндекс, Гугл.

8 Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины "Рынок ценных бумаг"

Основной учебной работой студента является самостоятельная работа в течение всего срока



1550962962

обучения. Начинать изучение дисциплины необходимо с ознакомления с целями и задачами дисциплины и знаниями и умениями, приобретаемыми в процессе обучения. Далее следует проработать конспекты лекций, рассмотрев отдельные вопросы по предложенным источникам литературы. Все неясные вопросы по дисциплине студент может разрешить на консультациях, проводимых по расписанию. При подготовке к практическим занятиям студент изучает теоретический материал в соответствии с лекциями и методическими указаниями к практическим занятиям и в обязательном порядке выполняет домашние задания.

9 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине "Рынок ценных бумаг", включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем

Для изучения дисциплины может использоваться следующее программное обеспечение:

1. Mozilla Firefox
2. Google Chrome
3. Opera
4. Yandex
5. 7-zip
6. Microsoft Windows
7. ESET NOD32 Smart Security Business Edition

10 Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине "Рынок ценных бумаг"

Отдельные лекции и практические занятия проводятся с использованием вспомогательных средств: раздаточных материалов, слайдов, мультимедийных презентаций.

11 Иные сведения и (или) материалы

Учебная работа проводится с применением традиционных и современных интерактивных технологий. Лекции проводятся в традиционной форме. Практические занятия позволяют преподавателю индивидуально общаться со студентами и подходят для интерактивных методов обучения. В рамках практических занятий применяются следующие интерактивные методы:

- разбор конкретных ситуаций, решение ситуационных задач;
- презентации с использованием вспомогательных средств: раздаточных материалов, слайдов;
- дискуссии;
- работа в группах;
- устный опрос.



1550962962



1550962962

Список изменений литературы на 01.09.2017

Основная литература

1. Галанов, В. А. Рынок ценных бумаг : учебник для студентов вузов, обучающихся по специальностям 080105 "Финансы и кредит", 080109 "Бухгалт. учет, анализ и аудит", 080102 "Мировая экономика" / В. А. Галанов. – Москва : ИНФРА-М, 2009. – 379 с. – (Высшее образование). – Текст : непосредственный.
2. Алиев, А. Р. Рынок ценных бумаг в России / А. Р. Алиев. – Москва : Юнити-Дана, 2015. – 199 с. – ISBN 9785238019215. – URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=436686 (дата обращения: 01.09.2017). – Текст : электронный.
3. Рынок ценных бумаг. Комплексный учебник : учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальностям "Финансы и кредит", "Мировая экономика" и "Бухгалтерский учет, анализ и аудит" / Е. Ф. Жуков [и др.]. – Москва : Вузовский учебник, 2012. – 254 с. – (Вузовский учебник). – Текст : непосредственный.

Дополнительная литература

1. Алехин, Б. И. Рынок ценных бумаг : учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальности 060400 "Финансы и кредит" / Б. И. Алехин. – 2-е изд., перераб. и доп. – Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2004. – 461 с. – Текст : непосредственный.
2. Базовый курс по рынку ценных бумаг : учебное пособие для студентов, обучающихся по специальности "Финансы и кредит" / О. В. Ломтатидзе [и др.]. – Москва : КноРус, 2010. – 448 с. – Текст : непосредственный.
3. Гусева, И. А. Рынок ценных бумаг : сборник тестовых заданий : учеб. пособие для студентов, обучающихся по специальностям "Бухгалт. учет, анализ и аудит", "Финансы и кредит", "Мировая экономика", "Налоги и налогообложение" / И. А. Гусева. – Москва : КноРус, 2010. – 408 с. – Текст : непосредственный.
4. Галанов, В. А. Рынок ценных бумаг : учебник для студентов вузов, обучающихся по специальностям 080105 "Финансы и кредит", 080109 "Бухучет, анализ и аудит", 080102 "Мировая экономика" / В. А. Галанов ; Рос. экон. акад. им. Г. В. Плеханов. – Москва : ИНФРА-М, 2008. – 379 с. – Текст : непосредственный.
5. Ендовицкий, Д. А. Учет ценных бумаг : учеб. пособие для студентов вузов, обучающихся по специальности "Бухгалт. учет, анализ и аудит" / Д. А. Ендовицкий, Н. А. Ишкова; под ред. Д. А. Ендовицкого. – 2-е изд., стер. – Москва : КноРус, 2007. – 336 с. – Текст : непосредственный.
6. Рынок ценных бумаг : учебник для студентов экон. специальностей и направлений вузов / под ред. В. А. Галанова, А. И. Басова; Рос. экон. акад. им. Г. В. Плеханова. – Изд. 2-е, перераб. и доп. – Москва : Финансы и статистика, 2007. – 448 с. – Текст : непосредственный.
7. Базиков, А. А. Рынок ценных бумаг / А. А. Базиков, М. К. Чистякова. – Москва, Берлин : Директ-Медиа, 2016. – 251 с. – ISBN 9785447586331. – URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=446537 (дата обращения: 01.09.2017). – Текст : электронный.
8. Маренков, Н. Л. Рынок ценных бумаг в России / Н. Л. Маренков, Н. Н. Косаренко. – Москва : ФЛИНТА, 2021. – 122 с. – ISBN 9785893495386. – URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=83213 (дата обращения: 01.09.2017). – Текст : электронный.



1550962962