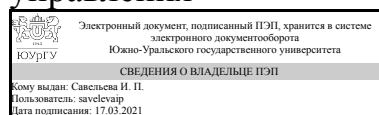


# ЮЖНО-УРАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

УТВЕРЖДАЮ:  
Директор института  
Высшая школа экономики и  
управления



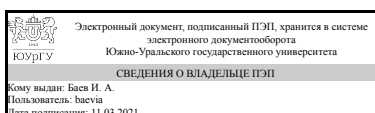
И. П. Савельева

## РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины Б.1.24 Рынок ценных бумаг  
для специальности 38.05.01 Экономическая безопасность  
уровень специалист тип программы Специалитет  
специализация Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности  
форма обучения заочная  
кафедра-разработчик Финансовые технологии

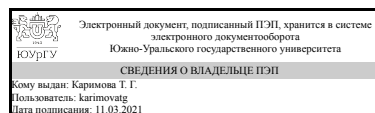
Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.05.01 Экономическая безопасность, утверждённым приказом Минобрнауки от 16.01.2017 № 20

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



И. А. Баев

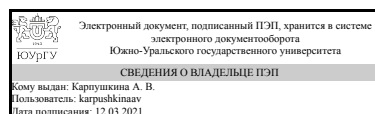
Разработчик программы,  
к.экон.н., доц., доцент



Т. Г. Каримова

СОГЛАСОВАНО

Зав.выпускающей кафедрой  
Экономическая безопасность  
д.экон.н., доц.



А. В. Карпушкина

## 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)
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.
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.

### 3. Место дисциплины в структуре ОП ВО

Перечень предшествующих дисциплин, видов работ учебного плана	Перечень последующих дисциплин, видов работ
Б.1.11.02 Макроэкономика	Б.1.43 Риски управления портфелем финансовых активов, Б.1.42 Стратегические аспекты экономической безопасности, ДВ.1.07.01 Экономико-правовые основы оценки стоимости предприятия

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

Дисциплина	Требования
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.

#### 4. Объём и виды учебной работы

Общая трудоёмкость 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	
Изучение и конспектирование учебной и научной литературы.	36	36	
Подготовка к зачету	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

№ занятия	№ раздела	Наименование или краткое содержание практического занятия, семинара	Кол-во 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)
Реферат	Самостоятельный поиск
Подготовка к зачету	1. Каримова, Т. Г., Рынок ценных бумаг и биржевое дело [Электронный ресурс] : учеб. для бакалавров направления 38.03.01 "Экономика" и др. / Т. Г. Каримова ; Юж.-Урал. гос. ун-т. - Челябинск : Юж.-Урал. гос. ун-т, 2018. - 100 с. - Режим доступа: <a href="https://lib.susu.ru/ftd?base=SUSU_METHOD&amp;key=000562412?base=SUSU_METHOD&amp;key=000562412">https://lib.susu.ru/ftd?base=SUSU_METHOD&amp;key=000562412?base=SUSU_METHOD&amp;key=000562412</a> 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 3. Рынок ценных бумаг Текст учебник для студентов бакалавриата по экон. направлениям и специальностям Н. И. Берзон и др.; под общ. ред. Н. И. Берзона. - М.: Юрайт, 2016. - 442, [1] с. ил.
Изучение и конспектирование учебной и научной литературы.	Рынок ценных бумаг Текст учебник для вузов по экон. направлениям и специальностям 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. направлениям и специальностям У. Ф. Шарп, Г. Д. Александер, Д. В. Бейли ; пер. с англ. А. Н. Буренина. - М.: ИНФРА-М, 2014. - XII, 1027 с. ил. Рынок ценных бумаг Учеб. В. А. Галанова, А. И. Басова, З. К. Голда и др.; Под ред. В. А. Галанова, А. И. Басова; Рос. экон. акад. им. Г. В. Плеханова. - 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.

#### 6. Инновационные образовательные технологии, используемые в учебном процессе

Инновационные формы учебных занятий	Вид работы (Л, ПЗ, ЛР)	Краткое описание	Кол-во ауд. часов
Метод кейс-обучения	Практические занятия и семинары	Рассмотрение практических ситуаций	2
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	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
Теоретические основы функционирования рынка ценных бумаг	ОПК-2 способностью использовать закономерности и методы экономической науки при решении профессиональных задач	Тесты	все
Практические основы функционирования рынка ценных бумаг	ОПК-2 способностью использовать закономерности и методы экономической науки при решении профессиональных задач	Тесты	все
Все разделы	ПК-31 способностью на основе статистических данных исследовать социально-экономические процессы в целях прогнозирования возможных угроз экономической безопасности	Реферат	Темы рефератов
Все разделы	ОПК-2 способностью использовать закономерности и методы экономической науки при решении профессиональных задач	Контрольная работа	согласно заданию

### 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. 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) . После прохождения итогового тестирования, его результаты суммируются с результатами, полученными в течение	Зачтено: рейтинг обучающегося за мероприятие больше или равно 60 %. Не зачтено: рейтинг обучающегося за мероприятие меньше 60 %.

	учебного семестра. Зачет считается завершенным, если по совокупности баллов студент набрал не менее 60 % общего рейтинга обучающегося, в ином случае студент направляется на пересдачу	
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). Тема раскрыта достаточно полно, использовано не менее 15 источников литературы, оформление соответствует стандарту ( 5 баллов). Тема раскрыта недостаточно, малое количество использованных источников литературы, оформление не соответствует стандарту. (0 баллов) Максимальное количество баллов - 5. Весовой коэффициент 1.	Зачтено: рейтинг обучающегося за мероприятие больше или равно 60 %. Не зачтено: рейтинг обучающегося за мероприятие 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 за мероприятие больше или равно 60 %. Не зачтено: рейтинг обучающегося за мероприятие меньше 60 %.
Контрольная работа	Каждому студенту выдается вариант контрольной работы, включающий 10 задач. 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. Весовой коэффициент 1.	Зачтено: рейтинг обучающегося за мероприятие больше или равно 60 %. Не зачтено: рейтинг обучающегося за мероприятие меньше 60 %.

### 7.3. Типовые контрольные задания

Вид контроля	Типовые контрольные задания
Зачет	РЦБ_тесты.doc
Реферат	Темы рефератов.docx
Тесты	Тест АО.docx
Контрольная работа	

## 8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

### Печатная учебно-методическая документация

#### а) основная литература:

1. РЦБ аналит. журн. АОЗТ "Журн. "Рынок ценных бумаг" журнал. - М., 2008-2015
2. Рынок ценных бумаг Учеб. для экон. специальностей вузов В. А. Галанов, А. И. Басов, З. К. Голда; Под ред. В. А. Галанова, А. И. Басова; Рос.

экон. акад. им. Г. В. Плеханова; Рос. экон. акад. им. Г. В. Плеханова. - 2-е изд., перераб. и доп. - М.: Финансы и статистика, 2001. - 446,[1] с.

*б) дополнительная 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, Н. М. Коршуновой, Е. Ф. Жуковой. - М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2002. - 499,[2] с.
2. Рынок ценных бумаг [Текст] учеб. для вузов по специальности 060400 "Финансы и кредит" и экон. специальностям Е. Ф. Жуков и др.; под ред. Е. Ф. Жукова. - 2-е изд., перераб. и доп. - М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2008. - 463 с. ил.
3. 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.

*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:*

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

## **Электронная учебно-методическая документация**

№	Вид литературы	Наименование разработки
1	Дополнительная литература	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 (режим доступа <a href="http://www.lib.susu.ac.ru/ftd?base=SUSU_METHOD1&amp;key=000554002">http://www.lib.susu.ac.ru/ftd?base=SUSU_METHOD1&amp;key=000554002</a> )
2	Основная литература	Лялин, В.А. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс] : учеб. / В.А. Лялин, П.В. Волков. - Электрон. дан. — Москва : Проспект, 2015. — 400 с. — Режим доступа: <a href="https://e.lanbook.com/book/54874">https://e.lanbook.com/book/54874</a> . — Загл. с экрана.
3	Методические	Каримова, Т. Г., Рынок ценных бумаг и биржевое дело [Электронный ресурс] : учеб. п



пособия для самостоятельной работы студента	бакалавров направления 38.03.01 "Экономика" и др. / Т. Г. Каримова ; Юж.-Урал. гос. Финансы, денежное обращение и кредит ; ЮУрГУ, Челябинск , 2018 Режим доступа: <a href="https://lib.susu.ru/ftd?base=SUSU_METHOD&amp;key=000562412?base=SUSU_METHOD&amp;">https://lib.susu.ru/ftd?base=SUSU_METHOD&amp;key=000562412?base=SUSU_METHOD&amp;</a>
---	---

## 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:

1. ООО "ГарантУралСервис"-Гарант(бессрочно)

## 10. 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)	Мультимедийное оборудование с выходом в интернет и образовательную сеть университета
Практические занятия и семинары	312 (1)	Мультимедийное оборудование
Лекции	502 (1)	мультимедийное оборудование с выходом в интернет
Зачет, диф.зачет	501 (1)	Компьютерная техника