

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования
«Алтайский государственный технический университет им. И.И. Ползунова»

СОГЛАСОВАНО

Директор ИЭиУ
Сычева

И.Н.

Рабочая программа дисциплины

Код и наименование дисциплины: **Б1.В.ДВ.10.2 «Рынок ценных бумаг»**

Код и наименование направления подготовки (специальности): **38.03.02
Менеджмент**

Направленность (профиль, специализация): **Управление малым бизнесом**

Статус дисциплины: **дисциплины (модули) по выбору**

Форма обучения: **очная**

Статус	Должность	И.О. Фамилия
Разработал	доцент	С.А. Тузовская
Согласовал	Зав. кафедрой «М»	И.Н. Сычева
	руководитель направленности (профиля) программы	И.Н. Сычева

г. Барнаул

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Код компетенции из УП и этап её формирования	Содержание компетенции	В результате изучения дисциплины обучающиеся должны:		
		знать	уметь	владеть
ОК-3	способностью использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности	закономерности функционирования современной экономики и формы их реализации на различных уровнях хозяйствования и в различных сферах деятельности; основы автоматизации экономических расчётов	выявлять проблемы экономического характера при анализе конкретных ситуаций и предлагать способы их решения и оценивать ожидаемые результаты; анализировать финансовую и экономическую информацию, необходимую для принятия обоснованных решений профессиональных задач и нахождения эффективных организационно-управленческие решений, в том числе с применением информационных технологий	технологией эффективного использования информации экономического содержания при осуществлении профессиональной деятельности; способностью грамотно применять основы экономических знаний на практике при оценке эффективности результатов деятельности в различных сферах; цифровыми технологиями в сфере экономики
ПК-4	умением применять основные методы финансового менеджмента для оценки активов, управления оборотным капиталом, принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала, в том числе, при принятии решений, связанных с операциями на мировых рынках в условиях глобализации	1. <input type="checkbox"/> Методы оценки активов рынка ценных бумаг для принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, оценки основных инструментов рынка ценных бумаг; 2. <input type="checkbox"/> Методы инвестиционного анализа, 3. <input type="checkbox"/> Методы оценки финансовых рисков, связанных с ценными бумагами; 4. <input type="checkbox"/> Систему регулирования	1. <input type="checkbox"/> Применять методы оценки активов рынка ценных бумаг для принятия инвестиционных решений, для оценки основных инструментов рынка ценных бумаг; 2. <input type="checkbox"/> Применять методы инвестиционного анализа и методы оценки финансовых рисков, связанных с ценными бумагами	1. <input type="checkbox"/> Основными методами оценки активов рынка ценных бумаг для принятия инвестиционных решений, для оценки основных инструментов рынка ценных бумаг; 2. <input type="checkbox"/> Методами инвестиционного анализа, 3. <input type="checkbox"/> Методами оценки финансовых рисков, связанных с ценными бумагами; 4. <input type="checkbox"/> Операциями с ценами бумагами.

2. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплины (практики), предшествующие изучению дисциплины, результаты освоения которых необходимы для освоения данной дисциплины.	Анализ хозяйственной деятельности предприятия, Бухгалтерский учет, Инновационный менеджмент, Оценка конкурентоспособности бизнеса, Финансовый менеджмент
Дисциплины (практики), для которых результаты освоения данной дисциплины будут необходимы, как входные знания, умения и владения для их изучения.	Выпускная квалификационная работа, Преддипломная практика

3. Объем дисциплины в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающегося с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающегося

Общий объем дисциплины в з.е. /час: 2 / 72

Форма промежуточной аттестации: Зачет

Форма обучения	Виды занятий, их трудоемкость (час.)				Объем контактной работы обучающегося с преподавателем (час)
	Лекции	Лабораторные работы	Практические занятия	Самостоятельная работа	
очная	18	0	18	36	41

4. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий

Форма обучения: очная

Семестр: 8

Лекционные занятия (18ч.)

1. Закономерности функционирования современной экономики. Характеристика рынка ценных бумаг. Основные виды ценных бумаг (в рамках ОК-3) {лекция с разбором конкретных ситуаций} (3ч.) [2] Понятие рынка ценных бумаг, его сущность и функции в макро- и микроэкономике. Соотношение рынка ценных бумаг, кредитного рынка и бюджета в перераспределении денежных ресурсов. Первичный и вторичный рынки ценных бумаг. Закономерности функционирования современной экономики.

2. Профессиональные участники рынка ценных бумаг. Эмитенты и инвесторы на рынке ценных бумаг. Методы инвестиционного анализа (рамках ПК-4). {лекция с разбором конкретных ситуаций} (3ч.)[2,3] Структура рынка ценных бумаг: виды участников и их взаимодействие. Понятие и виды профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг. Требования, предъявляемые к участникам рынка ценных бумаг, их организационно-правовые формы, учредители.

3. Виды сделок и операций с ценными бумагами. Эмиссия ценных бумаг. (в рамках ПК-4). {лекция с разбором конкретных ситуаций} (3ч.)[3] Классификация сделок и операций с ценными бумагами: перечень видов, экономическое содержание, укрупненные схемы реализации. Кассовые, срочные, фьючерсные и опционные сделки. Сделки РЕПО. Основные требования к сделкам по ценным бумагам и правила по их совершению: сравнительная характеристика российской и международной практики.

Понятие эмиссии ценных бумаг. Классификация эмиссий. Основные этапы эмиссии ценных бумаг с регистрацией и без регистрации проспекта ценных бумаг. Первичный рынок ценных бумаг. Основы анализа эмитента при первичном размещении ценных бумаг. Оценка ценных бумаг на первичном рынке. Основы конструирования выпуска ценных бумаг. Особенности эмиссии ценных бумаг банков, инвестиционных фондов и паевых инвестиционных фондов. Понятие андеррайтинга ценных бумаг и функции андеррайтера. Основы работы андеррайтера.

4. Методы оценки активов рынка ценных бумаг для принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, оценки основных инструментов рынка ценных бумаг. (в рамках ПК-4) {лекция с разбором конкретных ситуаций} (3ч.)[3] Методы оценки активов рынка ценных бумаг для принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, оценки основных инструментов рынка ценных бумаг. Оценка ценных бумаг на первичном рынке. Основы конструирования выпуска ценных бумаг.

5. Методы оценки финансовых рисков, связанных с ценными бумагами (в рамках ПК-4) {метод кейсов} (3ч.)[3,4] Методы оценки финансовых рисков, связанных с ценными бумагами;

6. Депозитарно-клиринговая инфраструктура и сеть регистраторов ценных бумаг (в рамках ОК-3 и ПК-4). {лекция с разбором конкретных ситуаций} (3ч.)[1,3] Депозитарно-клиринговая инфраструктура: понятие, функции, варианты организационного устройства в российской и международной практике, количественные параметры сети. Регулирование депозитарно-клиринговой деятельности. Депозитарий. Виды депозитариев.

Практические занятия (18ч.)

1. Понятия рынка ценных бумаг. Виды ценных бумаг (в рамках ОК-3) {беседа} (3ч.)[4,5] Понятие ценной бумаги, ее свойства и связанные с ней риски. Классификация ценных бумаг

Понятие и функции рынка ценных бумаг. Виды рынков ценных бумаг. Акции и их виды. Общая характеристика облигаций. Долговые обязательства государства. Муниципальные

ценные бумаги. Депозитные и сберегательные сертификаты банков. Векселя и чеки. Складские свидетельства. Коносаменты.

2. Профессиональные участники рынка ценных бумаг. Эмитенты и инвесторы на рынке ценных бумаг.

(в рамках ОК-3 и ПК-4) {образовательная игра} (3ч.)[3,4] Виды профессиональных участников рынка ценных

бумаг и основные требования, предъявляемые к ним

Виды профессиональной деятельности и операций на рынке

ценных бумаг. Основы деятельности компаний по ценным бумагам. Эмитенты и их классификация. Инвесторы и их классификация. Население как инвестор.

Институциональные инвесторы. Инвестиционные фонды.

Паевые инвестиционные фонды

3. Система регулирования рынка ценных бумаг(в рамках ОК-3). {дискуссия} (3ч.)[2,5,7]

Государственное регулирование рынка ценных бумаг. Саморегулирующиеся организации. Источники финансовой информации о фондовом рынке.

4. Основы автоматизации экономических расчётов. Виды сделок и операций с ценными бумагами. Эмиссия ценных бумаг (в рамках ОК-3 и ПК-4).

{работа в малых группах} (3ч.)[3,4] Сделки и операции с ценными бумагами. Основы автоматизации экономических расчётов

5. Фондовая биржа. Основы организации внебиржевого оборота по ценным бумагам(в рамках ОК-3 и ПК-4) {имитация} (3ч.)[2,4]

Функции и организационные основы деятельности фондовой биржи

Требования, предъявляемые к членам

фондовой биржи. Листинг. Виды торговых аукционов, используемых на фондовых биржах, взаимоотношения участников в ходе биржевых торгов.

Внебиржевые рынки: понятие, классификация и

организационные основы. Основы деятельности внебиржевых торговых

систем. Требования по допуску на внебиржевые организованные

рынки

6. Депозитарно-клиринговая инфраструктура и сеть регистраторов ценных бумаг (в рамках ОК-3 и ПК-4) {дискуссия} (3ч.)[2,3]

Понятие и функции депозитарно – клиринговой и регистраторской инфраструктуры на рынке ценных бумаг. Основы деятельности депозитариев. Клиринговые организации

Самостоятельная работа (36ч.)

1. Регулирование рынка ценных бумаг {использование общественных ресурсов} (6ч.)[1] Структура биржевой информации о рынке ценных бумаг

Рейтинговые системы и рейтинговые агентства на рынке. Органы регулирования рынка ценных бумаг в регионах и их взаимодействие с федеральным уровнем.

Саморегулируемые организации: статус, интересы, сфера ответственности, основные функции, права, политика.

Структура законодательства по ценным бумагам и его связи с другими видами законодательства, регулирующими финансовые рынки. Законы, указы президента и иные нормативные акты федерального уровня. Подзаконные нормативные акты государственных органов, регулирующих рынок ценных бумаг.

2. Персонал профессиональных участников рынка ценных бумаг {использование общественных ресурсов} (6ч.)[3] Лицензирование, ограничения на деятельность, развитие сети в российской и международной практике по отдельным видам профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг: брокерская деятельность; дилерская деятельность; деятельность по управлению ценными бумагами; деятельность по определению взаимных обязательств (клиринг); депозитарная деятельность; деятельность по ведению реестра владельцев ценных бумаг; деятельность по организации торговли на рынке ценных бумаг

3. Государственные ценные бумаги РФ. {использование общественных ресурсов} (6ч.)[1,3,4] Государственные ценные бумаги РФ и субъектов РФ. Муниципальные ценные бумаги. Внешние облигационные займы государства

4. Основы деятельности фондовой биржи {использование общественных ресурсов} (7ч.)[3] Классификация фондовых бирж. Структура собственности и особенности организационно-правового статуса фондовых бирж в России и за рубежом. Организационные схемы фондовой биржи. Виды членства и требования, предъявляемые к членам биржи. Порядок создания фондовых бирж, их лицензирования, реорганизации и ликвидации. Листинг. Требования к ценным бумагам, обращающимся на фондовой бирже. Надзорные функции фондовой биржи по отношению к ее членам и к персоналу компаний, являющихся членскими организациями. Виды аукционных механизмов, используемых на фондовых биржах различных типов.

5. Фондовые индексы. {использование общественных ресурсов} (7ч.)[3] Фондовые индексы. Система показателей рынка ценных бумаг в российской и международной практике.

6. подготовка к зачёту(4ч.)[1,3,4,7]

5. Перечень учебно-методического обеспечения самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

Для каждого обучающегося обеспечен индивидуальный неограниченный доступ к электронно-библиотечным системам: Лань, Университетская библиотека он-лайн, электронной библиотеке АлтГТУ и к электронной информационно-образовательной среде:

1. Саввина О. В. Регулирование финансовых рынков: Учебное пособие / О. В. Саввина. – 2-е изд. – Издательско-торговая корпорация «Дашков и Ко», 2012. – 204 с. Электронно - библиотечная система «Лань». Режим доступа:

http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_cid=25&pl1_id=5668

6. Перечень учебной литературы

6.1. Основная литература

2. Саввина О. В. Регулирование финансовых рынков: Учебное пособие / О. В. Саввина. – 2-е изд. – Издательско-торговая корпорация «Дашков и Ко», 2012. – 204 с. Электронно - библиотечная система «Лань». Режим доступа: http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_cid=25&pl1_id=5668

6.2. Дополнительная литература

3. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс] : [учебник для вузов по экономическим специальностям, по специальности "Финансы и кредит"] / Е. Ф. Жуков и др.] ; под ред. Е. Ф. Жукова. - 3-е изд., перераб. и доп. - Электрон. текстовые дан. - Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2015. - 568 с. - Режим доступа: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=117764>

7. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины

.
. .
. .
. .
. .

4. База данных «Оценочная деятельность» Минэкономразвития РФ - Режим доступа: <http://economy.gov.ru/minec/activity/sections/CorpManagment/activity/>

5. База данных «Финансовые рынки» ЦБ РФ - Режим доступа: <https://www.cbr.ru/finmarket/>

6. Информационно-справочная система «Консультант плюс» [электронный ресурс]. – Режим доступа: www.consultant.ru

7. Информационно-справочная система «ГАРАНТ» [электронный ресурс]. – Режим доступа: www.garant.ru

8. Фонд оценочных материалов для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации

Содержание промежуточной аттестации раскрывается в комплекте контролирующих материалов, предназначенных для проверки соответствия уровня подготовки по дисциплине требованиям ФГОС, которые хранятся на кафедре-разработчике РПД в печатном виде и в ЭИОС.

Фонд оценочных материалов (ФОМ) по дисциплине представлен в приложении А.

9. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем

Для успешного освоения дисциплины используются ресурсы электронной информационно-образовательной среды, образовательные интернет-порталы, глобальная компьютерная сеть Интернет. В процессе изучения дисциплины происходит интерактивное взаимодействие обучающегося с преподавателем через личный кабинет студента.

№пп	Используемое программное обеспечение
1	Acrobat Reader
2	Microsoft Office
3	Skype
4	7-Zip
5	Гарант
6	LibreOffice
7	Windows
8	Антивирус Kaspersky

№пп	Используемые профессиональные базы данных и информационные справочные системы
1	Бесплатная электронная библиотека онлайн "Единое окно к образовательным ресурсам" для студентов и преподавателей; каталог ссылок на образовательные интернет-ресурсы (http://Window.edu.ru)
2	Национальная электронная библиотека (НЭБ) — свободный доступ читателей к фондам российских библиотек. Содержит коллекции оцифрованных документов (как открытого доступа, так и ограниченных авторским правом), а также каталог изданий, хранящихся в библиотеках России. (http://нэб.рф/)

10. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине

Наименование специальных помещений и помещений для самостоятельной работы
учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа
учебные аудитории для проведения занятий семинарского типа
учебные аудитории для проведения групповых и индивидуальных консультаций
учебные аудитории для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации
помещения для самостоятельной работы
лаборатории

Материально-техническое обеспечение и организация образовательного процесса по дисциплине для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья осуществляется в соответствии с «Положением об обучении инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья».