

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Петровская Анна Викторовна

Должность: Директор

Дата подписания: 09.09.2024 13:43:35

Уникальный программный ключ:

798bda6555fbdebe827768f6f1710bd17a9070c31fdc1b0aba5a1f10c8c9199

Приложение 3

к основной профессиональной образовательной программе

по направлению подготовки 38.03.01 Экономика

направленность (профиль) программы Финансовая безопасность

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова»
Краснодарский филиал РЭУ им. Г.В. Плеханова
Факультет экономики, менеджмента и торговли
Кафедра финансов и кредита

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.05 Рынок ценных бумаг

| | |
|------------------------------------|--------------------------------|
| Направление подготовки | 38.03.01 Экономика |
| Направленность (профиль) | Финансовая безопасность |
| Уровень высшего образования | Бакалавриат |

Год начала подготовки - 2023г.

Краснодар – 2022г.

Составитель: к.э.н., доцент И.В. Сурина

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры финансов и кредита
протокол № 9 от 10.02.2022г.

СОДЕРЖАНИЕ

| | |
|---|----|
| I. ОРГАНИЗАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКИЙ РАЗДЕЛ | 4 |
| ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ | 4 |
| МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ | 4 |
| ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ И ВИДЫ УЧЕБНОЙ РАБОТЫ | 4 |
| ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ | 5 |
| II. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ | 7 |
| III. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ | 15 |
| РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА | 15 |
| ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННО-СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ | 16 |
| ПЕРЕЧЕНЬ ЭЛЕКТРОННО-ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫХ РЕСУРСОВ | 16 |
| ПЕРЕЧЕНЬ ПРОФЕССИОНАЛЬНЫХ БАЗ ДАННЫХ | 16 |
| ПЕРЕЧЕНЬ РЕСУРСОВ ИНФОРМАЦИОННО-ТЕЛЕКОММУНИКАЦИОННОЙ СЕТИ «ИНТЕРНЕТ», НЕОБХОДИМЫХ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ | 16 |
| ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ | 17 |
| МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ | 17 |
| IV. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ | 17 |
| V. МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИЕ ПРОЦЕДУРЫ ОЦЕНИВАНИЯ ЗНАНИЙ И УМЕНИЙ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ | 18 |
| VI. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ | 18 |
| АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ | 32 |

1.ОРГАНИЗАЦИОННО - МЕТОДИЧЕСКИЙ РАЗДЕЛ

Цель и задачи освоения дисциплины

Целью изучения дисциплины «Рынок ценных бумаг» является формирование у обучающихся современных фундаментальных знаний, раскрывающих содержательные стороны влияния отношений, опосредованных рынком ценных бумаг, на воспроизводственные процессы, сущность, функции и место рынка ценных бумаг в структуре финансового механизма рыночной экономики, и практических навыков ведения фондовых операций, проведения исследований фондового рынка и его инструментов, финансового консультирования.

Задачи дисциплины «Рынок ценных бумаг»:

- раскрытие причин возникновения, сущности и роли фондовых рынков;
- выявление особенностей и принципов функционирования рынков акций, облигаций и производных ценных бумаг;
- овладение необходимыми аспектами теории и принципами функционирования рынка ценных бумаг, а также практическими навыками разрешения хозяйственных ситуаций для активного использования полученных знаний в практической работе.

Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Рынок ценных бумаг» относится к обязательной части учебного плана.

Объем дисциплины и виды учебной работы

Таблица 1

| Показатели объема дисциплины | Всего часов по формам обучения | |
|---|--------------------------------|--------------|
| | очная | очно-заочная |
| Объем дисциплины в зачетных единицах | 3 ЗЕТ | |
| Объем дисциплины в академических часах | 108 | |
| Промежуточная аттестация: форма | зачет | зачет |
| Контактная работа обучающихся с преподавателем (Контактные часы), всего: | 36 | 20 |
| 1.Аудиторная работа (Ауд.), акад. часов всего, в том числе: | 34 | 18 |
| • лекции | 18 | 8 |
| • практические занятия | 16 | 10 |
| • лабораторные занятия | - | - |
| в том числе практическая подготовка | - | - |
| 2.Индивидуальные консультации (ИК) | - | - |
| 3.Контактная работа по промежуточной аттестации (Катт) | 2 | 2 |
| 4.Консультация перед экзаменом (КЭ) | - | - |
| 5.Контактная работа по промежуточной аттестации в период экзаменационной сессии / сессии заочников (Каттэк) | - | - |
| Самостоятельная работа (СР), всего: | 72 | 88 |
| в том числе: | | |
| • самостоятельная работа в период экз. сессии | - | - |

| | | |
|---|----|----|
| (СРэк) (заполняется при наличии экзамена по дисциплине) | | |
| • самостоятельная работа в семестре (СРС) | 72 | 88 |
| в том числе, самостоятельная работа на курсовую работу | - | - |
| изучение ЭОР (при наличии) | - | - |
| изучение онлайн-курса или его части | - | - |
| выполнение группового проекта | - | - |
| и другие виды: | 72 | 88 |

Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине

Таблица 2

| Формируемые компетенции (код и наименование компетенции) | Индикаторы достижения компетенций (код и наименование индикатора) | Результаты обучения (знания, умения) |
|--|---|--|
| ПК-1 Мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно -сырьевых рынков | ПК-1.1. Проведение исследования финансового рынка и изучение предложений финансовых услуг, сбор информации по спросу на рынке финансовых услуг (в том числе действующих правил и условий, тарифной политики и действующих форм документации), применение социологических, маркетинговых исследований | ПК-1.1. 3-1. Знает методы и технологии сбора первичной финансовой информации, с применением современных средств связи, аппаратно-технических средств и компьютерных технологий, конъюнктуру и механизмы функционирования финансовых рынков, методы экономической диагностики рынка финансовых услуг, технологии проведения социологических и маркетинговых исследований. |
| | | ПК-1.1. У-1. Умеет мыслить структурно, получать, интерпретировать и документировать результаты исследований, производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг |
| ПК-2. Финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг | ПК-2.1 Предоставление потребителю финансовых услуг информации о состоянии и перспективах рынка, тенденциях в изменении курсов ценных бумаг, иностранной валюты, условий по банковским продуктам и услугам, разъяснение суть финансовых продуктов, юридических и экономических характеристик финансовых продуктов и услуг, составление | ПК-2.1. 3-1. Знает основы эффективных межличностных коммуникаций, необходимый спектр финансовых продуктов и услуг, экономические и юридические аспекты инвестиционной и страховой деятельности, нормативные и методические документы, регламентирующие вопросы подбора кредитных продуктов |
| | | ПК-2.2. У-1. Умеет прогнозировать и оценивать изменения финансовой ситуации при пользовании финансовыми (инвестиционными) услугами, предоставлять клиенту |

| Формируемые компетенции (код и наименование компетенции) | Индикаторы достижения компетенций (код и наименование индикатора) | Результаты обучения (знания, умения) |
|---|--|---|
| | <p>окончательного перечня предлагаемых клиенту финансовых продуктов</p> | <p>качественные профессиональные услуги, ориентированные на потребности и интересы клиента, учитывать текущую финансовую ситуацию и перспективу при оценке предложений, направленных на решение финансовых задач клиента, осуществлять подбор финансовых продуктов и услуг, осуществлять профессиональные консультации, рассчитывать стоимость финансовых решений, оценивая потенциальные риски</p> |
| | <p>ПК-2.3. Консультирование клиента и контрагентов по вопросам, относящимся к компетенции деятельности, по вопросам составления личного бюджета, страхования, формирования сбережений, управления кредитным и инвестиционным портфелем, разъяснение клиенту экономических и правовых последствий финансовых решений</p> | <p>ПК-2.3. 3-1. Знает этику делового общения, необходимый спектр финансовых продуктов и услуг, порядок составления и заключения договоров об информационном обеспечении инвестиционных программ и мероприятий ПК-2.3. У-1. Умеет предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, ориентированные на потребности и интересы клиента, учитывать текущую финансовую ситуацию и перспективу при оценке предложений, направленных на решение финансовых задач клиента ПК-2.3 У-2. Умеет выступать в качестве эксперта в процессе принятия клиентом важных финансовых (инвестиционных) решений</p> |
| | <p>ПК-2.4. Организация продажи и дополнительной продажи в рамках персонального финансового плана финансовых продуктов (банковские депозиты, паевые фонды, брокерское обслуживание, обезличенный металлический счет) в рамках персонального финансового плана, обеспечение взаимодействия структурных подразделений и участие в планировании мероприятий, направленных на повышение качества финансового сервиса организации</p> | <p>ПК-2.4. 3-1. Знает общие принципы и технологии продаж, этику делового общения, необходимый спектр финансовых продуктов и услуг, основы эффективных межличностных коммуникаций ПК-2.4. У-1. Умеет грамотно проводить переговоры, выстраивать механизм взаимодействия в коллективе, планировать работу структурного подразделения, предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, ориентированные на потребности и интересы клиента</p> |

II. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Этапы формирования и критерии оценивания сформированности компетенций для обучающихся очной формы обучения

Таблица 3

| № п/п | Наименование раздела, темы дисциплины | Трудоемкость, академические часы | | | | | | Индикаторы достижения компетенций | Результаты обучения (знания, умения) | Учебные задания для аудиторных занятий | Текущий контроль | Задания для творческого рейтинга (по теме(-ам)/ разделу или по всему курсу в целом) |
|---|--|----------------------------------|----------------------|----------------------|-------------------------|-------------------------------------|-------|--------------------------------------|---|--|------------------|---|
| | | Лекции | Практические занятия | Лабораторные занятия | Практическая подготовка | Самостоятельная работа/ КЭ, Каттэк, | Всего | | | | | |
| Семестр 5 | | | | | | | | | | | | |
| РАЗДЕЛ 1. ЭКОНОМИЧЕСКАЯ СУЩНОСТЬ И ВИДЫ ЦЕННЫХ БУМАГ | | | | | | | | | | | | |
| 1. | Тема 1. Экономическая сущность, классификация и значение ценных бумаг Понятие ценной бумаги. Характеристика ценной бумаги как особого товара. Определение ценной бумаги. Функции и роль ценных бумаг в развитии рыночной экономики. Классификация ценных бумаг. Дополнительные качества ценных бумаг. Значение ценных бумаг: гибкий инструмент инвестирования свободных денежных средств; эффективный способ мобилизации ресурсов для развития производства; активное участие ценных бумаг в обслуживании товарного и денежного обращения. | 2 | 2 | - | - | 12 | 16 | ПК-1.1 ПК-2.1 ПК-2.3 ПК-2.4 | ПК-1.1. 3-1 ПК-1.1. У-1 ПК-2.1. 3-1 ПК-2.1. У-1 ПК-2.3. 3-1 ПК-2.3 У-1 ПК-2.3 У-2 ПК-2.4 3-1 ПК-2.4 У-1 | О | Т | Д |
| 2. | Тема 2. Корпоративные ценные бумаги Законодательные основы функционирования рынка корпоративных ценных бумаг в России. Виды корпоративных ценных бумаг по Гражданскому Кодексу Российской Федерации. Категории акций. Особенности | 4 | 4 | - | - | 12 | 20 | ПК-1.1 ПК-2.1 ПК-2.3 ПК-2.4 | ПК-1.1. 3-1 ПК-1.1. У-1 ПК-2.1. 3-1 ПК-2.1. У-1 ПК-2.3. 3-1 ПК-2.3 У-1 | О | Р.а.з | Ан.о. |

| | | | | | | | | | | | | |
|----|---|---|---|---|---|----|----|--|--|---|-------|-------|
| | <p>привилегированных акций. Типы привилегированных акций: кумулятивные, конвертируемые. Права по обыкновенным акциям. Акции именные и на предъявителя. Порядок выплаты доходов по акциям. Цели выпуска облигаций акционерными обществами. Облигации именные и на предъявителя. Виды облигаций, их обеспечение и порядок погашения. Выплаты доходов по облигациям. Коммерческие векселя, особенности их функционирования. Вексельные реквизиты. Простые и переводные векселя. Депозитные и сберегательные сертификаты банков. Производные ценные бумаги их характеристика (конвертируемые акции и облигации, варранты, опционы и фьючерсы). Международные ценные бумаги (евроноты, еврооблигации, евроакции).</p> | | | | | | | | <p>ПК-2.3 У-2 ПК-2.4 З-1 ПК-2.4 У-1</p> | | | |
| 3. | <p>Тема 3. Государственные ценные бумаги Государственный внутренний долг, его структура Управление государственным долгом и его погашение. Законодательная база рынка государственных ценных бумаг. Правительство Российской Федерации как эмитент долговых обязательств. Государственные краткосрочные обязательства (ГКО): условия выпуска, участники рынка ГКО, первичное размещение облигаций, вторичное размещение облигаций, погашение облигаций. Функции ЦБ РФ на рынке ГКО. Облигации Федерального займа (ОФЗ). Облигации государственного сберегательного займа (ОГСЗ). Казначейские обязательства (КО). Облигации внутреннего валютного займа (ОВВЗ). Золотые сертификаты. Другие государственные ценные бумаги.</p> | 2 | 2 | - | - | 12 | 16 | <p>ПК-1.1 ПК-2.1 ПК-2.3 ПК-2.4</p> | <p>ПК-1.1. З-1 ПК-1.1. У-1 ПК-2.1. З-1 ПК-2.1. У-1 ПК-2.3. З-1 ПК-2.3 У-1 ПК-2.3 У-2 ПК-2.4 З-1 ПК-2.4 У-1</p> | О | Р.а.з | Ан.о. |

| | | | | | | | | | | | | |
|---|--|----------|----------|---|---|-----------|-----------|--------------------------------------|---|---|---|---|
| | Ценные бумаги субъектов Федерации. Муниципальные ценные бумаги. Задачи и цели выпуска, обеспечение, порядок обращения и погашения. | | | | | | | | | | | |
| | Итого по разделу | 8 | 8 | | | 36 | 52 | | | | | |
| РАЗДЕЛ 2. УПРАВЛЕНИЕ РЫНКОМ ЦЕННЫХ БУМАГ | | | | | | | | | | | | |
| 4. | Тема 4. Выпуск и обращение ценных бумаг Понятие эмиссии ценных бумаг. Эмитенты и владельцы ценных бумаг. Формы выпуска эмиссионных ценных бумаг: документарная (именная и на предъявителя); бездокументарная. Нормативная база выпуска. Этапы процедуры эмиссии ценных бумаг: принятие эмитентом решения о выпуске ценных бумаг; регистрация выпуска ценных бумаг; изготовление сертификатов ценных бумаг (для документарной формы); размещение ценных бумаг; регистрация отчета об итогах выпуска ценных бумаг (его содержание). Методы размещения ценных бумаг. Осуществление размещения или открытой продажи. Законодательная база обращения ценных бумаг. Порядок перехода прав на документарные (именные и на предъявителя) и бездокументарные ценные бумаги. | 2 | 2 | - | - | 12 | 16 | ПК-1.1 ПК-2.1 ПК-2.3 ПК-2.4 | ПК-1.1. 3-1 ПК-1.1. У-1 ПК-2.1. 3-1 ПК-2.1. У-1 ПК-2.3. 3-1 ПК-2.3 У-1 ПК-2.3 У-2 ПК-2.4 3-1 ПК-2.4 У-1 | О | Т | Д |
| 5. | Тема 5. Определение и функциональные задачи рынка ценных бумаг Рынок ценных бумаг как часть финансового рынка страны, его связь с рынком наличных денежных средств и рынком ссудного капитала. Структура рынка ценных бумаг (западная модель). Финансовые потоки в экономике. Взаимосвязь риска и доходности. Система государственного регулирования рынка ценных бумаг: органы государственного надзора, законодательно-правовая база регулирования, национальные особенности регулирования рынка. Прямое и косвенное | 4 | 4 | - | - | 12 | 20 | ПК-1.1 ПК-2.1 ПК-2.3 ПК-2.4 | ПК-1.1. 3-1 ПК-1.1. У-1 ПК-2.1. 3-1 ПК-2.1. У-1 ПК-2.3. 3-1 ПК-2.3 У-1 ПК-2.3 У-2 ПК-2.4 3-1 ПК-2.4 У-1 | О | Т | Д |

| | | | | | | | | | | | | |
|----|--|-----------|-----------|---|---|-------------|------------|--------------------------------------|---|----------|----------|----------|
| | регулирование на рынке ценных бумаг. Основные объекты регулирования. Основные принципы регулирования. Распределение регулирующих функций между регулируемыми органами. Саморегулируемые организации профессиональных участников рынка ценных бумаг. Структура рынка ценных бумаг и его основные тенденции развития. Участники рынка. Основные операции на рынке. | | | | | | | | | | | |
| 6. | Тема 6. Биржевые индексы и их анализ Биржевая информация (биржевые индексы и их характеристика). Понятие «биржевой индекс». Индекс Доу-Джонса и индексы ценных бумаг в Российской Федерации. Факторы, влияющие на качественное конструирование индексов (размерность выборки, представительность, пересмотр выборки, время расчета индекса). Фундаментальный анализ в биржевой торговле. Его составные блоки: общеэкономический анализ; отраслевой анализ; анализ финансового положения эмитента; исследование качеств биржевого актива. | 4 | 2 | | | 12 | 18 | ПК-1.1 ПК-2.1 ПК-2.3 ПК-2.4 | ПК-1.1. 3-1 ПК-1.1. У-1 ПК-2.1. 3-1 ПК-2.1. У-1 ПК-2.3. 3-1 ПК-2.3 У-1 ПК-2.3 У-2 ПК-2.4 3-1 ПК-2.4 У-1 | О | Р.а.з. | Д |
| | Итого по разделу | 10 | 8 | - | - | 36 | 54 | | | | | |
| | <i>Контактная работа по промежуточной аттестации (Катт)</i> | - | - | - | - | -/2 | 2 | | | | | |
| | <i>Самостоятельная работа в период экз. сессии (СРэк)</i> | - | - | - | - | - | - | | | | | |
| | Итого по дисциплине | 18 | 16 | - | - | 72/2 | 108 | х | х | х | х | х |

**Этапы формирования и критерии оценивания сформированности компетенций
для обучающихся очно-заочной формы обучения**

Таблица 4

| № п/п | Наименование раздела, темы дисциплины | Трудоемкость, академические часы | | | | | | Индикаторы достижения компетенций | Результаты обучения (знания, умения) | Учебные задания для аудиторных занятий | Текущий контроль | Задания для творческого рейтинга (по теме(-ам)/ разделу или по всему курсу в целом) |
|---|--|----------------------------------|----------------------|----------------------|-------------------------|-------------------------------------|-------|--------------------------------------|---|--|------------------|---|
| | | Лекции | Практические занятия | Лабораторные занятия | Практическая подготовка | Самостоятельная работа/ КЭ, Катгэк, | Всего | | | | | |
| Семестр 6 | | | | | | | | | | | | |
| РАЗДЕЛ 1. ЭКОНОМИЧЕСКАЯ СУЩНОСТЬ И ВИДЫ ЦЕННЫХ БУМАГ | | | | | | | | | | | | |
| 1. | Тема 1. Экономическая сущность, классификация и значение ценных бумаг Понятие ценной бумаги. Характеристика ценной бумаги как особого товара. Определение ценной бумаги. Функции и роль ценных бумаг в развитии рыночной экономики. Классификация ценных бумаг. Дополнительные качества ценных бумаг. Значение ценных бумаг: гибкий инструмент инвестирования свободных денежных средств; эффективный способ мобилизации ресурсов для развития производства; активное участие ценных бумаг в обслуживании товарного и денежного обращения. | 2 | 2 | - | - | 14 | 18 | ПК-1.1 ПК-2.1 ПК-2.3 ПК-2.4 | ПК-1.1. 3-1 ПК-1.1. У-1 ПК-2.1. 3-1 ПК-2.1. У-1 ПК-2.3. 3-1 ПК-2.3 У-1 ПК-2.3 У-2 ПК-2.4 3-1 ПК-2.4 У-1 | О | Т | |
| 2. | Тема 2. Корпоративные ценные бумаги Законодательные основы функционирования рынка корпоративных ценных бумаг в России. Виды корпоративных ценных бумаг по Гражданскому Кодексу Российской Федерации. Категории акций. Особенности привилегированных акций. Типы привилегированных акций: кумулятивные, конвертируемые. Права по обыкновенным | 2 | 2 | - | - | 14 | 18 | ПК-1.1 ПК-2.1 ПК-2.3 ПК-2.4 | ПК-1.1. 3-1 ПК-1.1. У-1 ПК-2.1. 3-1 ПК-2.1. У-1 ПК-2.3. 3-1 ПК-2.3 У-1 ПК-2.3 У-2 ПК-2.4 3-1 ПК-2.4 У-1 | О | Р.а.з | |

| | | | | | | | | | | | | |
|----|---|----------|----------|---|---|-----------|-----------|--------------------------------------|---|---|--|--|
| | акциям. Акции именные и на предъявителя. Порядок выплаты доходов по акциям. Цели выпуска облигаций акционерными обществами. Облигации именные и на предъявителя. Виды облигаций, их обеспечение и порядок погашения. Выплаты доходов по облигациям. Коммерческие векселя, особенности их функционирования. Вексельные реквизиты. Простые и переводные векселя. Депозитные и сберегательные сертификаты банков. Производные ценные бумаги их характеристика (конвертируемые акции и облигации, варранты, опционы и фьючерсы). Международные ценные бумаги (евроноты, еврооблигации, евроакции). | | | | | | | | | | | |
| 3. | Тема 3. Государственные ценные бумаги Государственный внутренний долг, его структура Управление государственным долгом и его погашение. Законодательная база рынка государственных ценных бумаг. Правительство Российской Федерации как эмитент долговых обязательств. Государственные краткосрочные обязательства (ГКО): условия выпуска, участники рынка ГКО, первичное размещение облигаций, вторичное размещение облигаций, погашение облигаций. Функции ЦБ РФ на рынке ГКО. Облигации Федерального займа (ОФЗ). Облигации государственного сберегательного займа (ОГСЗ). Казначейские обязательства (КО). Облигации внутреннего валютного займа (ОВВЗ). Золотые сертификаты. Другие государственные ценные бумаги. Ценные бумаги субъектов Федерации. Муниципальные ценные бумаги. Задачи и цели выпуска, обеспечение, порядок обращения и погашения. | 2 | - | - | - | 16 | 18 | ПК-1.1 ПК-2.1 ПК-2.3 ПК-2.4 | ПК-1.1. 3-1 ПК-1.1. У-1 ПК-2.1. 3-1 ПК-2.1. У-1 ПК-2.3. 3-1 ПК-2.3 У-1 ПК-2.3 У-2 ПК-2.4 3-1 ПК-2.4 У-1 | О | | |
| | Итого по разделу | 6 | 4 | | | 44 | 54 | | | | | |

| РАЗДЕЛ 2. УПРАВЛЕНИЕ РЫНКОМ ЦЕННЫХ БУМАГ | | | | | | | | | | | | |
|--|--|---|---|---|---|----|----|--------------------------------------|---|---|---|--|
| 4. | <p>Тема 4. Выпуск и обращение ценных бумаг</p> <p>Понятие эмиссии ценных бумаг. Эмитенты и владельцы ценных бумаг. Формы выпуска эмиссионных ценных бумаг: документарная (именная и на предъявителя); бездокументарная. Нормативная база выпуска.</p> <p>Этапы процедуры эмиссии ценных бумаг: принятие эмитентом решения о выпуске ценных бумаг; регистрация выпуска ценных бумаг; изготовление сертификатов ценных бумаг (для документарной формы); размещение ценных бумаг; регистрация отчета об итогах выпуска ценных бумаг (его содержание).</p> <p>Методы размещения ценных бумаг.</p> <p>Осуществление размещения или открытой продажи.</p> <p>Законодательная база обращения ценных бумаг.</p> <p>Порядок перехода прав на документарные (именные и на предъявителя) и бездокументарные ценные бумаги.</p> | 2 | 2 | - | - | 14 | 18 | ПК-1.1 ПК-2.1 ПК-2.3 ПК-2.4 | ПК-1.1. 3-1 ПК-1.1. У-1 ПК-2.1. 3-1 ПК-2.1. У-1 ПК-2.3. 3-1 ПК-2.3 У-1 ПК-2.3 У-2 ПК-2.4 3-1 ПК-2.4 У-1 | О | Т | |
| 5. | <p>Тема 5. Определение и функциональные задачи рынка ценных бумаг</p> <p>Рынок ценных бумаг как часть финансового рынка страны, его связь с рынком наличных денежных средств и рынком ссудного капитала.</p> <p>Структура рынка ценных бумаг (западная модель). Финансовые потоки в экономике.</p> <p>Взаимосвязь риска и доходности.</p> <p>Система государственного регулирования рынка ценных бумаг: органы государственного надзора, законодательно-правовая база регулирования, национальные особенности регулирования рынка.</p> <p>Прямое и косвенное регулирование на рынке ценных бумаг. Основные объекты регулирования.</p> <p>Основные принципы регулирования.</p> <p>Распределение регулирующих функций между регулируемыми органами. Саморегулируемые организации профессиональных участников</p> | - | 2 | - | - | 14 | 16 | ПК-1.1 ПК-2.1 ПК-2.3 ПК-2.4 | ПК-1.1. 3-1 ПК-1.1. У-1 ПК-2.1. 3-1 ПК-2.1. У-1 ПК-2.3. 3-1 ПК-2.3 У-1 ПК-2.3 У-2 ПК-2.4 3-1 ПК-2.4 У-1 | О | Т | |

| | | | | | | | | | | | | |
|----|--|----------|-----------|---|---|-------------|------------|--------------------------------------|---|----------|----------|----------|
| | рынка ценных бумаг. Структура рынка ценных бумаг и его основные тенденции развития. Участники рынка. Основные операции на рынке. | | | | | | | | | | | |
| 6. | Тема 6. Биржевые индексы и их анализ Биржевая информация (биржевые индексы и их характеристика). Понятие «биржевой индекс». Индекс Доу-Джонса и индексы ценных бумаг в Российской Федерации. Факторы, влияющие на качественное конструирование индексов (размерность выборки, представительность, пересмотр выборки, время расчета индекса). Фундаментальный анализ в биржевой торговле. Его составные блоки: общеэкономический анализ; отраслевой анализ; анализ финансового положения эмитента; исследование качеств биржевого актива. | - | 2 | | | 16 | 18 | ПК-1.1 ПК-2.1 ПК-2.3 ПК-2.4 | ПК-1.1. 3-1 ПК-1.1. У-1 ПК-2.1. 3-1 ПК-2.1. У-1 ПК-2.3. 3-1 ПК-2.3 У-1 ПК-2.3 У-2 ПК-2.4 3-1 ПК-2.4 У-1 | О | Р.а.з. | |
| | Итого по разделу | 2 | 6 | - | - | 44 | 52 | | | | | |
| | <i>Контактная работа по промежуточной аттестации (Катт)</i> | - | - | - | - | -/2 | 2 | | | | | |
| | <i>Самостоятельная работа в период экз. сессии (СРЭК)</i> | - | - | - | - | - | - | | | | | |
| | Итого по дисциплине | 8 | 10 | - | - | 88/2 | 108 | х | х | х | х | х |

Формы учебных заданий на аудиторных занятиях: (выбрать строго из представленного ниже перечня оценочных средств):

Опрос (О)

Формы текущего контроля:

Тест (Т)

Расчетно-аналитические задания или иные задания и задачи (р.а.з.)

Формы заданий для творческого рейтинга:

Доклад (Д)

Аналитический обзор (Ан.о.)

III. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА

Основная литература

1. Галанов, В. А. Рынок ценных бумаг : учебник / В.А. Галанов. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : ИНФРА-М, 2023. — 414 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). — DOI 10.12737/23640. - ISBN 978-5-16-012443-8. - Текст : электронный. - Режим доступа: <https://znanium.ru/read?id=418725>
2. Рынок ценных бумаг : учебник / В. А. Татьянникова, Е. А. Разумовская, Т. В. Решетникова [и др.] ; под общ. ред. В. А. Татьянникова. - 2-е изд., стер. - Москва : ФЛИНТА : Изд-во Урал. ун-та, 2022. - 496 с. - ISBN 978-5-9765-5025-4 (ФЛИНТА) ; ISBN 978-5-7996-2758-4 (Изд-во Урал. ун-та). - Текст : электронный. - Режим доступа: <https://znanium.ru/read?id=413932>
3. Рынок ценных бумаг : учебник / В. А. Зверев А. В. Зверева, С. Г. Евсюков, А. В. Макеев. - 5-е изд., стер. - Москва : Дашков и К, 2023. - 256 с. - ISBN 978-5-394-05313-9. - Текст : электронный. - Режим доступа: <https://znanium.ru/read?id=431840>

Дополнительная литература:

1. Газалиев, М. М. Рынок ценных бумаг : учебное пособие / М. М. Газалиев, В. А. Осипов. - 4-е изд., стер. - Москва : Дашков и К, 2022. - 154 с. - ISBN 978-5-394-05076-3. - Текст : электронный. - Режим доступа: <https://znanium.ru/read?id=431841>
2. Николаева, И. П. Рынок ценных бумаг : учебник / И. П. Николаева. - 4-е изд., стер. - Москва : Дашков и К, 2022. - 254 с. - ISBN 978-5-394-04966-8. - Текст : электронный. - Режим доступа: <https://znanium.ru/read?id=431839>
3. Сребник, Б. В. Финансовые рынки: профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг : учебное пособие / Б.В. Сребник, Т.Б. Вилкова. — Москва : ИНФРА-М, 2022. — 366 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). - ISBN 978-5-16-005029-4. - Текст : электронный. - Режим доступа: <https://znanium.ru/read?id=399976>

Нормативные правовые документы:

1. Гражданский Кодекс Российской Федерации Часть 1: [принят Гос. Думой 21 октября 1994г.]. //Консультант Плюс: Справ.-прав. система. - Режим доступа: <http://www.consultant.ru/cons/cgi/online.cgi?req=doc&base=LAW&n=340325&fld=134&dst=1000000001,0&rnd=0.8945522941171025#03568889569820799>
2. Гражданский Кодекс Российской Федерации Часть 2: [принят Гос. Думой 22 декабря 1995г.]. // Консультант Плюс: Справ.-прав. система. - Режим доступа: <http://www.consultant.ru/cons/cgi/online.cgi?req=doc&base=LAW&n=320455&fld=134&dst=1000000001,0&rnd=0.8792114090431673#08020204172097045>
3. О банках и банковской деятельности: федеральный закон Российской Федерации от 02 декабря 1990 г. №395-1 [принят Гос. Думой 24 декабря 1990 г.]. // Консультант Плюс: Справ.-прав. система. - Режим доступа: <http://www.consultant.ru/cons/cgi/online.cgi?req=doc&base=LAW&n=342201&fld=134&dst=1000000001,0&rnd=0.4963559814015184#02133133210248721>
4. О рынке ценных бумаг: федеральный закон Российской Федерации Федеральный закон от 22.04.1996 N 39-ФЗ [принят Гос. Думой 20.03.1996 г.] //Консультант Плюс. Справ.-прав. система. - Режим доступа: <http://www.consultant.ru/cons/cgi/online.cgi?>

[req=doc&base=LAW&n=327806&fld=134&dst=1000000001,0&rnd=0.2850657100945855#05038916311573514](http://www.consultant.ru/req=doc&base=LAW&n=327806&fld=134&dst=1000000001,0&rnd=0.2850657100945855#05038916311573514)

5. О валютном регулировании и валютном контроле: федеральный закон Российской Федерации от 10.12.2003г. №173-ФЗ [принят Гос. Думой 21 ноября 2003г.] // Консультант Плюс: Справ.-прав. система. - Режим доступа: <http://www.consultant.ru/cons/cgi/online.cgi?req=doc&base=LAW&n=327779&fld=134&dst=1000000001,0&rnd=0.27018637254823585#09803519058863963>

ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННО-СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ

1. Информационно-правовой портал «КонсультантПлюс» <http://www.consultant.ru>
2. Кодексы и законы РФ - правовая справочно-консультационная система <http://kodeks.systems.ru>
3. ГОСТы (официальные тексты) в помощь оформлению курсовых, выпускных квалификационных работ, диссертационных исследований – коллекция ссылок на ресурсы сайта Федерального агентства по техническому регулированию и метрологии (Росстандарт), размещённая на сайте филиала <http://www.gost.ru>
4. Информационно-правовая система «Законодательство России» <http://pravo.gov.ru/ips/>
5. Справочно-правовая система «Гарант» <https://www.garant.ru/>

ПЕРЕЧЕНЬ ЭЛЕКТРОННО-ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫХ РЕСУРСОВ

- 1, ЭБС «ИНФРА–М» <http://znanium.com>
2. Научная электронная библиотека elibrary.ru <https://elibrary.ru/>
3. ЭБС BOOK.ru <http://www.book.ru>
4. ЭБС «Лань» <https://e.lanbook.com/>
5. Университетская библиотека online <http://biblioclub.ru/>
6. ЭБС «Grebennikon» <https://grebennikon.ru/>
7. Видеолекции НПП Краснодарского филиала <http://vrgteu.ru/course/view.php?id=6680>

ПЕРЕЧЕНЬ ПРОФЕССИОНАЛЬНЫХ БАЗ ДАННЫХ

1. Крупнейший российский информационный портал в области науки, технологии, медицины и образования elibrary.ru <http://elibrary.ru>
2. Обзорная информация по мировой экономике <http://www.ereport.ru/>
3. Базы данных компании «ИстВьюИнформейшн Сервисиз Инк» (электронные периодические издания «Издания по общественным и гуманитарным наукам» <https://dlib.eastview.com/browse/udb/890>
4. Статистическая база данных по российской экономике <http://www.gks.ru>

ПЕРЕЧЕНЬ РЕСУРСОВ ИНФОРМАЦИОННО - ТЕЛЕКОММУНИКАЦИОННОЙ СЕТИ «ИНТЕРНЕТ», НЕОБХОДИМЫХ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

1. Официальный сайт Банка России (статистические данные по финансовому рынку) <https://www.cbr.ru/>
2. Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики РФ (статистические данные) <http://www.gks.ru/>
3. Официальный сайт Министерства финансов РФ <https://www.minfin.ru/ru/?fullversion=1>
4. Официальный сайт Министерства экономического развития <http://economy.gov.ru/minrec/main>
5. КиберЛенинка - научная электронная библиотека (журналы) <http://cyberleninka.ru/>

6.Электронная библиотека диссертаций Российской государственной библиотеки
<http://diss.rsl.ru>

7.Сайт «Компьютерная поддержка учебно-методической деятельности филиала»
<http://vrgteu.ru>

ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ

1. ОС Windows XP PRO
2. Office Professional Plus 2007 Rus OLP NL (Microsoft Word, Microsoft Excel, Microsoft Access, Microsoft PowerPoint, Microsoft Publisher)
3. Антивирусная программа Касперского Kaspersky Endpoint Security для бизнеса-Расширенный Rus Edition
4. Программа оптического распознавания текста ABBYY FineReader 9.0 Corporate Edition .
5. 1С:Предприятие.8. Управление торговлей
6. 1С:Предприятие 8. Комплект для обучения в высших и средних учебных заведениях
7. Система тестирования INDIGO
8. Бухгалтерская справочная система «Система ГлавБух»
9. Учебные фильмы (ООО «Решение: учебное видео» Комплект фильмов согласно спецификации к договору
10. Программное обеспечение "Система управления учебным процессом Магеллан v.5" (доступ к личным кабинетам)
11. Система управления курсами (электронное обучение) Moodle v 3.1.1+
12. Программа подготовки сведений по форме № 3-НДФЛ и № 4-НДФЛ
13. Программное обеспечение по лицензии GNU GPL: PeaZip, Google, Chrome

МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина «Рынок ценных бумаг» обеспечена:

для проведения занятий лекционного типа:

-учебной аудиторией, оборудованной учебной мебелью, мультимедийными средствами обучения для демонстрации лекций-презентаций;

для проведения занятий семинарского типа (практические занятия):

-учебной аудиторией, оборудованной учебной мебелью и техническими средствами обучения, служащими для представления учебной информации;

для самостоятельной работы:

-помещением для самостоятельной работы, оснащенным компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде филиала.

IV. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины «Рынок ценных бумаг» представлены в нормативно-методических документах:

Положение об интерактивных формах обучения (<http://www.rea.ru>)

Положение об организации самостоятельной работы студентов (<http://www.rea.ru>)

Положение о рейтинговой системе оценки успеваемости и качества знаний студентов (<http://www.rea.ru>)

V. МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИЕ ПРОЦЕДУРЫ ОЦЕНИВАНИЯ ЗНАНИЙ И УМЕНИЙ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ

Результаты текущего контроля и промежуточной аттестации формируют рейтинговую оценку работы обучающегося. Распределение баллов при формировании рейтинговой оценки работы обучающегося осуществляется в соответствии с «Положением о рейтинговой системе оценки успеваемости и качества знаний студентов» в процессе освоения дисциплины «Банковское дело» в федеральном государственном бюджетном образовательном учреждении высшего образования «Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова».

Таблица 4

| Виды работ | Максимальное количество баллов |
|---|--------------------------------|
| Выполнение учебных заданий на аудиторных занятиях | 20 |
| Текущий контроль | 20 |
| Творческий рейтинг | 20 |
| Промежуточная аттестация (<i>зачет</i>) | 40 |
| ИТОГО | 100 |

В соответствии с Положением о рейтинговой системе оценки успеваемости и качества знаний обучающихся преподаватель кафедры, непосредственно ведущий занятия со студенческой группой, обязан проинформировать группу о распределении рейтинговых баллов по всем видам работ на первом занятии семестра, сроках и формах контроля их освоения, форме промежуточной аттестации, снижении баллов за несвоевременное выполнение выданных заданий. Обучающиеся в течение семестра получают информацию о текущем количестве набранных по дисциплине баллов через личный кабинет студента.

VI. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

Оценочные материалы по дисциплине «Рынок ценных бумаг» разработаны в соответствии с Положением об оценочных материалах в федеральном государственном бюджетном образовательном учреждении высшего образования «Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова».

Тематика курсовых работ/проектов

_____ Курсовая работа/проект по дисциплине «Рынок ценных бумаг» учебным планом не предусмотрена.

Перечень вопросов к зачету:

1. Экономическая сущность ценной бумаги.
2. Фундаментальные свойства ценных бумаг
3. Критерии классификации ценных бумаг
4. Значение ценных бумаг в рыночной экономике.
5. Современный рынок корпоративных ценных бумаг в России, проблемы его развития

6. Акция. Разновидности акций. Общая характеристика, свойства, функции, стоимостная оценка.
7. Облигации. Разновидности облигаций. Общая характеристика, условия, стоимостная оценка.
8. Депозитные и сберегательные сертификаты коммерческих банков.
9. Вексель. Общая характеристика, свойства, разновидности, особенности обращения
10. Производные ценные бумаги. Понятие, виды.
11. Понятие государственных ценных бумаг и необходимость их выпуска.
12. Основные виды государственных ценных бумаг в Российской Федерации.
13. Международные ценные бумаги, их виды.
14. Понятие и формы, процедура эмиссии ценных бумаг.
15. Понятие рынка ценных бумаг как составной части финансового рынка. Структура рынка ценных бумаг.
16. Формы и методы регулирования рынка ценных бумаг.
17. Саморегулирование рынка ценных бумаг.
18. Необходимость и критерии профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг.
19. Эмитенты и инвесторы как участники рынка ценных бумаг.
20. Понятие первичного рынка ценных бумаг, его цели и задачи.
21. Вторичный рынок ценных бумаг; цели, задачи, структура
22. Биржевые индексы, порядок их конструирования.
23. Фундаментальный и технический анализ в биржевой торговле.
24. Законодательная база обращения ценных бумаг.
25. Понятие, состав и принципы регулирования биржевой деятельности.
26. Учредители и члены биржи.
27. Правила биржевых торгов. Понятие и виды биржевых сделок.
28. Клиринг как этап биржевой сделки.
29. Технология разных видов клиринга.
30. Особенности фьючерсной торговли в России.
31. Сравнительная характеристика фьючерсной и опционной торговли для целей хеджирования.
32. Организационное устройство и характеристика деятельности Московской межбанковской валютной биржи (ММВБ).
33. Правила совершения сделок с ценными бумагами на ММВБ.
34. Понятие и необходимость хеджированию рыночных рисков.
35. Техника хеджированию покупкой фьючерсного контракта.
36. Техника хеджирования продажей фьючерсного контракта.
37. Хеджирование покупкой опционных контрактов.
38. Биржа как элемент организованных рынков.
39. Признаки биржевой торговли. Понятие биржевого товара.
40. Международные фондовые биржи и их роль в экономике.

Практическое задание (расчетно-аналитическое) к зачету:

| | |
|----|--|
| 1. | <i>Задача.</i> Инвестор купил, а через год продал акции, получив доходность операции 4% годовых. Рассчитайте доходность инвестиций, если цена продажи возрастет на 4%. |
| 2. | <i>Задача.</i> Привилегированные акции номиналом 10 руб. были приобретены в количестве 50 шт. по цене 5 руб. и проданы через 1,5 года по цене 8,10 руб. за 1 акцию. Дивиденд по |

| | |
|----|---|
| | акциям составил за первый год 10% годовых, за второй – 8% годовых. Найти доход и доходность операции. |
| 3. | <i>Задача.</i> Общая выручка предприятия за год составила 250 тыс. руб. Норма прибыли – 25%. Ссудный процент – 4% годовых. Решено выпустить 100 привилегированных акций с годовым доходом 100 руб. на каждую акцию. Определить: 1) сумму эмиссии; 2) возможный объем эмиссии обыкновенных акций при годовом доходе 500 руб. на каждую акцию. |
| 4. | <i>Задача.</i> КБ «Альфабанк» выпустил депозитные сертификаты $N_{ст}$ 1000 руб. со сроком обращения 60 дней и ставкой процентов 12% годовых. Рассчитайте процентный доход по такому сертификату, при условии, что банк использует простую систему начисления процентов |
| 5. | <i>Задача.</i> КБ «Альфабанк» выпустил депозитные сертификаты $N_{ст}$ 1500 руб. со сроком обращения 78 дней и ставкой процентов 13% годовых. Рассчитайте процентный доход по такому сертификату, при условии, что банк использует простую систему начисления процентов |

Типовые тестовые задания:

Выберете правильный вариант ответа

1. Место, где происходит первичная эмиссия и первичное размещение ценных бумаг, – это:
 - а) Первичный рынок
 - б) Вторичный рынок
 - в) Третичный рынок
 - г) Кредитный рынок

2. Рынок, где производится купля-продажа ранее выпущенных ценных бумаг, – это:
 - а) Вторичный рынок
 - б) Третичный рынок
 - в) Кредитный рынок
 - г) Первичный рынок

3. Рынок с немедленным исполнением сделок в течение 1–2 рабочих дней, не считая дня заключения сделки, – это:
 - а) Кассовый рынок
 - б) Срочный рынок
 - в) Организованный рынок
 - г) Не организованный рынок

4. Рынок, на котором заключаются разнообразные по виду сделки со сроком исполнения, превышающим 2 рабочих дня, – это:
 - а) Срочный рынок
 - б) Кассовый рынок
 - в) Неорганизованный рынок
 - г) Организованный рынок

5. Рынок, где осуществляется обращение ценных бумаг, на основе законодательно установленных правил между лицензированными профессиональными посредниками, – это:

- а) Организованный рынок
- б) Срочный рынок
- в) Неорганизованный рынок
- г) Кассовый рынок

Типовые расчетно-аналитические задания/задачи:

1. Инвестор купил 100 шт. обыкновенных акций компании «А» номиналом 50 руб. по цене 55 руб. за 1 шт. и продал их через 2 года по цене 60 руб. За тот же период времени суммарный объем чистой прибыли компании составил 10 млн. руб. Дивиденды по привилегированным акциям номиналом 100 руб. начислялись ежегодно по ставке 10 % годовых. Объем эмиссии компании составляет 175000 шт. акций. Доля привилегированных акций соответствует законодательно установленному нормативу. Дивидендный выход установлен на уровне 25%. Найти доход и доходность проведения описанной операции.

2. АО выпустило 10 тыс. шт. привилегированных акций Нст. 3 руб. и 40 тыс. шт. обыкновенных акций Нст. 1 руб. Годовой дивиденд по привилегированным акциям объявлен 10% от номинала. ЧП компании по итогам года достигла 10 млн. руб. Рассчитайте дивиденд на 1 обыкновенную акцию компании, если по решению общего собрания дивидендный выход составляет 1 %.

3. Объем эмиссии акций компании составляет 1 млн. шт., в том числе привилегированных – 200 тыс. шт. Дивиденды по привилегированным акциям Нст. 1 руб. начисляются по полугодиям по сложной ставке 4% годовых. По итогам года объем ЧП компании составил 50 млн. руб. Общее собрание приняло решение утвердить значение дивидендного выхода на уровне 30%. Рассчитайте сумму дивиденда на 1 обыкновенную акцию.

4. Акции компании «А» номиналом 10 руб. реализуются по курсу 110. Найти рыночную цену.

5. Продано по курсовой стоимости 1000 акций. Номинал акции составляет 10 руб. Дивиденд рассчитывается по простой ставке 15 % годовых. Ссудный процент составляет 10 % годовых. Рассчитайте: 1) курс акций; 2) учредительскую прибыль.

Примеры вопросов для опроса:

- 1. Место и роль ценных бумаг в функционировании финансово-кредитной системы России
- 2. История возникновения ценных бумаг
- 3. Сущность экономической категории «рынок ценных бумаг»
- 4. Социально-экономические предпосылки возрождения фондового рынка РФ в 90-е годы и тенденции его развития
- 5. Виды рынков ценных бумаг
- 6. Социально-экономические функции рынков ценных бумаг

Тематика докладов

- 1. История развития рынка ценных бумаг в царской России.
- 2. Ценные бумаги в условиях СССР.
- 3. Социально-экономические предпосылки возрождения фондового рынка в РФ в 90-е годы.
- 4. Характеристика современного рынка ценных бумаг в РФ.
- 5. Государственная концепция развития рынка ценных бумаг в России.
- 6. Роль государства в становлении и развитии отечественного фондового рынка.
- 7. Анализ имеющихся подходов к рассмотрению сущности ценной бумаги.

8. Необходимость рассмотрения и характеристики фундаментальных свойств ценных бумаг.
9. Характеристики ценных бумаг.
10. Классификация ценных бумаг по инвестиционным характеристикам.
11. История появления векселя и этапы развития норм законодательства о векселях.
12. Проблемы и перспективы развития вексельного обращения в РФ.
13. Проблемы и современные тенденции развития рынка акций в РФ
14. Проблемы и современные тенденции развития рынка долговых заимствований.
15. Становление и развитие рынка ПФИ в РФ.
17. Реструктуризация государственного долга в связи с финансовым кризисом 2008г.
18. Рынок ГЦБ в условиях СССР.

Тематика аналитических обзоров

1. Подготовка каждым обучающимся аналитического обзора: «Основные направления развития рынка корпоративных ценных бумаг в РФ (на основе использования Интернет-ресурсов, сайта Центрального банка РФ, сайта Росстата)».
2. Подготовка каждым обучающимся аналитического обзора: «Использование государственных ценных бумаг, как инструмента финансирования приоритетных проектов РФ (на основе использования Интернет-ресурсов, сайта Центрального банка РФ, сайта Росстата)».

Типовая структура зачетного задания

| <i>Наименование оценочного материала</i> | <i>Максимальное количество баллов</i> |
|--|--|
| Вопрос 1. Критерии классификации ценных бумаг | 15 |
| Вопрос 2. Саморегулирование рынка ценных бумаг | 15 |
| Практическое задание (расчетно-аналитическое): Инвестор приобрел 200 облигаций номиналом 100 руб. и сроком обращения 3 года. Куплены облигации по курсу 97% и через 2 года проданы по курсу 99%. На облигацию начисляется процентный доход по ставке сложных процентов 10% годовых. Рассчитайте доход инвестора и доходность финансовой операции. | 10 |

Показатели и критерии оценивания планируемых результатов освоения компетенций и результатов обучения, шкала оценивания

Таблица 5

| Шкала оценивания | | Формируемые компетенции | Индикатор достижения компетенции | Критерии оценивания | Уровень освоения компетенций |
|------------------|-----------|--|--|--|------------------------------|
| 85 – 100 баллов | «зачтено» | ПК-1. Мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно - сырьевых рынков. | ПК-1.1 Проведение исследования финансового рынка и изучение предложений финансовых услуг, сбор информации по спросу на рынке финансовых услуг (в том числе действующих правил и условий, тарифной политики и действующих форм документации), применение социологических, маркетинговых исследований | Знает верно и в полном объеме: методы и технологии сбора первичной финансовой информации, с применением современных средств связи, аппаратно-технических средств и компьютерных технологий, конъюнктуру и механизмы функционирования финансовых рынков, методы экономической диагностики рынка финансовых услуг, технологии проведения социологических и маркетинговых исследований. Умеет верно и в полном объеме получать, интерпретировать и документировать результаты исследований, производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг | Продвинутый |
| 85 – 100 баллов | «зачтено» | ПК-2. Финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг | ПК-2.1 Предоставление потребителю финансовых услуг информации о состоянии и перспективах рынка, тенденциях в изменении курсов ценных бумаг, иностранной валюты, условий по банковским продуктам и услугам, разъяснение суть финансовых продуктов, юридических и экономических характеристик финансовых продуктов и услуг, | Знает верно и в полном объеме: основы эффективных межличностных коммуникаций, необходимый спектр финансовых продуктов и услуг, экономические и юридические аспекты инвестиционной и страховой деятельности, нормативные и методические документы, регламентирующие вопросы подбора кредитных продуктов Умеет мыслить структурно, верно и в полном объеме прогнозировать и оценивать изменения финансовой ситуации при пользовании финансовыми (инвестиционными) услугами, предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, ориентированные на | Продвинутый |

| | | | | | |
|-----------------|-----------|---|---|--|--------------------|
| | | | составление окончательного перечня предлагаемых клиенту финансовых продуктов | потребности и интересы клиента, учитывать текущую финансовую ситуацию и перспективу при оценке предложений, направленных на решение финансовых задач клиента, осуществлять подбор финансовых продуктов и услуг, осуществлять профессиональные консультации, рассчитывать стоимость финансовых решений, оценивая потенциальные риски | |
| 85 – 100 баллов | «зачтено» | ПК-2. Финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг | ПК-2.3. Консультирование клиента и контрагентов по вопросам, относящимся к компетенции деятельности, по вопросам составления личного бюджета, страхования, формирования сбережений, управления кредитным и инвестиционным портфелем, разъяснение клиенту экономических и правовых последствий финансовых решений | Знает верно и в полном объеме: этику делового общения, необходимый спектр финансовых продуктов и услуг, порядок составления и заключения договоров об информационном обеспечении инвестиционных программ и мероприятий Умеет мыслить структурно, верно и в полном объеме предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, ориентированные на потребности и интересы клиента, учитывать текущую финансовую ситуацию и перспективу при оценке предложений, направленных на решение финансовых задач клиента; выступать в качестве эксперта в процессе принятия клиентом важных финансовых (инвестиционных) решений | Продвинутый |
| 85 – 100 баллов | «зачтено» | ПК-2. Финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг | ПК-2.4. Организация продажи и дополнительной продажи в рамках персонального финансового плана финансовых продуктов (банковские депозиты, паевые фонды, брокерское обслуживание, обезличенный металлический счет) в рамках персонального финансового плана, обеспечение взаимодействия | Знает верно и в полном объеме: общие принципы и технологии продаж, этику делового общения, необходимый спектр финансовых продуктов и услуг, основы эффективных межличностных коммуникаций Умеет мыслить структурно, верно и в полном объеме грамотно проводить переговоры, выстраивать механизм взаимодействия в коллективе, планировать работу структурного подразделения, предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, ориентированные на | Продвинутый |

| | | | | | |
|----------------|-----------|---|---|---|-------------------|
| | | | структурных подразделений и участие в планировании мероприятий, направленных на повышение качества финансового сервиса организации | потребности и интересы клиента | |
| 70 – 84 баллов | «зачтено» | ПК-1. Мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно - сырьевых рынков | ПК-1.1 Проведение исследования финансового рынка и изучение предложений финансовых услуг, сбор информации по спросу на рынке финансовых услуг (в том числе действующих правил и условий, тарифной политики и действующих форм документации), применение социологических, маркетинговых исследований | Знает с незначительными замечаниями: методы и технологии сбора первичной финансовой информации, с применением современных средств связи, аппаратно-технических средств и компьютерных технологий, конъюнктуру и механизмы функционирования финансовых рынков, методы экономической диагностики рынка финансовых услуг, технологии проведения социологических и маркетинговых исследований. Умеет с незначительными замечаниями: получать, интерпретировать и документировать результаты исследований, производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг | Повышенный |
| 70 – 84 баллов | «зачтено» | ПК-2. Финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг | ПК-2.1 Предоставление потребителю финансовых услуг информации о состоянии и перспективах рынка, тенденциях в изменении курсов ценных бумаг, иностранной валюты, условий по банковским продуктам и услугам, разъяснение суть финансовых продуктов, юридических и экономических характеристик финансовых | Знает с незначительными замечаниями: основы эффективных межличностных коммуникаций, необходимый спектр финансовых продуктов и услуг, экономические и юридические аспекты инвестиционной и страховой деятельности, нормативные и методические документы, регламентирующие вопросы подбора кредитных продуктов. Умеет с незначительными замечаниями: прогнозировать и оценивать изменения финансовой ситуации при пользовании финансовыми (инвестиционными) услугами, предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, | Повышенный |

| | | | | | |
|----------------|-----------|---|---|---|-------------------|
| | | | продуктов и услуг, составление окончательного перечня предлагаемых клиенту финансовых продуктов | ориентированные на потребности и интересы клиента, учитывать текущую финансовую ситуацию и перспективу при оценке предложений, направленных на решение финансовых задач клиента, осуществлять подбор финансовых продуктов и услуг, осуществлять профессиональные консультации, рассчитывать стоимость финансовых решений, оценивая потенциальные риски | |
| 70 – 84 баллов | «зачтено» | ПК-2. Финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг | ПК-2.3. Консультирование клиента и контрагентов по вопросам, относящимся к компетенции деятельности, по вопросам составления личного бюджета, страхования, формирования сбережений, управления кредитным и инвестиционным портфелем, разъяснение клиенту экономических и правовых последствий финансовых решений | Знает на базовом уровне, с ошибками этику делового общения, необходимый спектр финансовых продуктов и услуг, порядок составления и заключения договоров об информационном обеспечении инвестиционных программ и мероприятий Умеет на базовом уровне с ошибками: предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, ориентированные на потребности и интересы клиента, учитывать текущую финансовую ситуацию и перспективу при оценке предложений, направленных на решение финансовых задач клиента; выступать в качестве эксперта в процессе принятия клиентом важных финансовых (инвестиционных) решений | Повышенный |
| 70 – 84 баллов | «зачтено» | ПК-2. Финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг | ПК-2.4. Организация продажи и дополнительной продажи в рамках персонального финансового плана финансовых продуктов (банковские депозиты, паевые фонды, брокерское обслуживание, обезличенный металлический счет) в рамках персонального финансового плана, обеспечение взаимодействия | Знает на базовом уровне, с ошибками общие принципы и технологии продаж, этику делового общения, необходимый спектр финансовых продуктов и услуг, основы эффективных межличностных коммуникаций Умеет на базовом уровне с ошибками: грамотно проводить переговоры, выстраивать механизм взаимодействия в коллективе, планировать работу структурного подразделения, предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, ориентированные на потребности и интересы клиента | Повышенный |

| | | | | | |
|----------------|-----------|---|---|--|----------------|
| | | | структурных подразделений и участие в планировании мероприятий, направленных на повышение качества финансового сервиса организации | | |
| 50 – 69 баллов | «зачтено» | ПК-1. Мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно - сырьевых рынков | ПК-1.1 Проведение исследования финансового рынка и изучение предложений финансовых услуг, сбор информации по спросу на рынке финансовых услуг (в том числе действующих правил и условий, тарифной политики и действующих форм документации), применение социологических, маркетинговых исследований | Знает на базовом уровне, с ошибками: методы и технологии сбора первичной финансовой информации, с применением современных средств связи, аппаратно-технических средств и компьютерных технологий, конъюнктуру и механизмы функционирования финансовых рынков, методы экономической диагностики рынка финансовых услуг, технологии проведения социологических и маркетинговых исследований. Умеет на базовом уровне с ошибками: получать, интерпретировать и документировать результаты исследований, производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг | Базовый |
| 50 – 69 баллов | «зачтено» | ПК-2. Финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг | ПК-2.1 Предоставление потребителю финансовых услуг информации о состоянии и перспективах рынка, тенденциях в изменении курсов ценных бумаг, иностранной валюты, условий по банковским продуктам и услугам, разъяснение суть финансовых продуктов, юридических и экономических характеристик финансовых | Знает на базовом уровне, с ошибками основы эффективных межличностных коммуникаций, необходимый спектр финансовых продуктов и услуг, экономические и юридические аспекты инвестиционной и страховой деятельности, нормативные и методические документы, регламентирующие вопросы подбора кредитных продуктов Умеет на базовом уровне с ошибками: прогнозировать и оценивать изменения финансовой ситуации при пользовании финансовыми (инвестиционными) услугами, предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, | Базовый |

| | | | | | |
|----------------|-----------|---|---|---|----------------|
| | | | продуктов и услуг, составление окончательного перечня предлагаемых клиенту финансовых продуктов | ориентированные на потребности и интересы клиента, учитывать текущую финансовую ситуацию и перспективу при оценке предложений, направленных на решение финансовых задач клиента, осуществлять подбор финансовых продуктов и услуг, осуществлять профессиональные консультации, рассчитывать стоимость финансовых решений, оценивая потенциальные риски | |
| 50 – 69 баллов | «зачтено» | ПК-2. Финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг | ПК-2.3. Консультирование клиента и контрагентов по вопросам, относящимся к компетенции деятельности, по вопросам составления личного бюджета, страхования, формирования сбережений, управления кредитным и инвестиционным портфелем, разъяснение клиенту экономических и правовых последствий финансовых решений | Знает на базовом уровне, с ошибками этику делового общения, необходимый спектр финансовых продуктов и услуг, порядок составления и заключения договоров об информационном обеспечении инвестиционных программ и мероприятий Умеет на базовом уровне с ошибками: предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, ориентированные на потребности и интересы клиента, учитывать текущую финансовую ситуацию и перспективу при оценке предложений, направленных на решение финансовых задач клиента; выступать в качестве эксперта в процессе принятия клиентом важных финансовых (инвестиционных) решений | Базовый |
| 50 – 69 баллов | «зачтено» | ПК-2. Финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг | ПК-2.4. Организация продажи и дополнительной продажи в рамках персонального финансового плана финансовых продуктов (банковские депозиты, паевые фонды, брокерское обслуживание, обезличенный металлический счет) в рамках персонального финансового плана, обеспечение взаимодействия | Знает на базовом уровне, с ошибками общие принципы и технологии продаж, этику делового общения, необходимый спектр финансовых продуктов и услуг, основы эффективных межличностных коммуникаций Умеет на базовом уровне с ошибками: грамотно проводить переговоры, выстраивать механизм взаимодействия в коллективе, планировать работу структурного подразделения, предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, ориентированные на потребности и интересы клиента | Базовый |

| | | | | | |
|-----------------|--------------|---|---|---|------------------------------------|
| | | | структурных подразделений и участие в планировании мероприятий, направленных на повышение качества финансового сервиса организации | | |
| менее 50 баллов | «не зачтено» | ПК-1. Мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно - сырьевых рынков | ПК-1.1 Проведение исследования финансового рынка и изучение предложений финансовых услуг, сбор информации по спросу на рынке финансовых услуг (в том числе действующих правил и условий, тарифной политики и действующих форм документации), применение социологических, маркетинговых исследований | Не знает на базовом уровне: методы и технологии сбора первичной финансовой информации, с применением современных средств связи, аппаратно-технических средств и компьютерных технологий, конъюнктуру и механизмы функционирования финансовых рынков, методы экономической диагностики рынка финансовых услуг, технологии проведения социологических и маркетинговых исследований. Не умеет на базовом уровне: получать, интерпретировать и документировать результаты исследований, производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг | Компетенции не сформированы |
| менее 50 баллов | «не зачтено» | ПК-2. Финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг | ПК-2.1 Предоставление потребителю финансовых услуг информации о состоянии и перспективах рынка, тенденциях в изменении курсов ценных бумаг, иностранной валюты, условий по банковским продуктам и услугам, разъяснение суть финансовых продуктов, юридических и экономических характеристик финансовых | Не знает на базовом уровне: основы эффективных межличностных коммуникаций, необходимый спектр финансовых продуктов и услуг, экономические и юридические аспекты инвестиционной и страховой деятельности, нормативные и методические документы, регламентирующие вопросы подбора кредитных продуктов Не умеет на базовом уровне: прогнозировать и оценивать изменения финансовой ситуации при пользовании финансовыми (инвестиционными) услугами, предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, ориентированные на | Компетенции не сформированы |

| | | | | | |
|-----------------|--------------|---|---|---|------------------------------------|
| | | | продуктов и услуг, составление окончательного перечня предлагаемых клиенту финансовых продуктов | потребности и интересы клиента, учитывать текущую финансовую ситуацию и перспективу при оценке предложений, направленных на решение финансовых задач клиента, осуществлять подбор финансовых продуктов и услуг, осуществлять профессиональные консультации, рассчитывать стоимость финансовых решений, оценивая потенциальные риски | |
| менее 50 баллов | «не зачтено» | ПК-2. Финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг | ПК-2.3. Консультирование клиента и контрагентов по вопросам, относящимся к компетенции деятельности, по вопросам составления личного бюджета, страхования, формирования сбережений, управления кредитным и инвестиционным портфелем, разъяснение клиенту экономических и правовых последствий финансовых решений | Не знает на базовом уровне: этику делового общения, необходимый спектр финансовых продуктов и услуг, порядок составления и заключения договоров об информационном обеспечении инвестиционных программ и мероприятий Не умеет на базовом уровне: предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, ориентированные на потребности и интересы клиента, учитывать текущую финансовую ситуацию и перспективу при оценке предложений, направленных на решение финансовых задач клиента; выступать в качестве эксперта в процессе принятия клиентом важных финансовых (инвестиционных) решений | Компетенции не сформированы |
| менее 50 баллов | «не зачтено» | ПК-2. Финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг | ПК-2.4. Организация продажи и дополнительной продажи в рамках персонального финансового плана финансовых продуктов (банковские депозиты, паевые фонды, брокерское обслуживание, обезличенный металлический счет) в рамках персонального финансового плана, обеспечение взаимодействия | Не знает на базовом уровне: общие принципы и технологии продаж, этику делового общения, необходимый спектр финансовых продуктов и услуг, основы эффективных межличностных коммуникаций Не умеет на базовом уровне: грамотно проводить переговоры, выстраивать механизм взаимодействия в коллективе, планировать работу структурного подразделения, предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, ориентированные на потребности и интересы клиента | Компетенции не сформированы |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | структурных подразделений и участие в планировании мероприятий, направленных на повышение качества финансового сервиса организации | | |
|--|--|--|--|--|--|

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования
«Российский экономический университет имени Г. В. Плеханова»
Краснодарский филиал РЭУ им. Г. В. Плеханова

Факультет экономики, менеджмента и торговли

Кафедра финансов и кредита

АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.05 РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ

| | |
|---|--------------------------------|
| Направление подготовки | 38.03.01 Экономика |
| Направленность (профиль) программы | Финансовая безопасность |
| Уровень высшего образования | Бакалавриат |

Краснодар – 2022 г.

1. Цель и задачи дисциплины:

Целью учебной дисциплины «*Рынок ценных бумаг*» является формирование у обучающихся современных фундаментальных знаний, раскрывающих содержательные стороны влияния отношений, опосредованных рынком ценных бумаг, на воспроизводственные процессы, сущность, функции и место рынка ценных бумаг в структуре финансового механизма рыночной экономики, и практических навыков ведения фондовых операций, проведения исследований фондового рынка и его инструментов, финансового консультирования.

Задачи учебной дисциплины «*Рынок ценных бумаг*»:

- раскрытие причин возникновения, сущности и роли фондовых рынков;
- выявление особенностей и принципов функционирования рынков акций, облигаций и производных ценных бумаг;
- овладение необходимыми аспектами теории и принципами функционирования рынка ценных бумаг, а также практическими навыками разрешения хозяйственных ситуаций для активного использования полученных знаний в практической работе.

2. Содержание дисциплины:

| № п/п | Наименование разделов / тем дисциплины |
|--|--|
| 1. | Раздел 1. Экономическая сущность и виды ценных бумаг |
| 2. | Тема 1 Экономическая сущность, классификация и значение ценных бумаг |
| 3. | Тема 2 Корпоративные ценные бумаги |
| 4. | Тема 3. Государственные ценные бумаги |
| 5. | Раздел 2. Управление рынком ценных бумаг |
| 6. | Тема 4 Выпуск и обращение ценных бумаг |
| 7. | Тема 5 Определение и функциональные задачи рынка ценных бумаг |
| 8. | Тема 6 Биржевые индексы и их анализ |
| Трудоемкость дисциплины составляет 3 з.е. / 108 часов | |

Форма контроля –зачет

Составитель: к.э.н., доцент И.В. Сурина