

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Костина Лариса Николаевна
Должность: проректор
Дата подписания: 13.12.2024 06:43:44
Уникальный программный идентификатор:
1800f7d89cf4ea7507265ba593fe87537eb15a6c

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Донецкая академия управления и государственной службы»
(ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС»)

Центр дополнительного профессионального образования

УТВЕРЖДЕНА
решением ученого совета
ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС»
(в составе ДПП)
Протокол № 11/27 от 29.03.2024 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
«Рынок ценных бумаг»

ПО ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ ПРОФЕССИОНАЛЬНОЙ ПРОГРАММЕ
(профессиональной переподготовки)

«Управление государственными и муниципальными финансами»

Донецк
2024

Автор(ы)-составитель(и):

Канд. экон. наук, доцент, доцент
(степень, звание, должность)



К.В. Шарый
(ФИО)

Программа рассмотрена и рекомендована к утверждению на заседании кафедры финансов
Протокол заседания кафедры от 05.02.2024 г. № 12

СОДЕРЖАНИЕ

1	Цель и задачи дисциплины	4
2	Планируемые результаты изучения дисциплины	5
3	Объем дисциплины	6
4	Структура и содержание дисциплины	7
	4.1. Структура дисциплины	7
	4.2. Содержание дисциплины	8
5	Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по дисциплине	8
6	Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины	11
	6.1. Нормативно-правовые документы	11
	6.2. Основная литература	12
	6.3. Интернет ресурсы	13
7	Материально-техническое и программное обеспечение	14

1. Цель и задачи дисциплины

Цель – сформировать целостное представление о механизме функционирования рынка ценных бумаг и особенностях формирования и развития фондового рынка.

Задачи:

изучить механизм перераспределения средств посредством выпуска и обращения ценных бумаг;

раскрыть экономическую сущность ценных бумаг и их свойств;

проанализировать возможности применения различных видов ценных бумаг, взаимозависимости от их качественных характеристик и ограничений;

рассмотреть основы конструирования ценных бумаг;

изучить структуру фондового рынка и взаимосвязь его основных элементов;

проанализировать действующую нормативно-правовую базу, количественную и качественную характеристики фондового рынка и их соответствия мировым тенденциям.

2. Планируемые результаты изучения дисциплины

Таблица 1

Планируемые результаты обучения

Виды деятельности	Общепрофессиональные / профессиональные / универсальные компетенции	Знания	Умения	Практический опыт
Универсальные компетенции (формируются и/или совершенствуются)	УК – 5 Способен определять и реализовывать приоритеты собственной деятельности и способы ее совершенствования на основе самооценки	Способен определять и реализовывать приоритеты собственной деятельности и способы ее совершенствования на основе самооценки	Выстраивает иерархию целей деятельности и подчиненных им задач;	Владеет способами мониторинга образовательных результатов и осуществления их анализа
Организационно – управленческая	ОПК – 3 Использует финансовые элементы в целях осуществления финансового анализа и совершенствования деятельности субъектов финансового рынка	Использует финансовые элементы в целях осуществления финансового анализа и совершенствования деятельности субъектов финансового рынка	Анализирует текущую ситуацию на рынке ценных бумаг	Владеет методами анализа современного состояния финансовых рынков
Организационно – регулирующая	ПК – 6 Демонстрирует представление о международных валютно-финансовых отношениях, структуре финансовых рынков и об их участниках	Демонстрирует представление о международных валютно-финансовых отношениях, структуре финансовых рынков и об их участниках	Применяет отдельные инструменты и методы финансового анализа для решения профессиональных задач на микро- и макроуровне, в том числе на уровне финансового рынка и отдельных его институтов	Работает с различными источниками информации для проведения финансовых и инвестиционных расчетов
Исполнительно – распорядительная	ПК-7 Способен консультировать клиентов по использованию финансовых продуктов и услуг	Способен консультировать клиентов по использованию финансовых продуктов и услуг.	Анализирует факторы, влияющие на риск и доходность ценных бумаг, а также стоимость финансовых услуг и финансовых инструментов	Оценивает стоимость финансовых инструментов

3. Объем дисциплины

Таблица 2

Объем дисциплины

Виды учебной работы		С применением электронного обучения и (или) дистанционных образовательных технологий (час.) или зачетных единиц
Контактная работа слушателя с преподавателем, в том числе:		
лекции типа (Л) / интерактивные занятия (ИЗ)		6
лабораторные занятия (практикум) (ЛЗ) / интерактивные занятия (ИЗ)		
Практические занятия (ПЗ)/ интерактивные занятия (ИЗ)		2
Лабораторные работы (ЛР)		
Самостоятельная работа слушателя (СР)		10
Контактная самостоятельная работа слушателя (КСР)		
Промежуточная аттестация	форма	Зачет
	час.	2
Общая трудоемкость по учебному плану (час./з.е.)		20

4. Структура и содержание дисциплины

4.1. Структура дисциплины

Таблица 3

Структура дисциплины

№ п/п	Наименование (разделов/тем) дисциплины раздела / дисциплины / темы	Общая трудоемкость	Контактная работа, час.			Самостоятельная работа, час.	Контактная работа с применением дистанционных образовательных технологий, электронного обучения, час.			Самостоятельная работа, час.	Текущий контроль успеваемости	Код компетенции
			Всего	В том числе			Всего	В том числе				
				В форме практической подготовки	Лекции / в интерактивной форме			Практические (семинарские) занятия / в интерактивной форме	В форме практической подготовки			
1	Рынок ценных бумаг и его место в системе финансовых рынков	4				2		2	2	О		
2	Инструменты рынка ценных бумаг и операции с ними	4				2		2	2	О		
3	Инфраструктура рынка ценных бумаг	6				2		2	4			
4	Управление ценными бумагами	4				2		2	2	О		
	Форма контроля (зачет / экзамен)									3		
	Зачет	2								2		
	Итого	20				8		6	2	10	2	

Э – экзамен; З – зачет; О – опрос;

4.2. Содержание дисциплины

Таблица 4

Содержание дисциплины

Номер раздела (темы)	Содержание раздела (темы)	
	Темы лекций	Темы практических занятий
1		
	Рынок ценных бумаг и его место в системе финансовых рынков	
2		
	Инструменты рынка ценных бумаг и операции с ними	
3		
		Инфраструктура рынка ценных бумаг
4		
	Управление ценными бумагами	

5. Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по дисциплине

В рамках самостоятельной работы слушатель осуществляет подготовку к зачету, работая с законодательной базой, закрепляя понятия, изучая лекционный и практический материал.

Примерные вопросы для самоконтроля:

1. Вексель и закладная: понятие, виды, общее и различное.
2. Депозитные и сберегательные сертификаты банков.
3. Виды профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг.
4. Вторичный РЦБ.
5. Регулирование рынка ценных бумаг и его виды. Принципы регулирования.
6. Прямое государственное регулирование российского рынка ценных бумаг.
7. Косвенное государственное регулирование российского рынка ценных бумаг.
8. Государство как участник РЦБ и эмитент ценных бумаг, виды государственных ценных бумаг.

9. Инвесторы, их общая характеристика и классификация.
10. Первичный рынок ценных бумаг как фактический регулятор рыночной экономики, тенденции развития.
11. Другие основные ценные бумаги: депозитные сертификаты банков, сберегательные сертификаты, чеки, коносаменты, закладные.
12. Чеки и коносаменты.
13. Инфраструктура РЦБ. Задачи и механизмы. Системные элементы инфраструктуры РЦБ.
14. Классификация РЦБ.
15. Участники рынка ценных бумаг: Государство, Эмитенты.
16. Участники РЦБ: институциональные посредники.
17. Понятие и структура рынка ценных бумаг, его роль и значение в общей структуре финансового рынка.
18. Функции рынка ценных бумаг (общерыночные и специфические).
19. Фондовая биржа. Ее характеристика и виды сделок на фондовой бирже.
20. Основные биржевые индексы, их характеристика, роль и значение в экономике.

Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по дисциплине

Текущий контроль успеваемости осуществляется в форме опроса по каждой теме.

Примерные вопросы текущего контроля:

1. Ценные бумаги. Общая классификация бумаг.
2. Дилерская и брокерская деятельность на РЦБ.
3. Эмиссионные ценные бумаги.
4. Фьючерс, сущность, значение.
5. Американские и глобальные депозитарные расписки.
6. Облигации – долговые обязательства. Виды облигаций на российском облигационном рынке, их характеристика.

7. Акции, их виды и классификация.
8. Вексель и его виды (характеристика простого и переводного векселя).
9. Основные виды ценных бумаг, допущенные к обращению на российском фондовом рынке.
10. Структура рынка ценных бумаг: первичный и вторичный, биржевой и внебиржевой, организованный и неорганизованный рынки.
11. Клиринговая и депозитарная деятельность на РЦБ.
12. Опционные свидетельства, их роль и значение на фондовом рынке.
Виды опционных свидетельств.
13. Производные ценные бумаги, условия их функционирования на современном фондовом рынке.
14. Виды и характеристика государственных ценных бумаг.
15. Государственные ценные бумаги как форма существования государственного внутреннего внешнего долга. Задачи рынка государственных ценных бумаг.
16. Международные ценные бумаги.
17. Инструменты хеджирования.
18. Ордерные ценные бумаги.
19. Начисление и выплата дивидендов по акциям и процентов по облигациям.

Таблица 5

Оценочные средства промежуточной аттестации
(критерии оценивания)

<i>Сумма баллов за все виды учебной деятельности</i>	<i>По государственной шкале</i>	<i>По шкале ECTS</i>
90-100	«Отлично»	A
80-89	«Хорошо»	B
75-79		C
70-74	«Удовлетворительно»	D
60-69		E
35-59	«Неудовлетворительно»	FX
0-34		F

6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

Слушателям рекомендуется при изучении лекционных материалов обращать внимание на категории, формулировки, раскрывающие содержание тех или иных явлений и процессов, научные выводы и практические рекомендации по их применению. Целесообразно в рабочих конспектах формировать поля, на которых возможно делать пометки из рекомендованной литературы, дополняющие материал лекции, а также подчеркивающие особую важность тех или иных положений.

В ходе изучения практических вопросов в зависимости от темы занятия выполняется поиск информации по решению проблем, решение задач.

При подготовке к промежуточной аттестации слушатель должен освоить актуальный тезаурус, повторить материал лекционных и практических занятий.

6.1. Нормативно-правовые документы

1. «Конституция Российской Федерации» (принята всенародным голосованием 12.12.1993 с изменениями, одобренными в ходе общероссийского голосования 01.07.2020);

2. Федеральный закон от 27.05.2003 N 58-ФЗ (ред. от 05.12.2022) «О системе государственной службы Российской Федерации».

3. Федеральный закон от 22.04.1996 N 39-ФЗ (ред. от 25.12.2023) «О рынке ценных бумаг».

4. Федеральный закон от 24.07.2002 N 111-ФЗ (ред. от 25.12.2023) «Об инвестировании средств для финансирования накопительной пенсии в Российской Федерации».

5. Федеральный закон от 29.11.2001 N 156-ФЗ (ред. от 19.12.2023) «Об инвестиционных фондах».

6. Федеральный закон от 25.02.1999 N 39-ФЗ (ред. от 25.12.2023) «Об инвестиционной деятельности в Российской Федерации, осуществляемой в форме капитальных вложений»

6.2. Основная литература

1. Алехин, Б. И. Рынок ценных бумаг : учебник и практикум для вузов / Б. И. Алехин. – 2-е изд., испр. и доп. – Москва : Издательство Юрайт, 2024. – 497 с.
2. Вавилов, С. А. Финансовая математика. Стохастический анализ : учебник и практикум для вузов / С. А. Вавилов, К. Ю. Ермоленко. – Москва : Издательство Юрайт, 2024. – 244 с.
3. Гузнов, А. Г. Регулирование, контроль и надзор на финансовом рынке в Российской Федерации : учебное пособие для вузов / А. Г. Гузнов, Т. Э. Рождественская. – 4-е изд., перераб. и доп. – Москва : Издательство Юрайт, 2024. – 585 с.
4. Гусева, И. А. Рынок ценных бумаг и производных финансовых инструментов : учебник и практикум для вузов / И. А. Гусева. – 2-е изд. – Москва : Издательство Юрайт, 2024. – 224 с.
5. Гусева, И. А. Финансовые рынки и институты : учебник и практикум для вузов / И. А. Гусева. – 2-е изд., перераб. и доп. – Москва : Издательство Юрайт, 2024. – 344 с.
6. Евстигнеев В. Р. Портфельные инвестиции в мире и России: выбор стратегии / Евстигнеев В. Р. – М.: Эдиториал УРСС, 2019. – 304 с.
7. Международная инвестиционная деятельность: учебное пособие / [Е. Н. Петрушкевич и др.]. – Минск: Белорусский государственный экономический университет, 2021. – 344 с.
8. Международный финансовый рынок : учебник и практикум для вузов / М. А. Эскиндаров [и др.] ; под общей редакцией М. А. Эскиндарова, Е. А. Звоновой. – Москва : Издательство Юрайт, 2024. – 430 с.
9. Мировые финансы: регулирование и оценка конъюнктуры мировых рынков : учебник и практикум для вузов / М. А. Эскиндаров [и др.] ; под общей редакцией М. А. Эскиндарова, Е. А. Звоновой. – Москва : Издательство Юрайт, 2024. – 270 с.

10. Мировые финансы: структура и анализ мировых рынков : учебник и практикум для вузов / М. А. Эскиндаров [и др.] ; под общей редакцией М. А. Эскиндарова, Е. А. Звоновой. – Москва : Издательство Юрайт, 2024. – 409 с.
11. Основы портфельного инвестирования : учебник для вузов / Т. В. Никитина, А. В. Репета-Турсунова, М. Фрёммель, А. В. Ядрин. – 2-е изд., испр. и доп. – Москва : Издательство Юрайт, 2024. – 195 с.
12. Разработка системы управления рисками и капиталом (ВПОДК) : учебник и практикум для вузов / А. Д. Дугин [и др.] ; под научной редакцией А. Д. Дугина, Г. И. Пеникаса. – Москва : Издательство Юрайт, 2024. – 367 с.
13. Теплова, Т. В. Инвестиции : учебник и практикум для вузов / Т. В. Теплова. – 2-е изд., перераб. и доп. – Москва : Издательство Юрайт, 2024. – 781 с.
14. Терехова, Е. В. Правовое регулирование прямых и портфельных инвестиций: учебно-методическое пособие / Е. В. Терехова. – Москва: Русайнс, 2022. – 228 с.
15. Шапкин, А. С. Управление портфелем инвестиций ценных бумаг / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. – 6-е изд. – Москва: Дашков и К, 2021. – 510 с.
16. Щеголева, Н. Г. Технологии и финансовые инновации : учебник для вузов / Н. Г. Щеголева. – Москва : Издательство Юрайт, 2024. – 81 с.
17. Якимова, Е. М. Оценка вероятности банкротства предприятия как аналитическое обоснование инвестиционных решений в границах личных финансов / Е. М. Якимова Современные тенденции в финансовой сфере: монография. – Иркутск, 2021. – 458 с.

6.3. Интернет ресурсы

1. Росстат – федеральная служба государственной статистики. Режим доступа: <http://www.gks.ru>.
2. Базы данных Министерства экономического развития и торговли России. Режим доступа: www.economy.gov.ru.

3. Федеральный образовательный портал. Экономика. Социология. Менеджмент. Режим доступа: <http://www.iep.ru/ru/publikacii/categories.html>.
4. База открытых данных Росфинмониторинга. Режим доступа: <http://www.fedsfm.ru/opendata>.
5. Единый инструмент по поиску, анализу и учету инвестиций. Режим доступа: <https://financemarket.ru/>.
6. Всемирная федерация бирж. Режим доступа: <https://www.world-exchanges.org/>
7. Финансовый портал: котировки акций, курсы валют, форум трейдеров, аналитика и новости. Режим доступа: <https://mfd.ru/>

7. Материально-техническое и программное обеспечение

Программа обеспечена условиями для функционирования электронной информационно-образовательной среды, включающей в себя электронные информационные ресурсы, электронные образовательные ресурсы, совокупность информационных технологий, телекоммуникационных технологий, соответствующих технологических средств и обеспечивающей освоение обучающимися слушателями дополнительной профессиональной программы профессиональной переподготовки в полном объеме независимо от места нахождения слушателей.

Организация учебного процесса ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС» с применением электронного курса осуществляется с использованием системы электронного обучения MOODLE.

Доступ к средствам дистанционного обучения предоставляется в режиме 24 часа в сутки 7 дней в неделю без учета объемов потребляемого трафика за исключением перерывов для проведения необходимых ремонтных и профилактических работ при обеспечении совокупной доступности услуг не менее 99,5% в месяц.

Для обучения слушателям необходимы наличие интернет-браузера и подключение к информационно-телекоммуникационной сети Интернет.