

Министерство науки и высшего образования РФ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Национальный исследовательский университет «МЭИ»

Направление подготовки/специальность: 38.03.01 Экономика

Наименование образовательной программы: Бухгалтерский учет, анализ и аудит

Уровень образования: высшее образование - бакалавриат

Форма обучения: Очно-заочная

Рабочая программа дисциплины
РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ

Блок:	Блок 1 «Дисциплины (модули)»
Часть образовательной программы:	Вариативная
№ дисциплины по учебному плану:	Б1.В.15.07.02
Трудоемкость в зачетных единицах:	5 семестр - 5;
Часов (всего) по учебному плану:	180 часов
Лекции	5 семестр - 30 часов;
Практические занятия	5 семестр - 30 часов;
Лабораторные работы	не предусмотрено учебным планом
Консультации	5 семестр - 2 часа;
Самостоятельная работа	5 семестр - 117,5 часов;
в том числе на КП/КР	не предусмотрено учебным планом
Иная контактная работа	проводится в рамках часов аудиторных занятий
включая: Тестирование Контрольная работа Кейс (решение конкретных производственных ситуаций)	
Промежуточная аттестация:	
Экзамен	5 семестр - 0,5 часа;

Москва 2017

ПРОГРАММУ СОСТАВИЛ:

Преподаватель

(должность)

	Подписано электронной подписью ФГБОУ ВО «НИУ «МЭИ»	
	Сведения о владельце ЦЭП МЭИ	
	Владелец	Щевьёва В.А.
	Идентификатор	Rd2ec7c32-ShchevyevaVA-3f68ebd

(подпись)

В.А. Щевьёва

(расшифровка подписи)

СОГЛАСОВАНО:

Руководитель образовательной программы

(должность, ученая степень, ученое звание)

	Подписано электронной подписью ФГБОУ ВО «НИУ «МЭИ»	
	Сведения о владельце ЦЭП МЭИ	
	Владелец	Сухарева Е.В.
	Идентификатор	R2bc266f4-SukharevaYevV-2948f94

(подпись)

Е.В. Сухарева

(расшифровка подписи)

Заведующий выпускающей кафедры

(должность, ученая степень, ученое звание)

	Подписано электронной подписью ФГБОУ ВО «НИУ «МЭИ»	
	Сведения о владельце ЦЭП МЭИ	
	Владелец	Курдюкова Г.Н.
	Идентификатор	R6ab6dd0d-KurdiukovaGN-ca01d8d

(подпись)

Г.Н. Курдюкова

(расшифровка подписи)

1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель освоения дисциплины: формирование у студентов базовых знаний о характеристиках и свойствах ценных бумаг, обращающихся на финансовом рынке РФ и выработка у них представления о работе с ценными бумагами и биржевой информацией о фондовых инструментах

Задачи дисциплины

- изучение экономической сущности ценных бумаг, условий их выпуска и обращения;
- ознакомление с современными видами ценных бумаг, их особенностями и возможностью использования в хозяйственной практике экономических субъектов;
- ознакомление со структурой рынка ценных бумаг, его участниками, формирование представления о профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг и ее государственном регулировании;
- ознакомление с основами инвестирования в ценные бумаги, методами инвестиционного анализа, оценкой финансовых рисков, связанных с ценными бумагами.

Формируемые у обучающегося **компетенции** и запланированные **результаты обучения** по дисциплине, соотнесенные с **индикаторами достижения компетенций**:

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Запланированные результаты обучения
ОПК-2 способностью осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач		знать: - теоретические и правовые основы функционирования рынка ценных бумаг. уметь: - проводить анализ взаимосвязи элементов рынка ценных бумаг.
ПК-6 способностью анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей		знать: - основные характеристики ценных бумаг. уметь: - систематизировать и обобщать информацию об основных фондовых инструментах и использовать ее для решения конкретных экономических задач; - использовать экономический инструментарий для оценки доходности по различным видам ценных бумаги и готовить аналитический отчет об эффективности инвестирования в них.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ ВО

Дисциплина относится к части, формируемой участниками образовательных отношений блока дисциплин основной профессиональной образовательной программе Бухгалтерский учет, анализ и аудит (далее – ОПОП), направления подготовки 38.03.01 Экономика, уровень образования: высшее образование - бакалавриат.

Требования к входным знаниям и умениям:
- знать основы корпоративных финансов

- знать основы теории вероятности
- уметь учитывать фактор времени при оценке эффективности инвестиций

Результаты обучения, полученные при освоении дисциплины, необходимы при выполнении выпускной квалификационной работы.

3. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

3.1 Структура дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины составляет 5 зачетных единиц, 180 часов.

№ п/п	Разделы/темы дисциплины/формы промежуточной аттестации	Всего часов на раздел	Семестр	Распределение трудоемкости раздела (в часах) по видам учебной работы										Содержание самостоятельной работы/ методические указания
				Контактная работа							СР			
				Лек	Лаб	Пр	Консультация		ИКР		ПА	Работа в семестре	Подготовка к аттестации /контроль	
КПР	ГК	ИККП	ТК											
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15
1	фундаментальные понятия рынка ценных бумаг	15	5	3	-	2	-	-	-	-	-	10	-	<p><u>Самостоятельное изучение теоретического материала:</u> Изучение дополнительного материала по темам "Регулирование рынка ценных бумаг" <u>Подготовка к текущему контролю:</u> Повторение материала по разделу "фундаментальные понятия рынка ценных бумаг" <u>Изучение материалов литературных источников:</u> [1], 11–29; 260-268; 287-316 [3], 9-35; 41-45, 81–98</p>
1.1	основы рынка ценных бумаг	10		2	-	2	-	-	-	-	-	6	-	
1.2	регулирование рынка ценных бумаг	5		1	-	-	-	-	-	-	-	4	-	
2	профессиональные участники рынка ценных бумаг	21		4	-	-	-	-	-	-	-	17	-	
2.1	структура рынка ценных бумаг: виды участников и их взаимодействие	4	1	-	-	-	-	-	-	-	3	-	<p><u>Самостоятельное изучение теоретического материала:</u> Изучение дополнительного материала по разделу "профессиональные участники рынка ценных бумаг" <u>Подготовка к текущему контролю:</u> Повторение материала по разделу *профессиональные участники рынка ценных бумаг" <u>Изучение материалов литературных источников:</u> [1], 212-259 [3], 46–49, 50-54, 56-69, 72-78; 101-114, 139-149</p>	
2.2	виды профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг	12	2	-	-	-	-	-	-	-	10	-		
2.3	фондовая биржа	5	1	-	-	-	-	-	-	-	4	-		
3	ценные бумаги	42	8	-	10	-	-	-	-	-	24	-		
3.1	понятие ценных бумаг	10	2	-	2	-	-	-	-	-	6	-	<p><u>Подготовка к текущему контролю:</u> Повторение материала по разделу "ценные</p>	

3.2	основные ценные бумаги	32	6	-	8	-	-	-	-	-	18	-	бумаги" <u>Изучение материалов литературных источников:</u> [1], 55–138; 420–448 [2], 4-12; 16-35
4	операции на фондовом рынке	54	12	-	18	-	-	-	-	-	24	-	<u>Подготовка к текущему контролю:</u> Повторение материала по разделу "операции на фондовом рынке"
4.1	фондовые индексы	8	2	-	2	-	-	-	-	-	4	-	<u>Проведение исследований:</u> Работа выполняется по индивидуальному заданию. Для проведения исследования применяется следующие материалы: на сайте Московской биржи и сайте выбранной компании необходимо найти всю информацию о выбранной акции <u>Изучение материалов литературных источников:</u> [1], 155-190 [2], 12-16; 35-44
4.2	портфели ценных бумаг	20	4	-	6	-	-	-	-	-	10	-	
4.3	производные финансовые инструменты	26	6	-	10	-	-	-	-	-	10	-	
5	современные тенденции развития рынка ценных бумаг	12	3	-	-	-	-	-	-	-	9	-	<u>Подготовка к текущему контролю:</u> Повторение материала по разделу "современные тенденции развития рынка ценных бумаг"
5.1	тенденции развития рынка ценных бумаг	4	1	-	-	-	-	-	-	-	3	-	<u>Изучение материалов литературных источников:</u> [1], 139-154
5.2	вторичные ценные бумаги	8	2	-	-	-	-	-	-	-	6	-	
	Экзамен	36.0	-	-	-	-	2	-	-	0.5	-	33.5	
	Всего за семестр	180.0	30	-	30	-	2	-	-	0.5	84	33.5	
	Итого за семестр	180.0	30	-	30		2		-	0.5		117.5	

Примечание: Лек – лекции; Лаб – лабораторные работы; Пр – практические занятия; КПр – аудиторные консультации по курсовым проектам/работам; ИККП – индивидуальные консультации по курсовым проектам/работам; ГК- групповые консультации по разделам дисциплины; СР – самостоятельная работа студента; ИКР – иная контактная работа; ТК – текущий контроль; ПА – промежуточная аттестация

3.2 Краткое содержание разделов

1. фундаментальные понятия рынка ценных бумаг

1.1. основы рынка ценных бумаг
рынок ценных бумаг как альтернативный источник финансирования экономики. классификация финансовых и фондовых рынков. эмиссия ценных бумаг.

1.2. регулирование рынка ценных бумаг
регулирующие функции государства. функции Банка России. саморегулируемая организация.

2. профессиональные участники рынка ценных бумаг

2.1. структура рынка ценных бумаг: виды участников и их взаимодействие
эмитенты и инвесторы. участники рынка ценных бумаг, обеспечивающие его нормальное функционирование.

2.2. виды профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг
брокеры и дилеры. деятельность по управлению ценными бумагами. регистраторы. депозитарии. расчетно-клиринговые организации.

2.3. фондовая биржа
задачи и функции фондовой биржи. внебиржевой рынок.

3. ценные бумаги

3.1. понятие ценных бумаг
экономическая сущность ценных бумаг. реквизиты ценных бумаг. классификация ценных бумаг.

3.2. основные ценные бумаги
акция. облигация. вексель. государственные ценные бумаги. иные ценные бумаги.

4. операции на фондовом рынке

4.1. фондовые индексы
промышленный индекс Доу-Джонса, как индекс, взвешенный по ценам. индекс Standard & Poor's, как индекс, взвешенный по рыночной стоимости. индексы зарубежных и международных рынков акций. индикаторы рынков облигаций. индексы ценных бумаг Российской Федерации.

4.2. портфели ценных бумаг
измерение риска и доходности. определение и классификация портфелей ценных бумаг. управление портфелем ценных бумаг. ожидаемая доходность портфеля. ожидаемый риск портфеля. модель оценки капитальных активов.

4.3. производные финансовые инструменты
классификация операций с ценными бумагами. форвардный контракт. фьючерсный контракт. опционный контракт. своп-контракт. финансовая инженерия.

5. современные тенденции развития рынка ценных бумаг

5.1. тенденции развития рынка ценных бумаг
глобализация. секьюритизация. финансовая инженерия.

5.2. вторичные ценные бумаги
вторичные ценные бумаги, связанные с акциями. вторичные ценные бумаги, связанные с
закладными. вторичные ценные бумаги, связанные с облигациями.

3.3. Темы практических занятий

1. Стоимостные характеристики ценных бумаг;
2. Фондовые индексы;
3. Хеджирования помощью фьючерсных и опционных контрактов. Опционные стратегии. Своп-контракты;
4. Доходность и риск портфеля ценных бумаг.

3.4. Темы лабораторных работ

не предусмотрено

3.5 Консультации

Групповые консультации по разделам дисциплины (ГК)

1. Обсуждение материалов по кейсам раздела "фундаментальные понятия рынка ценных бумаг"
2. Обсуждение материалов по кейсам раздела "профессиональные участники рынка ценных бумаг"
3. Обсуждение материалов по кейсам раздела "ценные бумаги"
4. Обсуждение материалов по кейсам раздела "операции на фондовом рынке"
5. Обсуждение материалов по кейсам раздела "современные тенденции развития рынка ценных бумаг"

3.6 Тематика курсовых проектов/курсовых работ

Курсовой проект/ работа не предусмотрены

3.7. Соответствие разделов дисциплины и формируемых в них компетенций

Запланированные результаты обучения по дисциплине (в соответствии с разделом 1)	Коды индикаторов	Номер раздела дисциплины (в соответствии с п.3.1)					Оценочное средство (тип и наименование)
		1	2	3	4	5	
Знать:							
теоретические и правовые основы функционирования рынка ценных бумаг	ОПК-2(Компетенция)	+	+	+			Контрольная работа/Тест «Профессиональные участники рынка ценных бумаг» Тестирование/Тест «Фундаментальные понятия рынка ценных бумаг»
основные характеристики ценных бумаг	ПК-6(Компетенция)			+		+	Тестирование/Тест «Фундаментальные понятия рынка ценных бумаг»
Уметь:							
проводить анализ взаимосвязи элементов рынка ценных бумаг	ОПК-2(Компетенция)	+	+	+			Тестирование/Тест «Фундаментальные понятия рынка ценных бумаг»
использовать экономический инструментарий для оценки доходности по различным видам ценных бумаги и готовить аналитический отчет об эффективности инвестирования в них	ПК-6(Компетенция)				+	+	Контрольная работа/Контрольная работа «Сделки с ценными бумагами и инфраструктура рынка ценных бумаг»
систематизировать и обобщать информацию об основных фондовых инструментах и использовать ее для решения конкретных экономических задач	ПК-6(Компетенция)			+	+		Кейс (решение конкретных производственных ситуаций)/Индивидуальное задание Контрольная работа/Контрольная работа «Сделки с ценными бумагами и инфраструктура рынка ценных бумаг» Контрольная работа/Контрольная работа «Стоимостная оценка ценных бумаг»

4. КОМПЕТЕНТНОСТНО-ОРИЕНТИРОВАННЫЕ ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ КОНТРОЛЯ ОСВОЕНИЯ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (ТЕКУЩИЙ КОНТРОЛЬ УСПЕВАЕМОСТИ, ПРОМЕЖУТОЧНАЯ АТТЕСТАЦИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ)

4.1. Текущий контроль успеваемости

5 семестр

Форма реализации: Билеты (письменный опрос)

1. Контрольная работа «Сделки с ценными бумагами и инфраструктура рынка ценных бумаг» (Контрольная работа)
2. Контрольная работа «Стоимостная оценка ценных бумаг» (Контрольная работа)
3. Тест «Профессиональные участники рынка ценных бумаг» (Контрольная работа)

Форма реализации: Компьютерное задание

1. Тест «Фундаментальные понятия рынка ценных бумаг» (Тестирование)

Форма реализации: Проверка задания

1. Индивидуальное задание (Кейс (решение конкретных производственных ситуаций))

Балльно-рейтинговая структура дисциплины является приложением А.

4.2 Промежуточная аттестация по дисциплине

Экзамен (Семестр №5)

Оценка определяется в соответствии с Положением о балльно-рейтинговой системе для студентов НИУ «МЭИ» на основании семестровой и аттестационной составляющих.

Примечание: Оценочные материалы по дисциплине приведены в фонде оценочных материалов ОПОП.

5. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

5.1 Печатные и электронные издания:

1. Галанов, В. А. Рынок ценных бумаг : учебник для вузов по направлению 38.03.01 "Экономика" (квалификация (степень) "бакалавр") / В. А. Галанов . – 2-е изд., перераб. и доп. – Москва : ИНФРА-М, 2021 . – 414 с. – (Высшее образование . Бакалавриат) . - ISBN 978-5-16-012443-8 .;
2. Щевьева, В. А. Анализ финансовых инвестиций. Сборник задач : учебное пособие по курсу "Экономическая инвестиций" по направлению "Экономика", "Теплоэнергетика" / В. А. Щевьева, Моск. энерг. ин-т (МЭИ ТУ) . – М. : Изд-во МЭИ, 2006 . – 48 с. - ISBN 5-903072-60-7 .;
3. Газалиев М. М., Осипов В. А.- "Рынок ценных бумаг", Издательство: "Дашков и К", Москва, 2018 - (160 с.)
<https://e.lanbook.com/book/105562>.

5.2 Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение:

1. СДО "Прометей";
2. Office;
3. Windows;
4. Майнд Видеоконференции.

5.3 Интернет-ресурсы, включая профессиональные базы данных и информационно-справочные системы:

1. ЭБС Лань - <https://e.lanbook.com/>
2. ЭБС "Университетская библиотека онлайн" - http://biblioclub.ru/index.php?page=main_ub_red
3. Научная электронная библиотека - <https://elibrary.ru/>
4. База данных Web of Science - <http://webofscience.com/>
5. База данных Scopus - <http://www.scopus.com>
6. Национальная электронная библиотека - <https://rusneb.ru/>
7. Электронная библиотека МЭИ (ЭБ МЭИ) - <http://elib.mpei.ru/login.php>
8. Портал открытых данных Российской Федерации - <https://data.gov.ru>
9. База открытых данных Министерства экономического развития РФ - <http://www.economy.gov.ru>

6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Тип помещения	Номер аудитории, наименование	Оснащение
Учебные аудитории для проведения лекционных занятий и текущего контроля	С-305, Мультимедийный учебный класс	стол преподавателя, стол, стул, вешалка для одежды, доска меловая, мультимедийный проектор, экран, ноутбук
	Ж-120, Машинный зал ИВЦ	сервер, кондиционер
Учебные аудитории для проведения практических занятий, КР и КП	С-305, Мультимедийный учебный класс	стол преподавателя, стол, стул, вешалка для одежды, доска меловая, мультимедийный проектор, экран, ноутбук
Учебные аудитории для проведения промежуточной аттестации	С-305, Мультимедийный учебный класс	стол преподавателя, стол, стул, вешалка для одежды, доска меловая, мультимедийный проектор, экран, ноутбук
Помещения для самостоятельной работы	С-304/1, Научно-исследовательская лаборатория	стол, стул, шкаф для одежды, вешалка для одежды, компьютерная сеть с выходом в Интернет, мультимедийный проектор, экран, доска маркерная, ноутбук, компьютер персональный
	С-311, Компьютерный класс каф. "ЭЭП"	кресло рабочее, стол, стул, вешалка для одежды, компьютерная сеть с выходом в Интернет, мультимедийный проектор, экран, доска маркерная, ноутбук, компьютер персональный, инвентарь специализированный
Помещения для консультирования	С-305, Мультимедийный учебный класс	стол преподавателя, стол, стул, вешалка для одежды, доска меловая, мультимедийный проектор, экран, ноутбук
Помещения для хранения оборудования и учебного инвентаря	С-304/2, Архив	стеллаж

БАЛЛЬНО-РЕЙТИНГОВАЯ СТРУКТУРА ДИСЦИПЛИНЫ**Рынок ценных бумаг**

(название дисциплины)

5 семестр**Перечень контрольных мероприятий текущего контроля успеваемости по дисциплине:**

- КМ-1 Тест «Фундаментальные понятия рынка ценных бумаг» (Тестирование)
 КМ-2 Тест «Профессиональные участники рынка ценных бумаг» (Контрольная работа)
 КМ-3 Контрольная работа «Стоимостная оценка ценных бумаг» (Контрольная работа)
 КМ-4 Контрольная работа «Сделки с ценными бумагами и инфраструктура рынка ценных бумаг» (Контрольная работа)
 КМ-5 Индивидуальное задание (Кейс (решение конкретных производственных ситуаций))

Вид промежуточной аттестации – Экзамен.

Номер раздела	Раздел дисциплины	Индекс КМ:	КМ-1	КМ-2	КМ-3	КМ-4	КМ-5
		Неделя КМ:	3	7	14	17	17
1	фундаментальные понятия рынка ценных бумаг						
1.1	основы рынка ценных бумаг		+	+			
1.2	регулирование рынка ценных бумаг		+	+			
2	профессиональные участники рынка ценных бумаг						
2.1	структура рынка ценных бумаг: виды участников и их взаимодействие		+	+			
2.2	виды профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг		+				
2.3	фондовая биржа		+				
3	ценные бумаги						
3.1	понятие ценных бумаг		+	+			
3.2	основные ценные бумаги		+		+	+	+
4	операции на фондовом рынке						
4.1	фондовые индексы					+	
4.2	портфели ценных бумаг				+	+	+
4.3	производные финансовые инструменты					+	

5	современные тенденции развития рынка ценных бумаг					
5.1	тенденции развития рынка ценных бумаг				+	
5.2	вторичные ценные бумаги	+				
Вес КМ, %:		19	19	30	30	2