

**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ  
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
«ОРЕНБУРГСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АГРАРНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»**

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

**Б1.В.06 Рынок ценных бумаг**

**Направление подготовки 38.03.01 Экономика**

**Профиль подготовки Финансы и кредит**

**Квалификация (степень) выпускника бакалавр**

**Форма обучения заочная**

## 1. Цели освоения дисциплины

Целями освоения дисциплины «Рынок ценных бумаг» являются:

- сформировать у студентов понимание рынка ценных бумаг как сложной взаимосвязанной системы, являющейся частью экономики России и мировой экономики;
- выработать у них умение производить необходимые финансовые расчеты, связанные с практической работой на фондовом рынке.

## 2. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Рынок ценных бумаг» относится к вариативной части. Требования к предшествующим знаниям представлены в таблице 2.1. Перечень дисциплин, для которых дисциплина «Рынок ценных бумаг» является основополагающей, представлен в табл. 2.2.

**Таблица 2.1 – Требования к пререквизитам дисциплины**

Дисциплина	Раздел
Макроэкономика	1,2,3,4
Деньги, кредит, банки	1,2,3,4

**Таблица 2.2 – Требования к постреквизитам дисциплины**

Дисциплина	Раздел
Финансовый менеджмент	1,2,3,4
Моделирование рынка ценных бумаг	1,2,3,4

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

**Таблица 3.1 – Взаимосвязь планируемых результатов обучения по дисциплине и планируемых результатов освоения образовательной программы**

Индекс и содержание компетенции	Знания	Умения	Навыки и (или) опыт деятельности
ОПК-2: способностью осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач	1 этап: закономерности функционирования современной экономики на макро- и микроуровне; 2 этап: основополагающие понятия рынка ценных бумаг; основные положения законодательства в области функционирования рынка ценных бумаг в России	1 этап: использовать знания по теории рынка ценных бумаг в своей будущей практической деятельности; 2 этап: применять понятийно – категориальный аппарат, полученный в процессе освоения дисциплины «Рынок ценных бумаг»	1 этап: владеть современными концепциями рынка ценных бумаг; 2 этап: владеть методикой применения современных информационных технологий и пакетов прикладных программ в области рынка ценных бумаг

ПК-7: способностью, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет	1 этап: объекты и субъекты рынка ценных бумаг; виды ценных бумаг и их рынков; 2 этап: проблемы и тенденции развития международного и российского рынков ценных бумаг	1 этап: использовать знания по теории рынка ценных бумаг в своей будущей практической деятельности; 2 этап: использовать нормативно-правовые документы в ходе изучения дисциплины	1 этап: владеть методикой применения современных информационных технологий и пакетов прикладных программ в области рынка ценных бумаг; 2 этап: владеть терминологией, используемой при изучении дисциплины, на английском языке
---	--	--	---

#### 4. Объем дисциплины

Объем дисциплины «Рынок ценных бумаг» составляет 5 зачетных единиц (180 академических часов), распределение объема дисциплины на контактную работу обучающихся с преподавателем (КР) и на самостоятельную работу обучающихся (СР) по видам учебных занятий и по периодам обучения представлено в таблице 4.1.

**Таблица 4.1 – Распределение объема дисциплины  
по видам учебных занятий и по периодам обучения, академические часы**

№ п/п	Вид учебных занятий	Итого КР	Итого СР	Семестр № 6		Семестр № 7	
				КР	СР	КР	СР
<b>1</b>	<b>2</b>	<b>3</b>	<b>4</b>	<b>5</b>	<b>6</b>	<b>7</b>	<b>8</b>
1	Лекции (Л)	10	-	8	-	2	-
2	Лабораторные работы (ЛР)	-	-	-	-	-	-
3	Практические занятия (ПЗ)	14	-	12	-	2	-
4	Семинары (С)	-	-	-	-	-	-
5	Курсовое проектирование (КП)	-	-	-	-	-	-
6	Рефераты (Р)	-	-	-	-	-	-
7	Эссе (Э)	-	-	-	-	-	-
8	Индивидуальные домашние задания (ИДЗ)	-	11	-	-	-	11
9	Самостоятельное изучение вопросов (СИВ)	-	108	-	64	-	44
10	Подготовка к занятиям (ПкЗ)	-	28	-	24	-	4
11	Промежуточная аттестация	4	5	-	-	4	5
12	Наименование вида промежуточной аттестации	х	х	экзамен		экзамен	
13	Всего	28	152	20	88	8	64

## 5. Структура и содержание дисциплины

Структура дисциплины представлена в таблице 5.1.

**Таблица 5.1 – Структура дисциплины**

№ п/п	Наименования разделов и тем	Семестр	Трудоёмкость по видам учебной работы, час.										
			лекции	лабораторная работа	практические занятия	семинары	Курсовое проектирование	Рефераты (эссе)	индивидуальные домашние задания	самостоятельное изучение вопросов	подготовка к занятиям	Промежуточная аттестация	Коды формируемых компетенции
1	2	3	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17
1.	<b>Раздел 1</b> <b>Ценные бумаги и их характеристики</b>	6	4	-	4	-	-	-	-	18	8	-	ОПК – 2, ПК -7
1.1.	<b>Тема 1</b> Рынок ценных бумаг как альтернативный источник финансирования экономики	6	2	-	2	-	-	-	-	3	4	-	ОПК – 2, ПК -7
1.2.	<b>Тема 2</b> Понятие ценной бумаги.	6	2	-	2	-	-	-	-	3	4	-	ОПК – 2, ПК -7
1.3	<b>Тема 3</b> История появления ценных бумаг	6	-	-	-	-	-	-	-	6	-	-	ОПК – 2, ПК -7
1.4	<b>Тема 4</b> Классические виды ценных бумаг и их характеристика	6	-	-	-	-	-	-	-	6	-	-	ОПК – 2, ПК -7
2	<b>Раздел 2</b> <b>Производные финансовые инструменты</b>	6	2	-	4	-	-	-	-	20	8	-	ОПК – 2, ПК -7

№ п/п	Наименования разделов и тем	Семестр	Трудоёмкость по видам учебной работы, час.										
			лекции	лабораторная работа	практические занятия	семинары	Курсовое проектирование	Рефераты (эссе)	индивидуальные домашние задания	самостоятельное изучение вопросов	подготовка к занятиям	Промежуточная аттестация	Коды формируемых компетенции
1	2	3	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17
2.1	<b>Тема 5</b> Производные ценные бумаги и их характеристика	6	2	-	4	-	-	-	-	3	8	-	ОПК – 2, ПК -7
2.2	<b>Тема 6</b> Финансовые инструменты на рынке ценных бумаг	6	-	-	-	-	-	-	-	6	-	-	ОПК – 2, ПК -7
2.3	<b>Тема 7</b> Международные ценные бумаги	6	-	-	-	-	-	-	-	6	-	-	ОПК – 2, ПК -7
2.4	<b>Тема 8</b> Рынок ценных бумаг и его структура (западная модель)	6	-	-	-	-	-	-	-	5	-	-	ОПК – 2,
3.	<b>Раздел 3 Рынок ценных бумаг и его участники</b>	6	2	-	4	-	-	-	-	26	8	-	ОПК – 2, ПК -7
3.1.	<b>Тема 9</b> Первичный рынок ценных бумаг и его характеристика.	6	2	-	2	-	-	-	-	3	4	-	ОПК – 2, ПК -7
3.2	<b>Тема 10</b> Вторичный биржевой рынок (фондовая биржа)	6	-	-	2	-	-	-	-	3	4	-	ОПК-2, ПК-7
3.3.	<b>Тема 11</b> Биржевая информация	6	-	-	-	-	-	-	-	5	-	-	ОПК-2
3.4.	<b>Тема 12</b> Участники вторичного рынка.	6	-	-	-	-	-	-	-	5	-	-	ОПК-2

№ п/п	Наименования разделов и тем	Семестр	Трудоёмкость по видам учебной работы, час.										
			лекции	лабораторная работа	практические занятия	семинары	Курсовое проектирование	Рефераты (эссе)	индивидуальные домашние задания	самостоятельное изучение вопросов	подготовка к занятиям	Промежуточная аттестация	Коды формируемых компетенции
1	2	3	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17
3.5.	<b>Тема 13</b> Механизм принятия решений на рынке ценных бумаг (фундаментальный и технический анализ)	6	-	-	-	-	-	-	-	5	-	-	ОПК-2, ПК-7
3.6	<b>Тема 14</b> Участники рынка ценных бумаг	6	-	-	-	-	-	-	-	5	-	-	ОПК-2
4.	<b>Контактная работа</b>	6	8	-	12	-	-	-	-	-	-	х	х
5.	<b>Самостоятельная работа</b>	6	-	-	-	-	-	-	-	64	24	х	х
6.	<b>Объем дисциплины в семестре</b>	6	8	-	12	-	-	-	-	64	24	х	х
7.	<b>Раздел 4</b> <b>Регулирование рынка ценных бумаг</b>	7	2	-	2	-	-	-	-	44	4	-	ОПК-2
7.1	<b>Тема 15</b> Система государственного регулирования рынка ценных бумаг	7	2	-	2	-	-	-	-	11	4	-	ОПК-2, ПК-7
7.2	<b>Тема 16</b> Инвестиционная деятельность кредитно-финансовых институтов на рынке ценных бумаг	7	-	-	-	-	-	-	-	11	-	-	ОПК-2, ПК-7
7.3.	<b>Тема 17</b>	7	-	-	-	-	-	-	-	11	-	-	ОПК-2

№ п/п	Наименования разделов и тем	Семестр	Трудоёмкость по видам учебной работы, час.										
			лекции	лабораторная работа	практические занятия	семинары	Курсовое проектирова ние	Рефераты (эссе)	индивидуаль ные домашние задания	самостоятель ное изучение вопросов	подготовка к занятиям	Промежуточ ная аттестация	Коды формируем ых компетенции
1	2	3	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17
	Рынок ценных бумаг Российской Федерации												ПК-7
7.4.	<b>Тема 18</b> Депозитарно- регистрационный механизм рынка ценных бумаг	7	-	-	-	-	-	-	-	11	-	-	ОПК-3
8.	<b>Контактная работа</b>	7	2	х	2	×	х	×	×	×	×	4	х
9.	<b>Самостоятельная работа</b>	7	×	×	×	×	х	х	11	44	4	5	х
10.	<b>Объем дисциплины в семестре</b>	7	2	х	2	×	×	×	11	44	4	9	х
11.	<b>Всего по дисциплине</b>	х	10	х	14	х	х	х	11	108	28	9	х

## 5.2. Содержание дисциплины

### 5.2.1 – Темы лекций

№ п.п.	Наименование темы лекции	Объем, академические часы
Л-1	Рынок ценных бумаг как альтернативный источник финансирования экономики	2
Л-2	Понятие ценной бумаги	2
Л-3	Производные ценные бумаги и их характеристика	2
Л-4	Первичный рынок ценных бумаг и его характеристика.	2
Л-5	Система государственного регулирования рынка ценных бумаг	2
Итого по дисциплине		10

### 5.2.2 – Темы практических занятий

№ п.п.	Наименование темы занятия	Объем, академические часы
ПЗ-1	Рынок ценных бумаг как альтернативный источник финансирования экономики	2
ПЗ-2	Понятие ценной бумаги	2
ПЗ-3	Производные ценные бумаги и их характеристика	4
ПЗ-4	Первичный рынок ценных бумаг и его характеристика.	2
ПЗ- 5	Вторичный биржевой рынок (фондовая биржа	2
ПЗ-6	Система государственного регулирования рынка ценных бумаг	2
Итого по дисциплине		14

### 5.2.3 Темы индивидуальных домашних заданий

Индивидуальное домашнее задание выполняется в форме контрольной работы. Работа выполняется по вариантам. Для выполнения контрольной работы студент должен изучить все разделы дисциплины.

### 5.2.4 – Вопросы для самостоятельного изучения

№ п.п.	Наименования темы	Наименование вопроса	Объем, академические часы
1.	Рынок ценных бумаг как альтернативный источник финансирования экономики	Понятие финансового рынка и его значение. Функции финансового рынка. Характеристика звеньев финансового рынка. Понятие фондового рынка, его виды.	3



2.	Понятие ценной бумаги	Понятие ценной бумаги – юридический подход. Понятие ценной бумаги – экономический подход. Свойства ценной бумаги. Реквизиты ценной бумаги.	3
3.	История появления ценных бумаг	История развития фондовых бирж Члены фондовых бирж Органы управления биржей	6
4.	Классические виды ценных бумаг и их характеристика	Понятие акции, характеристика, виды акций. Причины применения акций. Дивиденд. Понятие облигации, характеристика. Виды облигаций. Причины применения векселя.	6
5	Производные ценные бумаги и их характеристика	Процентные форвардные контракты Валютные фьючерсы контракты Процентные свопы Валютные свопы	3
6	Финансовые инструменты на рынке ценных бумаг	Сходства и различия форвардных фьючерсных контрактов Классификация опционов Классификация свопов	6
7	Международные ценные бумаги	Американские депозитарные расписки Российские депозитарные расписки	6
8	Рынок ценных бумаг и его структура (западная модель)	Рынок ценных бумаг США Рынок ценных бумаг Японии Рынок ценных бумаг Германии Рынок ценных бумаг Великобритании Рынок ценных бумаг Западной Европы	5
9	Первичный рынок ценных бумаг и его характеристика.	Эмиссия ценных бумаг, ее виды. Организация и порядок эмиссии. Характеристика рисков на рынке ценных бумаг.	3
10	Вторичный биржевой рынок (фондовая биржа).	Задачи и функции фондовой биржи. Структуры управления фондовой биржей. Внебиржевые фондовые рынки, особенности их организации	3
11	Биржевая информация	Понятие биржевого индекса, его сущность Основные зарубежные индексы Российские фондовые индексы Котировка ценных бумаг	5
12	Участники вторичного рынка.	Инвесторы Профессиональные участники	5

		рынка ценных бумаг	
13	Механизм принятия решений на рынке ценных бумаг (фундаментальный и технический анализ).	Фундаментальный анализ Технический анализ Рейтинг ценных бумаг	5
14	Участники рынка ценных бумаг	Брокеры. Дилеры. Трейдеры. Маркет-мейкеры	5
15	Система государственного регулирования рынка ценных бумаг	Механизм биржевых торгов Внебиржевой вторичный рынок Механизм регулирования российского фондового рынка	11
16	Инвестиционная деятельность кредитно-финансовых институтов на рынке ценных бумаг	Цели инвестирования Распределение и планирование портфеля инвестиций Инвестиционная политика на РЦБ	11
17	Рынок ценных бумаг Российской Федерации.	Работа маркетмейкера и специалиста Исполнение брокером крупных клиентских заявок	11
18	Депозитарно-регистрационный механизм рынка ценных бумаг.	Брокерская деятельность Дилерская деятельность Функции управляющих компаний Регистраторы Депозитариусы Расчетно – клиринговые организации	11
Итого по дисциплине			108

## 6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

### 6.1 Основная литература, необходимая для освоения дисциплины

1. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс]: учебник для прикладного бакалавриата / Ю. А. Соколов [и др.]; отв. ред. Ю. А. Соколов. — М.: Издательство Юрайт, 2016. — 384 с. — (Бакалавр. Прикладной курс). — Режим доступа: [http:// www. biblio-online.ru /399088](http://www.biblio-online.ru/399088). - ЭБС «ЮРАЙТ». — ISBN 978-5-9916-7774-5.

2. Чалдаева, Л. А. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс]: учебник для академического бакалавриата / Л. А. Чалдаева, А. А. Килячков. — 5-е изд., перераб. и доп. — М.: Издательство Юрайт, 2016. — 341 с. — (Бакалавр. Академический курс). — Режим доступа: [http:// www. biblio-online.ru /405325](http://www.biblio-online.ru/405325). - ЭБС «ЮРАЙТ». — ISBN 978-5-9916-5111-0.

### 6.2 Дополнительная литература, необходимая для освоения дисциплины

1. Галанов В. А. Рынок ценных бумаг [Текст]: учебник/ В. А. Галанов. - М.: ИНФРА - М, 2012. - 378 с. - (Высшее образование). - ISBN 978-5-16-003490-4.

2. Гусева, И. А. Финансовые рынки и институты [Электронный ресурс]: учебник и практикум для академического бакалавриата / И. А. Гусева. — М.: Издательство Юрайт, 2016. — 347 с. — (Бакалавр. Академический курс). — Режим доступа: [http:// www. biblio-online.ru /398768](http://www.biblio-online.ru/398768). - ЭБС «ЮРАЙТ». — ISBN 978-5-9916-7859-9.

3. Пробин П.С. Финансовые рынки [Электронный ресурс]: учебное пособие для студентов вузов обучающихся по направлению подготовки «Экономика» (квалификация (степень) «бакалавр»)/ Пробин П.С., Проданова Н.А.— Электрон. текстовые данные.—

М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2015.— 175 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/34528>.— ЭБС «IPRbooks».— ISBN 978-5-238-02613-8.

4. Сахарова Л.А. Финансовые рынки и институты [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Сахарова Л.А.— Электрон. текстовые данные.— М.: Русайнс, 2015.— 171 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/61677>.— ЭБС «IPRbooks».— ISBN 978-5-4365-0547-3.

5. Суглобов А.Е. Операции с ценными бумагами [Электронный ресурс]: учебно-практическое пособие для студентов вузов, обучающихся по специальности «Финансы и кредит»/ Суглобов А.Е., Владимирова О.Н.— Электрон. текстовые данные.— М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2015.— 191 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/59298>.— ЭБС «IPRbooks».— ISBN 978-5-238-02476-9.

### **6.3 Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины и другие материалы к занятиям**

Электронное учебное пособие включающее:

- конспект лекций;
- методические указания по проведению практических занятий.

### **6.4 Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине**

Электронное учебное пособие включающее:

- методические рекомендации по выполнению индивидуальных домашних заданий;
- методические рекомендации по самостоятельному изучению вопросов;
- методические рекомендации по подготовке к занятиям.

### **6.5 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем**

1. OpenOffice
2. MS Excel
3. JoliTest

### **6.6 Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины**

1. [www.biblio-online.ru/](http://www.biblio-online.ru/) - ЭБС "ЮРАЙТ"
2. [www.iprbookshop.ru/](http://www.iprbookshop.ru/) - ЭБС «IPRbooks»
3. [www.e.lanbook.com/](http://www.e.lanbook.com/) - ЭБС "Лань"
4. [www.ibooks.ru/](http://www.ibooks.ru/) - ЭБС "ibooks.ru"
5. [www.elibrary.ru/](http://www.elibrary.ru/) - eLIBRARY.RU
6. <https://ru.wikipedia.org/> - Википедия
7. <http://www.consultant.ru> - Справочная правовая система «Консультант Плюс»
8. <http://www.gks.ru> - Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики Российской Федерации.
9. <http://www.cbr.ru> - Сайт Центрального Банка России

### **7. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине**

Занятия лекционного типа проводятся в аудитории, оборудованной мультимедиапроектором, компьютером, учебной доской.

Занятия семинарского типа (практические занятия) проводятся в аудиториях, оборудованных учебной доской, рабочим местом преподавателя (стол, стул), а также посадочными местами для обучающихся, число которых соответствует численности обучающихся в группе.

Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине представлен в Приложении 1.

Программа разработана в соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, утвержденным приказом Министерства образования и науки РФ от 12 ноября 2015 г. № 1327

Разработал(и):

О.А. Рыбалкина

