

Документ подписан простой электронной подписью.  
Информация о владельце:

ФИО: Кандрашина Елена Александровна

Должность: И.о. ректора ФГАОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 22.07.2024 14:55:55

Уникальный программный ключ:

2db64eb9605ce27edd3b8e8fdd32c70e0674ddd2

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации**  
**Федеральное государственное автономное образовательное учреждение**  
**высшего образования**  
**«Самарский государственный экономический университет»**

**Институт** Институт национальной и мировой экономики

**Кафедра** Экономической теории

**УТВЕРЖДЕНО**

Ученым советом Университета

(протокол №10 от 30 мая 2024 г.)

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА**

**Наименование дисциплины** Б1.В.07 Фондовый рынок

**Основная профессиональная образовательная программа** 38.04.01 Экономика программа Финансовые аналитические и информационные технологии

Квалификация (степень) выпускника магистр

Самара 2024

## Содержание (рабочая программа)

Стр.

- 1 Место дисциплины в структуре ОП
- 2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 3 Объем и виды учебной работы
- 4 Содержание дисциплины
- 5 Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины
- 6 Фонд оценочных средств по дисциплине

Целью изучения дисциплины является формирование результатов обучения, обеспечивающих достижение планируемых результатов освоения образовательной программы.

## 1. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Фондовый рынок входит в часть, формируемая участниками образовательных отношений блока Б1.Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Глобальный рынок финансовых услуг, Микроэкономический анализ и управление рисками

## 2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Изучение дисциплины Фондовый рынок в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

### Универсальные компетенции (УК):

УК-3 - Способен организовывать и руководить работой команды, выработывая командную стратегию для достижения поставленной цели

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
УК-3	УК-3.1: Знать:	УК-3.2: Уметь:	УК-3.3: Владеть (иметь навыки):
	методики формирования команд; методы эффективного руководства коллективами	разрабатывать командную стратегию; организовывать работу коллективов; управлять коллективом; разрабатывать мероприятия по личностному, образовательному и профессиональному росту	методами организации и управления коллективом, планированием его действий

### Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-1 - Способен организовывать деятельность службы внутреннего контроля и специального внутреннего контроля организаций-участников рынка ценных бумаг

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-1	ПК-1.1: Знать:	ПК-1.2: Уметь:	ПК-1.3: Владеть (иметь навыки):
	основы построения систем внутреннего контроля и управления рисками, выбора методов и процедур, используемых при осуществлении оценки эффективности работы служб внутреннего контроля и управления рисками финансовой организации, в том числе	организовывать деятельность службы внутреннего контроля и специального внутреннего контроля организаций-участников рынка ценных бумаг, оценить надежность и эффективность внутреннего контроля и управления рисками, в том числе и с позиций	способностью организовывать деятельность службы внутреннего контроля и специального внутреннего контроля организаций-участников рынка ценных бумаг, оценить надежность и эффективность внутреннего контроля и управления рисками, в том числе и с позиций



		семинарского типа				соотношении с результатами обучения по образовательной программе
		Практич. занятия				
1.	Фондовый рынок: субъектная структура	10			60.35	УК-3.1, УК-3.2, УК-3.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3
2.	Фондовый рынок: объектная структура	10			60.35	УК-3.1, УК-3.2, УК-3.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3
	Выполнение курсового проекта		3			
	Контроль		34			
	<b>Итого</b>	<b>20</b>	<b>3.3</b>	<b>2</b>	<b>120.7</b>	

## 4.2 Содержание разделов и тем

### 4.2.1 Контактная работа

#### Тематика занятий семинарского типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия семинарского типа**	Тематика занятия семинарского типа
1.	Фондовый рынок: субъектная структура	практическое занятие	Эмитенты и инвесторы. Профессиональные посредники на фондовом рынке
		практическое занятие	Профессиональная инфраструктура фондового рынка: депозитарии, репозитарии, регистраторы
		практическое занятие	Фондовая биржа и ее роль в рыночной экономике
		практическое занятие	Клиринг и его разновидности. Центральный контрагент
		практическое занятие	Биржевые товары и их ключевые черты
2.	Фондовый рынок: объектная структура Фондовый рынок: субъектная структура	практическое занятие	Инструменты фондовой и срочной секций
		практическое занятие	Инструменты сектора устойчивого развития, сектора роста, сектора инноваций и инвестиций
		практическое занятие	Первичное публичное размещение ценных бумаг

\*\* семинары, практические занятия, практикумы, лабораторные работы, коллоквиумы и иные аналогичные занятия

#### Иная контактная работа

При проведении учебных занятий СГЭУ обеспечивает развитие у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств (включая при необходимости проведение интерактивных лекций, групповых дискуссий, ролевых игр, тренингов, анализ ситуаций и имитационных моделей, преподавание дисциплин (модулей) в форме курсов, составленных на основе результатов научных исследований, проводимых организацией, в том числе с учетом региональных особенностей профессиональной деятельности выпускников и потребностей работодателей).

Формы и методы проведения иной контактной работы приведены в Методических указаниях по основной профессиональной образовательной программе.

### 4.2.2 Самостоятельная работа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид самостоятельной работы ***
1.	Фондовый рынок: субъектная структура	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование
2.	Фондовый рынок: объектная структура	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование

\*\*\* самостоятельная работа в семестре, написание курсовых работ, докладов, выполнение контрольных работ

## 5. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

### 5.1 Литература:

#### Основная литература

1. Рынок ценных бумаг : учебник для вузов / Н. И. Берзон [и др.]. — 5-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 514 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-11196-5. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/449663>

#### Дополнительная литература

1. Михайленко, М. Н. Рынок ценных бумаг : учебник и практикум для вузов / М. Н. Михайленко. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 326 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-04961-9. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/468907>

2. Кузьмина О. Ю. Мировой рынок ценных бумаг [Электронный ресурс] : учебное пособие / М. Е. Коновалова. - Самара : Изд-во Самар. гос. экон. ун-та, 2017. - 53 с. - ISBN 978-5-94622-781-0. <http://lib1.sseu.ru/MegaPro/Web>

3. Кузьмина О. Ю. Институты коллективного инвестирования [Электронный ресурс] : учебное пособие / М. Е. Коновалова. - Самара : Изд-во Самар. гос. экон. ун-та, 2017. - 69 с. - ISBN 978-5-94622-786-5. <http://lib1.sseu.ru/MegaPro/Web>

4. Коновалова М. Е. Российские государственные ценные бумаги [Электронный ресурс] : учебное пособие / О. Ю. Кузьмина. - Самара : Изд-во самар. гос. экон. ун-та, 2017. - 59 с. - ISBN 978-5-94622-780-3. <http://lib1.sseu.ru/MegaPro/Web>

5. Никитина Н. А. Публичные экономические интересы на рынке ценных бумаг: неюрисдикционные формы защиты [Электронный ресурс] : монография / под ред. В. В. Болговой. - Самара : Самар. гос. экон. ун-т., 2015. - 168 с. - ISBN 978-5-94622-579-3. <http://lib1.sseu.ru/MegaPro/Web>

#### Литература для самостоятельного изучения

1.

### 5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения

1. Astra Linux Special Edition «Смоленск», «Орел»; РедОС

2. МойОфис Стандартный 2, МойОфис Образование, Р7-Офис Профессиональный

### 5.3 Современные профессиональные базы данных, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Профессиональная база данных «Информационные системы Министерства экономического развития Российской Федерации в сети Интернет» (Портал «Официальная Россия» - <http://www.gov.ru/>)

2. Государственная система правовой информации «Официальный интернет-портал правовой информации» (<http://pravo.gov.ru/>)

3. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/ru/>)

4. Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики - <http://www.gks.ru/>)

### 5.4. Информационно-справочные системы, к которым обеспечивается доступ

**обучающихся**

1. Справочно-правовая система «Консультант Плюс»
2. Справочно-правовая система «ГАРАНТ-Максимум»

**5.5. Специальные помещения**

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран
Учебные аудитории для проведения практических занятий (занятий семинарского типа)	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для самостоятельной работы	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для хранения и профилактического обслуживания оборудования	Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования

**5.6 Лаборатории и лабораторное оборудование****6. Фонд оценочных средств по дисциплине Фондовый рынок:****6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине**

<b>Вид контроля</b>	<b>Форма контроля</b>	<b>Отметить нужное знаком « + »</b>
Текущий контроль	Оценка докладов	+
	Устный/письменный опрос	+
	Тестирование	+
	Практические задачи	+
	Оценка контрольных работ (для заочной формы обучения)	+
	Оценка курсовых проектов	+
Промежуточный контроль	Экзамен	+

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования; Положением о балльно-рейтинговой системе оценки успеваемости обучающихся по основным образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры в федеральном государственном автономном образовательном учреждении высшего образования «Самарский государственный экономический университет».

**6.2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе**

**Универсальные компетенции (УК):**

УК-3 - Способен организовывать и руководить работой команды, вырабатывая командную стратегию для достижения поставленной цели

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	УК-3.1: Знать:	УК-3.2: Уметь:	УК-3.3: Владеть (иметь навыки):
	методики формирования команд; методы эффективного руководства коллективами	разрабатывать командную стратегию; организовывать работу коллективов; управлять коллективом; разрабатывать мероприятия по личностному, образовательному и профессиональному росту	методами организации и управления коллективом, планированием его действий
Пороговый	проблемы подбора эффективной команды для решения профессиональных задач	применять принципы и методы организации командной деятельности в процессе решения профессиональных задач	навыками подбора членов команды для наиболее эффективного выполнения практических задач
Стандартный (в дополнение к пороговому)	модели организационного поведения, факторы формирования организационных отношений в сфере оказания финансовых услуг	вырабатывать стратегию командной работы и на ее основе организовать отбор членов команды для достижения поставленной цели	навыками организации и управления командным взаимодействием в решении поставленных целей
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	основные условия эффективной командной работы с целью оптимизации оказания финансовых услуг	подбирать методы и методики исследования в ходе решения профессиональных практических задач	навыками участия в разработке стратегии командной работы с целью решения практических профессиональных задач

**Профессиональные компетенции (ПК):**

ПК-1 - Способен организовывать деятельность службы внутреннего контроля и специального внутреннего контроля организаций-участников рынка ценных бумаг

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине

	ПК-1.1: Знать:	ПК-1.2: Уметь:	ПК-1.3: Владеть (иметь навыки):
	основы построения систем внутреннего контроля и управления рисками, выбора методов и процедур, используемых при осуществлении оценки эффективности работы служб внутреннего контроля и управления рисками финансовой организации, в том числе и участника рынка ценных бумаг	организовывать деятельность службы внутреннего контроля и специального внутреннего контроля организаций-участников рынка ценных бумаг, оценить надежность и эффективность внутреннего контроля и управления рисками, в том числе и с позиций выявления и предотвращения последствий конфликта интересов	способностью организовывать деятельность службы внутреннего контроля и специального внутреннего контроля организаций-участников рынка ценных бумаг, оценить надежность и эффективность внутреннего контроля и управления рисками, в том числе и с позиций выявления и предотвращения последствий конфликта интересов
Пороговый	основы построения систем внутреннего контроля и управления рисками, выбора методов и процедур, используемых при осуществлении внутреннего контроля и управления рисками	организовывать деятельность службы внутреннего контроля и специального внутреннего контроля организаций-участников рынка ценных бумаг	навыками построения систем внутреннего контроля и управления рисками финансовой организации
Стандартный (в дополнение к пороговому)	методики проверки и оценки надежности и эффективности внутреннего контроля и управления рисками	проверить и оценить надежность и эффективность внутреннего контроля и управления рисками	способностью оценить надежность и эффективность внутреннего контроля и управления рисками
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	методы оценки эффективности работы субъектов внутреннего контроля — структурных подразделений и работников организаций-участников рынка ценных бумаг	оценить эффективности работы субъектов внутреннего контроля — структурных подразделений и работников организаций-участников рынка ценных бумаг	способностью оценить эффективность работы субъектов внутреннего контроля — структурных подразделений и работников организаций-участников рынка ценных бумаг

ПК-2 - Способен управлять рисками подразделения брокерско-дилерской организации, управляющей организации, депозитария, клиринговой организации и регистратора

Планируемые результаты обучения по программе	<b>Планируемые результаты обучения по дисциплине</b>		
	ПК-2.1: Знать:	ПК-2.2: Уметь:	ПК-2.3: Владеть (иметь навыки):
	основы организации и координации процессов управления рисками брокерско-дилерской организации, управляющей организации,	организовывать и координировать процессы управления рисками брокерско-дилерской организации, управляющей организации,	способностью организации и координации процессов управления рисками брокерско-дилерской организации, управляющей организации, депозитария,

	депозитария, клиринговой организации и регистратора, а также методики выявления и оценки наиболее значимых рисков	депозитария, клиринговой организации и регистратора, а также выявлять и оценивать наиболее значимые риски	клиринговой организации и регистратора, а также выявления и оценки наиболее значимых рисков
Пороговый	основы организации и координации процессов управления рисками брокерско-дилерской организации	организовывать и координировать процессы управления рисками брокерско-дилерской организации	способностью организации и координации процессов управления рисками брокерско-дилерской организации
Стандартный (в дополнение к пороговому)	основы организации и координации процессов управления рисками брокерско-дилерской организации, управляющей организации, депозитария.	организовывать и координировать процессы управления рисками брокерско-дилерской организации, управляющей организации, депозитария, клиринговой организации и регистратора	способностью организации и координации процессов управления рисками брокерско-дилерской организации, управляющей организации
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	методики выявления и оценки наиболее значимых рисков	выявлять и оценивать наиболее значимые риски	способностью организации и координации процессов депозитария, клиринговой организации и регистратора

### 6.3. Паспорт оценочных материалов

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контролируемые планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по программе	Вид контроля/используемые оценочные средства	
			Текущий	Промежуточный
1.	Фондовый рынок: субъектная структура	УК-3.1, УК-3.2, УК- 3.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК- 2.2, ПК-2.3	Аналитическое исследование, тестирование, оценка курсовых работ	Экзамен
2.	Фондовый рынок: объектная структура	УК-3.1, УК-3.2, УК- 3.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК- 2.2, ПК-2.3	Аналитическое исследование, тестирование, оценка курсовых работ	Экзамен

### 6.4. Оценочные материалы для текущего контроля

Задания и требования для выполнения аналитического исследования по дисциплине для оценки сформированности компетенций размещены в ЭИОС СГЭУ, <https://lms2.sseu.ru/enrol/index.php?id=23944>

Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций (min 20, max 50 + ссылку на ЭИОС с тестами)

<https://lms2.sseu.ru/enrol/index.php?id=23944>

### Примерная тематика курсовых проектов

1. Российский рынок корпоративных облигаций и его структурная сбалансированность
2. Субфедеральные и муниципальные займы: опыт обращения и перспективы развития
3. Российский рынок акций в условиях внешних шоков
4. Формирование инвестиционного портфеля на рынке ценных бумаг и оценка его эффективности
5. Российский рынок секьюритизации ипотечных активов: состояние и перспективы развития
6. Коммерческий банк как участник рынка ценных бумаг
7. Государство на рынке ценных бумаг
8. Инвестиционные компании на российском рынке ценных бумаг
9. Привлечение розничных инвесторов на фондовый рынок посредством ИИС
10. Российский рынок коллективных инвестиций: современное состояние и перспективы развития
11. Фондовая биржа и ее роль в условиях рыночной экономики
12. Зарубежные IPO российских компаний: архитектура рынка и организация выхода
13. Профессиональные участники рынка ценных бумаг: количественная и качественная структура деятельности на фондовом рынке
14. Качество корпоративного управления и его влияние на инвестиционную привлекательность эмитента
15. Дивидендная политика компании как фактор ее инвестиционной привлекательности
16. Ключевые тенденции развития мирового рынка ценных бумаг
17. Фондовые кризисы и их идентификация
18. Эффективность деятельности саморегулируемых организаций на рынке ценных бумаг
19. Российский рынок слияний и поглощений в нефтегазовой отрасли
20. Цифровые финансовые активы: экономическая сущность и технологическое содержание
21. Криптовалютный рынок: риски и новые возможности
22. Крауд-технологии как инструмент развития инвестиционного рынка
23. Цифровая трансформация рынка ценных бумаг
24. Новые финансовые инструменты на российском фондовом рынке
25. Организация финансирования венчурного капитала на рынке ценных бумаг

### 6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

#### Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме экзамена

Раздел дисциплины	Вопросы
Фондовый рынок: субъектная структура	<ol style="list-style-type: none"><li>1. Эмитенты на фондовом рынке.</li><li>2. Инвесторы на фондовом рынке.</li><li>3. Брокерская деятельность: виды, брокерские счета, приказы брокеру.</li><li>4. Дилерская деятельность.</li><li>5. Деятельность форекс-дилера.</li><li>6. Деятельность по управлению ценными бумагами.</li><li>7. Клиринговая деятельность.</li><li>8. Деятельность по ведению реестра.</li><li>9. Депозитарная деятельность: виды депозитариев, виды счетов депо.</li><li>10. Деятельность по организации торговли на фондовом рынке.</li><li>11. Репозитарная деятельность</li><li>12. Инвестиционный советник и его функционал.</li><li>13. Фондовая биржа: понятие, классификация.</li><li>14. Методы организации биржевой торговли. Организационная структура фондовой биржи.</li><li>15. Регулирование рынка ценных бумаг: основные элементы системы регулирования и органы регулирования фондового рынка.</li><li>16. Саморегулируемые организации рынка ценных бумаг.</li></ol>

Фондовый рынок: объектная структура	<p>19. Ценная бумага: понятие, основные свойства. Классификация ценных бумаг.</p> <p>20. Акция: понятие и фундаментальные свойства. Дивиденд. Виды акций.</p> <p>21. Стоимостная оценка акции. Доходность акций.</p> <p>22. Облигация: понятие и фундаментальные свойства. Купон и дисконт. Виды облигаций.</p> <p>23. Стоимостная оценка и доходность облигаций.</p> <p>24. Государственные ценные бумаги.</p> <p>25. Депозитарные расписки: понятие, виды, организация выпуска.</p> <p>26. Основная характеристика производных финансовых инструментов.</p> <p>27. Операции РЕПО и обратное РЕПО.</p> <p>28. Фьючерсный контракт: понятие. Фьючерсная цена. Базис. Фьючерсные стратегии.</p> <p>29. Опционные контракты: понятие, виды. Стоимость опциона. Организация опционной торговли.</p> <p>30. Эмиссия ценных бумаг и ее этапы.</p> <p>31. Процедура размещения ценных бумаг. Отличия процедуры IPO и от РО. Достоинства и недостатки процедуры IPO. Сравнительная характеристика биржевого и внебиржевого размещения.</p> <p>32. Фундаментальный и технический анализ рынка ценных бумаг.</p>
--	---

#### 6.6. Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

##### Шкала и критерии оценивания

Оценка	Критерии оценивания для мероприятий контроля с применением 4-х балльной системы
«отлично»	Повышенный УК-3.1, УК-3.2, УК-3.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК- 2.1, ПК-2.2, ПК-2.3
«хорошо»	Стандартный УК-3.1, УК-3.2, УК-3.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК- 2.1, ПК-2.2, ПК-2.3
«удовлетворительно»	Пороговый УК-3.1, УК-3.2, УК-3.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК- 2.1, ПК-2.2, ПК-2.3
«неудовлетворительно»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне