

МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ АВТОНОМНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ ТРАНСПОРТА»

УТВЕРЖДАЮ:

Директор ИЭФ



Ю.И. Соколов

23 мая 2019 г.



Кафедра «Финансы и кредит»

Автор Кочнева Людмила Федоровна, к.т.н., доцент

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Рынок ценных бумаг и биржевое дело

Направление подготовки:	<u>38.03.01 – Экономика</u>
Профиль:	<u>Финансы и кредит</u>
Квалификация выпускника:	<u>Бакалавр</u>
Форма обучения:	<u>очная</u>
Год начала подготовки	<u>2018</u>

<p style="text-align: center;">Одобрено на заседании Учебно-методической комиссии института Протокол № 7 20 мая 2019 г. Председатель учебно-методической комиссии</p>  <p style="text-align: right;">М.В. Ишханян</p>	<p style="text-align: center;">Одобрено на заседании кафедры</p> <p>Протокол № 14 15 мая 2019 г. Заведующий кафедрой</p>  <p style="text-align: right;">З.П. Межох</p>
--	---

Москва 2019 г.

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Целями освоения учебной дисциплины (модуля) «Рынок ценных бумаг и биржевое дело» (РЦБ и БД) являются знание основных понятий фондового рынка, его участников и инструментов, знание свойств базовых и производных инструментов, правил эмиссии, принципов функционирования биржи и видов биржевой деятельности, умение рассчитывать доходность и риски ценных бумаг и операций с ними, а также понимание основных рыночных показателей и индексов, принципов принятия решений, умение оценивать и оптимизировать портфель ценных бумаг, осуществлять мониторинг портфеля, понимать принципы организации биржевой торговли.

2. МЕСТО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОП ВО

Учебная дисциплина "Рынок ценных бумаг и биржевое дело" относится к блоку 1 "Дисциплины (модули)" и входит в его вариативную часть.

2.1. Наименования предшествующих дисциплин

Для изучения данной дисциплины необходимы следующие знания, умения и навыки, формируемые предшествующими дисциплинами:

2.1.1. Информационные технологии в экономике:

Знания: состав и структуру базового и стандартного прикладного программного обеспечения ПК. Иметь представление о принципах обработки информации на ПК под управлением конкретной операционной системы. состав и структуру базового и стандартного прикладного программного обеспечения ПК. Иметь представление о принципах обработки информации на ПК под управлением конкретной операционной системы.

Умения: работать на ПК в среде ОС семейства Windows. работать на ПК в среде ОС семейства Windows.

Навыки: глубокими знаниями по основным приложениям пакета Microsoft Office; глубокими знаниями по основным приложениям пакета Microsoft Office

2.1.2. Финансовая математика:

Знания: основные методы обработки экономических данных; знать принципы сравнения результатов расчетов; знать о прикладных пакетах EXCELL (финансовая функция).

Умения: использовать информационные технологии при решении финансово-экономических задач; уметь производить финансово-экономические расчеты с использованием адекватных инструментальных средств и анализировать полученные результаты; уметь выбрать оптимальный вариант финансового решения.

Навыки: математической базой финансово-экономических расчетов и их интерпретацией; владеть методами решения основных задач финансовой математики, включая обоснование и интерпретацию полученных результатов.

2.2. Наименование последующих дисциплин

Результаты освоения дисциплины используются при изучении последующих учебных дисциплин:

2.2.1. Инвестиции

Знания: • закономерности функционирования современной экономики на макроуровне; • законодательные и нормативные правовые акты, регламентирующие инвестиционную деятельность в РФ; • основные особенности ведущих школ и направлений экономической науки; • основные особенности российской экономики, направления экономической политики государства; • закономерности функционирования современной экономики на макроуровне; • законодательные и нормативные правовые акты, регламентирующие инвестиционную деятельность в РФ; • основные особенности ведущих школ и направлений экономической науки; • основные особенности российской экономики, направления экономической политики государства

Умения: • выявлять проблемы экономического характера при анализе конкретных ситуаций, предлагать способы их решения с учетом критериев социально-экономической эффективности, оценки рисков и возможных социально-экономических последствий; •

анализировать во взаимосвязи экономические явления и инвестиционные процессы; • осуществлять поиск информации по полученному заданию, сбор, анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач; • осуществлять выбор инструментальных средств для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные выводы; • самостоятельно приобретать новые знания по теории инвестирования; • творчески использовать полученные теоретические знания; • прогнозировать на основе стандартных теоретических и эконометрических моделей развитие инвестиционных процессов. • представлять результаты аналитической и исследовательской работы в виде выступления, доклада, информационного обзора, аналитического отчета статьи. • выявлять проблемы экономического характера при анализе конкретных ситуаций, предлагать способы их решения с учетом критериев социально-экономической эффективности, оценки рисков и возможных социально-экономических последствий; • анализировать во взаимосвязи экономические явления и инвестиционные процессы; • осуществлять поиск информации по полученному заданию, сбор, анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач; • осуществлять выбор инструментальных средств для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные выводы; • самостоятельно приобретать новые знания по теории инвестирования; • творчески использовать полученные теоретические знания; • прогнозировать на основе стандартных теоретических и эконометрических моделей развитие инвестиционных процессов. • представлять результаты аналитической и исследовательской работы в виде выступления, доклада, инфо

Навыки: • современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных; • специальной терминологией и лексикой данной дисциплины; • навыками дискуссии по профессиональной тематике; • современными методиками расчета и анализа социально-экономических показателей инвестиционных процессов. • современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных; • специальной терминологией и лексикой данной дисциплины; • навыками дискуссии по профессиональной тематике; • современными методиками расчета и анализа социально-экономических показателей инвестиционных процессов.

3. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ), СООТНЕСЕННЫЕ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

В результате освоения дисциплины студент должен:

№ п/п	Код и название компетенции	Ожидаемые результаты
1	ПК-1 способностью собрать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов	<p>Знать и понимать: способы представления биржевой информации по акциям и облигациям компаний.</p> <p>Уметь: выбрать данные с биржевых торгов, используемые для расчета риска и доходности конкретных ценных бумаг.</p> <p>Владеть: методами расчета доходности и риска инвестиционного портфеля, а также подходами к оптимизации его состава.</p>

4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) В ЗАЧЕТНЫХ ЕДИНИЦАХ И АКАДЕМИЧЕСКИХ ЧАСАХ

4.1. Общая трудоемкость дисциплины составляет:

7 зачетных единиц (252 ак. ч.).

4.2. Распределение объема учебной дисциплины на контактную работу с преподавателем и самостоятельную работу обучающихся

Вид учебной работы	Количество часов		
	Всего по учебному плану	Семестр 5	Семестр 6
Контактная работа	102	54,15	48,15
Аудиторные занятия (всего):	102	54	48
В том числе:			
лекции (Л)	68	36	32
лабораторные работы (ЛР)(лабораторный практикум) (ЛП)	34	18	16
Самостоятельная работа (всего)	96	54	42
Экзамен (при наличии)	54	0	54
ОБЩАЯ трудоемкость дисциплины, часы:	252	108	144
ОБЩАЯ трудоемкость дисциплины, зач.ед.:	7.0	3.0	4.0
Текущий контроль успеваемости (количество и вид текущего контроля)	КР (1), ПК1, ПК2	ПК1, ПК2	КР (1), ПК1, ПК2
Виды промежуточной аттестации (экзамен, зачет)	ЗЧ, ЭК	ЗЧ	ЭК

4.3. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам)

№ п/п	Семестр	Тема (раздел) учебной дисциплины	Виды учебной деятельности в часах/ в том числе интерактивной форме						Формы текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации	
			Л	ЛР	ПЗ	КСР	СР	Всего		
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	
1	5	Раздел 1 Фондовый рынок: участники, инструменты, регулирование Цели ФР, законодательные основы, виды участников, определение и классификация ЦБ, индексы рынка.	16	6/6				20	42/6	ПК1
2	5	Раздел 2 Основные ЦБ, их свойства Акции, корпоративные и гособлигации, вексель, чек и др., виды, свойства, основные расчетные показатели, риски и оценка доходности. Рейтинг ЦБ	8	6/6				25	39/6	ПК2
3	5	Раздел 3 Инвестиционный портфель Определение, виды, риски, доходность. Теория Г. Марковица, диверсификация, модель САРМ	12	6/6				9	27/6	
4	5	Зачет						0		ЗЧ
5	6	Раздел 5 Производные ЦБ Производные ЦБ	12	6/6				5	23/6	ПК1
6	6	Раздел 6 Биржа – организатор торговли Организационное строение, виды биржевой деятельности, регулирование, механизм торговли	8	6/6				5	19/6	
7	6	Раздел 7	10	4/4				32	46/4	ПК2

№ п/п	Семестр	Тема (раздел) учебной дисциплины	Виды учебной деятельности в часах/ в том числе интерактивной форме						Формы текущего контроля успеваемости и промежу-точной аттестации
			Л	ЛР	ПЗ	КСР	СР	Всего	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
		Фундаментальный и технический анализ Фундаментальный анализ, постулаты технического анализа. Тренды, фигуры, осцилляторы и индикаторы							
8	6	Раздел 8 Мировые фондовые биржи	2					2	
9	6	Раздел 9 Курсовая работа						0	КР
10	6	Экзамен						54	ЭК
11		Всего:	68	34/34			96	252/34	

4.4. Лабораторные работы / практические занятия

Практические занятия учебным планом не предусмотрены.

Лабораторные работы предусмотрены в объеме 34 ак. ч.

№ п/п	№ семестра	Тема (раздел) учебной дисциплины	Наименование занятий	Всего часов/ из них часов в интерактивной форме
1	2	3	4	5
1	5	РАЗДЕЛ 1 Фондовый рынок: участники, инструменты, регулирование	Графическое представление ценовой информации.	6 / 6
2	5	РАЗДЕЛ 2 Основные ЦБ, их свойства	Расчет рыночных показателей по ценным бумагам	6 / 6
3	5	РАЗДЕЛ 3 Инвестиционный портфель	Оценка инвестиционного портфеля	6 / 6
4	6	РАЗДЕЛ 5 Производные ЦБ	Тренды, фигуры графиков, индикаторы, осцилляторы, индекс рынка	6 / 6
5	6	РАЗДЕЛ 6 Биржа – организатор торговли	Индикатор скользящая средняя. «Аллигатор» Вильямса	6 / 6
6	6	РАЗДЕЛ 7 Фундаментальный и технический анализ	6. Расчеты по фьючерсам. Основные опционные стратегии	4 / 4
ВСЕГО:				34 / 34

4.5. Примерная тематика курсовых проектов (работ)

Курсовая с индивидуальными ценовыми данными для расчетов (прилагаются в методических указаниях и в приложении):

Примерные варианты курсовых (номера компаний из ценовых данных для анализа)

1 вариант: 1,2,3,4,5

2 вариант: 2,3,4,5,6

3 вариант: 3,4,5,6,7

4 вариант: 4,5,6,7,8

5 вариант: 5,6,7,8,9

6 вариант: 6,7,8,9,10

7 вариант: 7,8,9,10,11

8 вариант: 8,9,10,11,12

9 вариант: 9,10,11,12,13

10 вариант: 10,11,12,13,14

11 вариант: 11,12,13,14,15

12 вариант: 12,13,14,15,16

13 вариант: 13,14,15,16,17

14 вариант: 2,4,6,8,10

15 вариант: 4,6,8,10,12

16 вариант: 3,5,7,9,11

17 вариант: 5,7,9,11,13

18 вариант: 8,10,12,18,16

19 вариант: 10,12,14,16,1

20 вариант: 7,9,11,13,18

21 вариант: 9,11,13,15,17

22 вариант: 1,2,3, 12,18

23 вариант: 5,7,8, 13,15

24 вариант: 4,9,10,15,16

25 вариант: 12,15,3,7,16

5. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

Преподавание дисциплины осуществляется в форме лекционных и практических занятий. Лекции проводятся в традиционной классно-урочной организационной форме, по типу управления познавательной деятельности являются классическо-лекционными (объяснительно-иллюстративными).

Практические занятия организованы с использованием технологий развивающего обучения. Практический курс выполняется в виде традиционных практических занятий (объяснительно-иллюстративное решение задач), с использованием интерактивных (диалоговые) технологий, в том числе разбор и анализ конкретных ситуаций, электронный практикум (компьютерное моделирование и практический анализ результатов); технологий, основанных на коллективных способах обучения, а также с использованием компьютерной тестирующей системы.

Самостоятельная работа студента организована с использованием традиционных видов работы и интерактивных технологий. К традиционным видам работы относятся отработка учебного материала и отработка отдельных тем по учебным пособиям, подготовка к промежуточным контролям, выполнение заданий курсовой работы. К интерактивным (диалоговым) технологиям относятся отработка отдельных тем по электронным пособиям, подготовка к промежуточным контролям в интерактивном режиме, интерактивные консультации в режиме реального времени по специальным разделам и технологиям, основанным на коллективных способах самостоятельной работы студентов. Оценка полученных знаний, умений и навыков основана на модульно-рейтинговой технологии. Весь курс разбит на разделы, представляющих собой логически завершенный объем учебной информации. Фонды оценочных средств освоенных компетенций включают как вопросы теоретического характера для оценки знаний, так и задания практического содержания (решение практических и ситуационных задач, выполнение заданий курсовой работы) для оценки умений и навыков. Теоретические знания проверяются путём применения таких организационных форм, как индивидуальные и групповые опросы, решение тестов с использованием компьютеров или на бумажных носителях.

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДЛЯ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

№ п/п	№ семестра	Тема (раздел) учебной дисциплины	Вид самостоятельной работы студента. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы	Всего часов
1	2	3	4	5
1	5	РАЗДЕЛ 1 Фондовый рынок: участники, инструменты, регулирование	Проработка учебного материала	20
2	5	РАЗДЕЛ 2 Основные ЦБ, их свойства	Проработка учебного материала	25
3	5	РАЗДЕЛ 3 Инвестиционный портфель	Проработка учебного материала;	9
4	6	РАЗДЕЛ 5 Производные ЦБ	Проработка учебного материала;	5
5	6	РАЗДЕЛ 6 Биржа – организатор торговли	Проработка учебного материала;	5
6	6	РАЗДЕЛ 7 Фундаментальный и технический анализ	Проработка учебного материала, ознакомление с эмпирическим материалом	32
ВСЕГО:				96

7. ПЕРЕЧЕНЬ ОСНОВНОЙ И ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

7.1. Основная литература

№ п/п	Наименование	Автор (ы)	Год и место издания Место доступа	Используется при изучении разделов, номера страниц
1	Рынок ценных бумаг: учебник для академического бакалавриата	Под общ. ред. Н.И. Берзона	М.: Издательство Ю-райт, 2017 https://biblio-online.ru/book/FD95EEE2-F5E2-4D19-9EF7-A9AE2F8F8A1A	Все разделы
2	Рынок ценных бумаг и биржевое дело: фундаментальный анализ: Учебное пособие.	Кочнева Л.Ф., Коришева О.В.	М.: МГУПС (МИИТ), 2016 Кафедральная библиотека	Все разделы
3	Рынок ценных бумаг и биржевое дело: технический анализ: Учебное пособие.	Кочнева Л.Ф., Коришева О.В.	М.: МГУПС (МИИТ), 2016 Кафедральная библиотека	Все разделы
4	Рынок ценных бумаг и биржевое дело: Учебно-методическое пособие.	Коришева О.В.	М.: МГУПС (МИИТ), 2016 Кафедральная библиотека	Все разделы

7.2. Дополнительная литература

№ п/п	Наименование	Автор (ы)	Год и место издания Место доступа	Используется при изучении разделов, номера страниц
5	Тесты по курсу ценных бумаг	Ильин П.В.	М. Статистика, 2006 http://www.edu.ru/	стр.178
6	Рынок ценных бумаг	Кочнева Л.Ф. (электронный контент)	0 ntbs-miit.ru:9999	Все разделы
7	ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ И ИНСТИТУТЫ. Учебник и практикум для академического бакалавриата	Гусева И.А.	М.: Издательство Ю-райт, 2017 https://biblio-online.ru/book/B67C321B-4E55-4A91-9ED4-49BB2AFDD4E6	Все разделы
8	РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ 5-е изд., пер. и доп. Учебник для академического бакалавриата	Чалдаева Л.А., Килячков А.А.	М.: Издательство Ю-райт, 2017 https://biblio-online.ru/book/1B8382D5-954B-45C7-BCFE-D422BD97B662	341 с.

8. ПЕРЕЧЕНЬ РЕСУРСОВ ИНФОРМАЦИОННО-ТЕЛЕКОММУНИКАЦИОННОЙ СЕТИ "ИНТЕРНЕТ", НЕОБХОДИМЫЕ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

http://miit-ief.ru/student/methodical_literature/ (Электронная библиотека ИЭФ)

<http://library.miit.ru> (НТБ МИИТа (электронно-библиотечная система))

<https://www.biblio-online.ru> (Электронная библиотечная система «Юрайт», доступ для студентов и преподавателей РУТ(МИИТ))

<http://e.lanbook.com> (Электронно-библиотечная система «Лань», доступ для студентов и преподавателей РУТ(МИИТ))

<https://www.book.ru/> (ЭБС book.ru – доступ для преподавателей и студентов РУТ(МИИТ))

<http://www.knigafund.ru/> (Электронная библиотечная система «Книгафонд», доступ для студентов и преподавателей ИЭФ РУТ(МИИТ))

9. ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ИНФОРМАЦИОННЫХ СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

При осуществлении образовательного процесса по дисциплине требуется наличие следующего ПО: OS Windows, Microsoft Office, система компьютерного тестирования АСТ.

В образовательном процессе применяются следующие информационные технологии: персональные компьютеры; компьютерное тестирование; мультимедийное оборудование; средства коммуникаций: ЭИОС РУТ(МИИТ) и/или электронная почта.

10. ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

Для успешного проведения аудиторных занятий необходим стандартный набор специализированной учебной мебели и учебного оборудования. Для проведения лекционных занятий необходима специализированная лекционная аудитория с мультимедиа аппаратурой.

Для организации самостоятельной работы студентов необходима аудитория с рабочими местами, обеспечивающими выход в Интернет. Необходим доступ каждого студента к информационным ресурсам – институтскому библиотечному фонду и сетевым ресурсам Интернет.

11. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Для успешного освоения дисциплины следует придерживаться следующей методики:

- при подготовке к очередному занятию изучить содержание конспекта лекций по предыдущему материалу, а также содержание учебной и учебно-методической литературы по соответствующему разделу;
- при подготовке к лабораторной работе изучить рекомендованный теоретический материал и разобрать предложенные задачи;
- выполнить задачи для самостоятельного решения;
- подготовить ответы на заданные тестовые вопросы.