

МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ АВТОНОМНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ ТРАНСПОРТА»
(РУТ (МИИТ))



Рабочая программа дисциплины (модуля),
как компонент образовательной программы
высшего образования - программы бакалавриата
по направлению подготовки
38.03.01 Экономика,
утвержденной первым проректором РУТ (МИИТ)
Тимониным В.С.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Рынок ценных бумаг и биржевое дело

Направление подготовки: 38.03.01 Экономика

Направленность (профиль): Финансы и кредит

Форма обучения: Очно-заочная

Рабочая программа дисциплины (модуля) в виде
электронного документа выгружена из единой
корпоративной информационной системы управления
университетом и соответствует оригиналу

Простая электронная подпись, выданная РУТ (МИИТ)
ID подписи: 2699
Подписал: заведующий кафедрой Межох Зоя Павловна
Дата: 06.05.2022

1. Общие сведения о дисциплине (модуле).

Целями освоения учебной дисциплины являются получение знаний, умений и навыков в области рынка ценных бумаг и биржевого дела.

Задачами освоения дисциплины является формирование у обучающихся: знаний основных понятий фондового рынка, его участников и инструментов, знаний свойств базовых и производных инструментов, правил эмиссии, принципов функционирования биржи и видов биржевой деятельности, умений рассчитывать доходность и риски ценных бумаг и операций с ними, а также понимания основных рыночных показателей и индексов, принципов принятия решений, умения оценивать и оптимизировать портфель ценных бумаг, осуществлять мониторинг портфеля, понимать принципы организации биржевой торговли.

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю).

Перечень формируемых результатов освоения образовательной программы (компетенций) в результате обучения по дисциплине (модулю):

ПК-1 - Способен рассчитывать, анализировать и интерпретировать информацию, необходимую для выявления тенденций в функционировании и развитии финансового сектора и хозяйствующих субъектов с применением современных цифровых инструментов;

ПК-2 - Способен находить решения профессиональных задач в меняющихся финансово-экономических условиях.

Обучение по дисциплине (модулю) предполагает, что по его результатам обучающийся будет:

Знать:

- теоретические основы рынка ценных бумаг и биржевого дела;
- математические методы для решения экономических задач;
- основные пакеты прикладных программ для решения оптимизационных задач;
- методику получения ценовой информации с фондового рынка.

Уметь:

- правильно интерпретировать требования законов и нормативных актов;
- применять аналитические методы для расчета биржевых показателей;
- анализировать ценовую информацию методами технического анализа ценных бумаг;
- использовать пакеты программ для графического и аналитического

сопровождения принятия финансового решения относительно покупки-продажи ценных бумаг.

Владеть:

- методами анализа и расчета экономических показателей для подготовки принятия финансовых решений по вопросам, связанным с выпуском, покупкой и продажей ценных бумаг;
- расчетным финансово-математическим инструментарием и методами оптимизации;
- современные методы и инструменты управления ценными бумагами;
- элементами пакета специальных программ по обработке, иллюстрации биржевой информации, управлению ценными бумагами.

3. Объем дисциплины (модуля).

3.1. Общая трудоемкость дисциплины (модуля).

Общая трудоемкость дисциплины (модуля) составляет 8 з.е. (288 академических часа(ов)).

3.2. Объем дисциплины (модуля) в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении учебных занятий:

Тип учебных занятий	Количество часов		
	Всего	Семестр	
		№6	№7
Контактная работа при проведении учебных занятий (всего):	64	32	32
В том числе:			
Занятия лекционного типа	32	16	16
Занятия семинарского типа	32	16	16

3.3. Объем дисциплины (модуля) в форме самостоятельной работы обучающихся, а также в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении промежуточной аттестации составляет 224 академических часа (ов).

3.4. При обучении по индивидуальному учебному плану, в том числе при ускоренном обучении, объем дисциплины (модуля) может быть реализован

полностью в форме самостоятельной работы обучающихся, а также в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении промежуточной аттестации.

4. Содержание дисциплины (модуля).

4.1. Занятия лекционного типа.

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
1	Фондовый рынок: участники, инструменты, регулирование. Рассматриваемые вопросы: - цели, функции, задачи фондового рынка; - законодательные основы; - виды участников, их функции; - определение и классификация ценных бумаг, и свойства; - индексы рынка.
2	Эмиссия ценных бумаг. Рассматриваемые вопросы: - понятие эмиссии, цели; - эмиссионные ценные бумаги; - участники эмиссии; - андеррайтер, его функции, задачи; - порядок эмиссии.
3	Основные ЦБ, их свойства. Рассматриваемые вопросы: - акции, их свойства, виды, основные расчетные показатели; - корпоративные и гособлигации, их свойства, виды, основные расчетные показатели; - вексель, их свойства, виды, основные расчетные показатели; - чек, варрант и другие виды ценных бумаг, свойства, основные расчетные показатели; - риски и оценка доходности; - рейтинг ценных бумаг.
4	Фундаментальный и технический анализ. Рассматриваемые вопросы: - фундаментальный анализ, его назначение и содержание; - постулаты технического анализа и методы; - тренды, фигуры, осцилляторы и индикаторы.
5	Инвестиционный портфель. Рассматриваемые вопросы: - определение, виды, риски, доходность; - теория Г. Марковица; - диверсификация.
6	Производные ценные бумаги и финансовые инструменты. Рассматриваемые вопросы: - ДР, фьючерсы, опционы, варранты, права – виды, свойства; - ценообразование; - хеджирование.
7	Биржа – организатор торговли. Рассматриваемые вопросы:

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
	- организационное строение, виды биржевой деятельности; - регулирование, механизм торговли; - профессиональные участники.
8	Паевые инвестиционные фонды. Рассматриваемые вопросы: - принципы работы паевых инвестиционных фондов; - классификация ПИФов; - фонды коллективного инвестирования.

4.2. Занятия семинарского типа.

Практические занятия

№ п/п	Тематика практических занятий/краткое содержание
1	Графическое представление ценовой информации. В результате выполнения практического задания студент получает навык изображения ценовой информации в графическом виде, получает умение описать изменение цены по графическим изображениям котировок.
2	Расчет рыночных показателей по ценным бумагам. В результате выполнения практического задания студент получает навык применения математических методов для решения экономических задач; получает навык расчета биржевых показателей по основным видам ценных бумаг.
3	Тренды, фигуры графиков, индикаторы, осцилляторы, индекс рынка. В результате выполнения практического задания студент получает навык анализировать ценовую информацию методами технического анализа ценных бумаг; знание основных методов технического анализа, а также умение рассчитывать индексы рынка.
4	Оценка инвестиционного портфеля. В результате выполнения практического задания студент получает навык использовать пакеты программ для аналитического сопровождения принятия финансового решения относительно покупки-продажи ценных бумаг, а также навык применения финансово-математического инструментария и методов оптимизации при работе с инвестиционным портфелем ценных бумаг.
5	Индикатор скользящая средняя. «Аллигатор» Вильямса. В результате выполнения практического задания студент получает навык анализировать ценовую информацию методами технического анализа ценных бумаг; знание использования «Аллигатора Вильямса» для прогнозирования цен.
6	Расчеты по фьючерсам. Основные опционные стратегии. В результате выполнения практического задания студент получает навык применения финансово-математического инструментария и методов оптимизации при работе с ценными бумагами.

4.3. Самостоятельная работа обучающихся.

№ п/п	Вид самостоятельной работы
1	Подготовка к защите курсовой работы
2	Подготовка к лабораторным занятиям
3	Работа с лекционным материалом
4	Работа с литературой

5	Выполнение курсовой работы.
6	Подготовка к промежуточной аттестации.
7	Подготовка к текущему контролю.

4.4. Примерный перечень тем курсовых работ

В течение семестра студент выполняет курсовую работу по теме «Инвестиционный портфель». «Инвестиционный портфель» - курсовая с индивидуальными ценовыми данными для расчетов. Исходные данные с котировками выдаются студентам. Цель курсовой работы состоит в составлении, управлении и оценке эффективности инвестиционного портфеля ценных бумаг на примере пяти компаний, акции которых котируются на бирже. Каждому варианту устанавливается тип инвестора в соответствии с которым будет составляться и анализироваться портфель ценных бумаг. В процессе управления портфелем необходимо применить теорию Гарри Марковица, а также аналитический модуль Excel «Поиск решения». В анализе курсовой работы необходимо отразить полученные в процессе изучения дисциплины навыки и компетенции.

5. Перечень изданий, которые рекомендуется использовать при освоении дисциплины (модуля).

№ п/п	Библиографическое описание	Место доступа
1	Рынок ценных бумаг : учебник для вузов / Н. И. Берзон [и др.] ; под общей редакцией Н. И. Берзона. — 5-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 514 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-11196-5.	https://urait.ru/bcode/449663 (дата обращения: 03.02.2022). - Текст: электронный.
2	Коришева О.В. Рынок ценных бумаг и биржевое дело: фундаментальный анализ: Учебное пособие. М.: РУТ (МИИТ), 2021. – 51 с.	НТБ РУТ(МИИТ): http://library.miit.ru/ (дата обращения: 03.02.2022). - Текст: электронный.
3	Коришева О.В. Рынок ценных бумаг и биржевое дело: технический анализ: Учебное пособие. М.: РУТ (МИИТ), 2021. – 69 с.	НТБ РУТ(МИИТ): http://library.miit.ru/ (дата обращения: 03.02.2022). - Текст: электронный.
4	Коришева О.В. Рынок ценных бумаг: учебно-методическое пособие. М.: РУТ (МИИТ). – 2020. – 95 с	НТБ РУТ(МИИТ): http://library.miit.ru/ (дата обращения: 03.02.2022). - Текст: электронный.
5	Коришева О.В. Рынок ценных бумаг: Учебно-методическое пособие. – М.: РУТ (МИИТ), 2018. – 46 с.	НТБ РУТ(МИИТ): http://library.miit.ru/ (дата обращения: 03.02.2022). - Текст: электронный.

6	Гусева, И. А. Финансовые рынки и институты: учебник и практикум для вузов / И. А. Гусева. — Москва : издательство Юрайт, 2022. — 347 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00339-0.	https://urait.ru/bcode/489743 (дата обращения: 03.02.2022). - Текст: электронный.
---	---	--

6. Перечень современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем, которые могут использоваться при освоении дисциплины (модуля).

Научно-техническая библиотека РУТ (МИИТ): <http://library.miit.ru>

Федеральная служба государственной статистики: <https://rosstat.gov.ru/>

Официальный сайт Международного валютного фонда: <https://www.imf.org/>

Официальный сайт Банка России: <https://www.cbr.ru/>

Финансовый портал «Финам.ру»: <https://www.finam.ru/>

Консультант (Федеральные законы) <http://www.consultant.ru/>

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

7. Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства, необходимого для освоения дисциплины (модуля).

Офисный пакет приложений Microsoft Office

8. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю).

лекция – мультимедиа, лабораторные работы – компьютерный класс Для проведения лекционных занятий необходима аудитория с мультимедиа аппаратурой. Для проведения лабораторных работ требуется аудитория, оснащенная мультимедиа аппаратурой и ПК с необходимым программным обеспечением и подключением к сети интернет.

9. Форма промежуточной аттестации:

Зачет в 6 семестре.

Курсовая работа в 7 семестре.

Экзамен в 7 семестре.

10. Оценочные материалы.

Оценочные материалы, применяемые при проведении промежуточной

аттестации, разрабатываются в соответствии с локальным нормативным актом РУТ (МИИТ).

Авторы

Доцент, доцент, к.н. кафедры
«Финансы и кредит»

Коришева Ольга
Викторовна

Лист согласования

Заведующий кафедрой ФК

З.П. Межох

Председатель учебно-методической
комиссии

М.В. Ишханян