Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Крылова Людмила Вячеславовна
Должность: Проректор по учебно-методической работе
Дата подписания: 07.11.2026 21:08:02
Уникальный программный ключ:
b066544bae1e449cd8bfce392f7224a676a271b2

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ «ДОНЕЦКИЙ НАЦИОНАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ЭКОНОМИКИ И ТОРГОВЛИ ИМЕНИ МИХАИЛА ТУГАН-БАРАНОВСКОГО»

КАФЕДРА ФИНАНСОВ И ЭКОНОМИЧЕСКОЙ БЕЗОПАСНОСТИ

УТВЕРЖДАЮ:
Проректор по учебно-методической работе
_____ Л. В. Крылова
(подпись) (инициалы, фамилия)
«_28_» _____02_____ 2024 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.ДВ.01.02 РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ
(шифр, название учебной дисциплины в соответствии с учебным планом)

Укрупненная группа направлений подготовки 38.00.00 Экономика и управление

Программа высшего образования – программа бакалавриата

Специальность 38.03.01 Экономика

Профиль Финансы и кредит

Институт учета и финансов

Форма обучения, курс:
очная форма обучения, 4 курс
очно-заочная форма обучения, 4 курс

Рабочая программа адаптирована для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Донецк
2024

Рабочая программа учебной дисциплины «Рынок ценных бумаг» для обучающихся по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, профилю: Финансы и кредит, разработанная в соответствии с учебным планом, утвержденным Ученым советом ФГБОУ ВО «ДОННУЭТ»:
– в 2024 г. – для заочной формы обучения.
– в 2024 г. – для очно-заочной формы обучения.

Разработчик: Малецкий Антон Викторович, доцент кафедры финансов и экономической безопасности, кандидат экономических наук, доцент

Рабочая программа утверждена на заседании кафедры финансов и экономической безопасности
Протокол от «_21_» ____02_____ 2024 года № __21_
Зав. кафедрой финансов и экономической безопасности

_____ Л. А. Омельянович
(подпись) (инициалы, фамилия)

СОГЛАСОВАНО:
Директор института учета и финансов

_____ Л.И. Тымчина
(подпись) (инициалы, фамилия)

«_26_» ____02_____ 2024 года

ОДОБРЕНО
Учебно-методическим советом ФГБОУ ВО «ДОННУЭТ»
Протокол от «_28_» ____02_____ 2024 года № _7_

Председатель_____ Л. В. Крылова
(подпись) (инициалы, фамилия)

© Малецкий А.В., 2024 год
© Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Донецкий национальный университет экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского», 2024 год

1. ОПИСАНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

<table>
<tr><td rowspan="2">Наименование показателя</td><td rowspan="2">Наименование укрупненной группы направлений подготовки / специальностей, направление подготовки / специальность, профиль / магистерская программа / специализация, программа высшего образования</td><td colspan="2">Характеристика учебной дисциплины</td></tr>
<tr><td>очная форма обучения</td><td>очно-заочная форма обучения</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Количество зачетных единиц – 3</td><td>Укрупненная группа направлений подготовки 38.00.00 Экономика и управление</td><td colspan="2" rowspan="2">Вариативная</td></tr>
<tr><td>Направление подготовки: 38.03.01 Экономика</td></tr>
<tr><td>Модулей – 1</td><td rowspan="6">Профиль: Финансы и кредит</td><td colspan="2">Год подготовки:</td></tr>
<tr><td>Смысловых модулей – 2</td><td>4-й</td><td>5-й</td></tr>
<tr><td rowspan="5">Общее количество часов – 108</td><td colspan="2">Семестр:</td></tr>
<tr><td>8-й</td><td>10-й</td></tr>
<tr><td colspan="2">Лекции</td></tr>
<tr><td>12 час.</td><td>10 час.</td></tr>
<tr><td rowspan="11">Количество часов в неделю для очной формы обучения:
аудиторных –
самостоятельной работы обучающегося –</td><td rowspan="11">Программа высшего образования – программа бакалавриата</td><td colspan="2">Практические, семинарские занятия</td></tr>
<tr><td>24 час.</td><td>10 час.</td></tr>
<tr><td colspan="2">Лабораторные работы</td></tr>
<tr><td>-</td><td>-</td></tr>
<tr><td colspan="2">Самостоятельная работа</td></tr>
<tr><td>66 час.</td><td>81,6 час.</td></tr>
<tr><td colspan="2">Индивидуальные задания[1]</td></tr>
<tr><td>2 ТМК
4 час.</td><td>2 ТМК
5 час.</td></tr>
<tr><td colspan="2">Форма промежуточной аттестации</td></tr>
<tr><td>Экзамен
2 час.</td><td>Экзамен
2,4</td></tr>
</table>

* для очной формы обучения указывается количество проводимых текущих модульных контролей (например, 2ТМК), при наличии – курсовая работа/проект (КР/КП)

для заочной формы обучения указывается, при наличии, аудиторная письменная работа/контрольная работа (АПР), курсовая работа/проект (КР/КП)

Соотношение количества часов аудиторных занятий и самостоятельной работы составляет:
для очной формы обучения – 36 / 66
для очно-заочной формы обучения – 20 / 81,6

2. ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель учебной дисциплины: сформировать у студентов целостные представления о теории и практике финансовых расследований. Выработать умения, навыки, профессиональную и гражданскую ответственность по принятию решений в сфере финансовых расследований. Научить студентов применять знания о современных типологиях и особенностях финансовых расследований.

Задачи учебной дисциплины: формирование теоретических знаний в области финансовых расследований; изучение законодательных основ финансовых расследований; раскрытие специфических особенностей видов финансовых преступлений и их расследования; изучение основ информационно-аналитического обеспечения предупреждения, выявления, пресечения, раскрытия и расследования финансовых, банковских, таможенных и налоговых преступлений; рассмотрение превентивных и восстановительных мер нейтрализации значимых угроз типового объекта информационной безопасности; формирование знаний, умений и навыков, связанных с выяснением подходов к решению проблем, возникающих при назначении и производстве экспертиз в процессе раскрытия, расследования и предотвращения преступлений.

3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП ВО

Учебная дисциплина Б1.В.ДВ.01.02 «Рынок ценных бумаг» относится к вариативной части ООП ВО.

Связь с другими дисциплинами учебного плана:

- перечень действующих и - перечень действующих и предшествующих дисциплин: «Финансы», «Деньги, кредит, банки», «Мировая экономика»; «Финансовые вычисления»;

- перечень теоретических дисциплин и практик, для которых освоение данной дисциплины необходимо как предшествующее: «Статистика», «Методы оптимальных решений», «Государственные и муниципальные финансы».

4. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ), СООТНЕСЕННЫХ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

В результате освоения учебной дисциплины у обучающегося должны быть сформированы компетенции и индикаторы их достижения:

Код и наименование компетенции	*Код и наименование индикатора достижения компетенции*
ПК-5. Способен проводить мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков	ИД-1$_{ПК-5}$ Проводит исследования финансового рынка и изучает предложения финансовых услуг (в том числе действующих правил и условий, тарифной политики и действующих форм документации) ИД-2$_{ПК-5}$ Осуществляет мониторинг информационных источников финансовой информации

В результате изучения учебной дисциплины обучающийся должен:

знать: закономерности развития рынка ценных бумаг; функции и принципы организации деятельности профессиональными участниками рынка ценных бумаг; статистические показатели, используемые на рынке ценных бумаг для оценки динамики его развития; виды ценных бумаг, принципы их выпуска и обращения, а также закономерности выбора компанией источника финансирования в зависимости от стадии жизненного цикла компании и цикла развития рынка ценных бумаг; правила регулирования рынка ценных бумаг, функции государственного регулятора рынка ценных бумаг и саморегулируемых организаций.

уметь: обобщать и систематизировать информацию, характеризующую деятельность компаний на рынке ценных бумаг; анализировать основные показатели результатов торгов ценными бумагами на фондовой бирже с использование информации, представленной на сайтах фондовых бирж, рейтинговых агентств и инвестиционных компаний; использовать для выполнения аналитических заданий современные технические средства и информационные технологии; оценивать условия и последствия принимаемых управленческих решений на рынке ценных бумаг по привлечению и размещению капитала; анализировать основные финансовые показатели, характеризующие ценные бумаги.

владеть: методологией экономического исследования на макроуровне; методами планирования проведения научного исследования и совокупностью способов и приемов в области исследования методов и инструментов валютного регулирования; навыками применения инструментов сравнительного и ситуационного анализа.

5. ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

МОДУЛЬ 1. РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ

Смысловой модуль 1. Общие основы функционирования рынка ценных бумаг.

Тема 1. Рынок ценных бумаг: сущность, функции и роль в экономике.

Тема 2. Профессиональные участники рынка ценных бумаг.

Тема 3. Система регулирования рынка ценных бумаг.

Тема 4. Эмиссия и обращение ценных бумаг.

Смысловой модуль 2. Организация деятельности рынка ценных бумаг.

Тема 5. Рынок долгового капитала.

Тема 6. Рынок акций.

Тема 7. Рынок производных ценных бумаг.

Тема 8. Международные рынки капитала.

Тема 9. Государственные ценные бумаги.

Тема 10. Модели анализа и прогнозирования доходности и риска ценных бумаг.

6. СТРУКТУРА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Названия смысловых модулей и тем	Количество часов											
	очная форма обучения						очно-заочная форма обучения					
	Всего	в том числе					Всего	в том числе				
		л[1]	п[2]	лаб[3]	инд[4]	СРС[5]		л	п	лаб	инд	СРС
1	*2*	*3*	*4*	*5*	*6*	*7*	*8*	*9*	*10*	*11*	*12*	*13*
МОДУЛЬ 1. МЕЖДУНАРОДНЫЕ ФИНАНСОВЫЕ АКТИВЫ												
Смысловой модуль 1. Общие основы функционирования рынка ценных бумаг												
Тема 1. Рынок ценных бумаг: сущность, функции и роль в экономике	7,4	1	2	-		4,4	7,7	1	1	-	-	5,7
Тема 2. Профессиональные участники рынка ценных бумаг.	7,4	1	2	-		4,4	7,7	1	1	-	-	5,7
Тема 3. Система регулирования рынка ценных бумаг.	7,4	1	2	-		4,4	7,7	1	1	-	-	5,7
Тема 4. Эмиссия и обращение ценных бумаг.	7,4	1	2	-		4,4	7,7	1	1	-	-	5,7
Всего по смысловому модулю 1	***29,6***	***4***	***8***	***-***	***-***	***17,6***	***30,8***	4	4	-	-	22,8

Смысловой модуль 2. Организация деятельности рынка ценных бумаг												
Тема 5. Рынок долгового капитала.	7,5	1	2	-		4,5	7,7	1	1	-	-	5,7
Тема 6. Рынок акций.	7,5	1	2	-		4,5	7,7	1	1	-	-	5,7
Тема 7. Рынок производных ценных бумаг	9,5	1	4	-		4,5	7,7	1	1	-	-	5,7
Тема 8. Международные рынки капитала	6,5	1	2	-		3,5	7,7	1	1	-	-	5,7
Тема 9. Государственные ценные бумаги	7,4	2	2	-		3,4	7,7	1	1	-	-	5,7
Тема 10. Модели анализа и прогнозирования доходности и риска ценных бумаг	9,4	2	4	-		3,4	7,7	1	1	-	-	5,7
Всего по смысловому модулю 2	**47,8**	**8**	***16***	-		26,8	46,2	6	6	-	-	34,3
Всего часов	**80,4**	**12**	**24**	**-**		**41,4**	**77**	**10**	**10**	**-**	**-**	**57**
Катт	**2,6**	**-**	**-**	**-**	**2,6**	**-**	**3**			**-**	**3**	**-**
СРэк	**24,6**	**-**	**-**	**-**	**24,6**		**24,6**			**-**	**24,6**	**-**
ИК	**1**	**-**	**-**	**-**	**1**	**-**	**1**			**-**	**1**	**-**
КЭ	**2**	**-**	**-**	**-**	**2**	**-**	**2**			**-**	**2**	**-**
Каттэк	**0,4**	**-**	**-**	**-**	**0,4**	**-**	**0,4**			**-**	**0,4**	**-**
Контроль	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**			**-**	**-**	**-**
Всего часов	**108**	**12**	**24**	**-**	**30,6**	**41,4**	**108**	**10**	**10**	**-**	**31**	**57**

Примечания: Лек – лекции, Лаб – лабораторные занятия, Пр – практические занятия, ИК – индивидуальные консультации, Катт – контактная работа на аттестацию в период теоретического обучения, в период прохождения практик, СР – самостоятельная работа, КЭ – консультации экзаменационные, Каттэк – контактная работа на аттестацию в период экзаменационной сессии и итоговой аттестации

7. ТЕМЫ СЕМИНАРСКИХ И ПРАКТИЧЕСКИХ ЗАНЯТИЙ

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	очно-заочная форма
1	*2*	*3*	*4*
Смысловой модуль 1. Общие основы функционирования рынка ценных бумаг			
1	**Тема 1.** Рынок ценных бумаг: сущность, функции и роль в экономике.	2	1
2	**Тема 2.** Профессиональные участники рынка ценных бумаг.	2	1
3	**Тема 3.** Система регулирования рынка ценных бумаг.	2	1
4	**Тема 4.** Эмиссия и обращение ценных бумаг.	2	1
Смысловой модуль 2. Организация деятельности рынка ценных бумаг			
5	**Тема 5.** Рынок долгового капитала.	2	1
6	**Тема 6.** Рынок акций.	2	1
7	**Тема 7.** Рынок производных ценных бумаг.	4	1
8	**Тема 8.** Международные рынки капитала.	2	1
9	**Тема 9.** Государственные ценные бумаги.	2	1
10	**Тема 10.** Модели анализа и прогнозирования доходности и риска ценных бумаг.	4	1
	ВСЕГО	**24**	**10**

8. ТЕМЫ ЛАБОРАТОРНЫХ ЗАНЯТИЙ – не предусмотрены

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	очно-заочная форма
1	*2*	*3*	*4*

9. САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	очно-заочная форма
1	*2*	*3*	*4*
Смысловой модуль 1. Общие основы функционирования рынка ценных бумаг			
1	**Тема 1.** Рынок ценных бумаг: сущность, функции и роль в экономике.	4,4	5,7
2	**Тема 2.** Профессиональные участники рынка ценных бумаг.	4,4	5,7
3	**Тема 3.** Система регулирования рынка ценных бумаг.	4,4	5,7
4	**Тема 4.** Эмиссия и обращение ценных бумаг.	4,4	5,7
Смысловой модуль 2. Организация деятельности рынка ценных бумаг			
5	**Тема 5.** Рынок долгового капитала.	4,5	5,7
6	**Тема 6.** Рынок акций.	4,5	5,7
7	**Тема 7.** Рынок производных ценных бумаг.	4,5	5,7
8	**Тема 8.** Международные рынки капитала.	3,5	5,7
9	**Тема 9.** Государственные ценные бумаги.	3,4	5,7
10	**Тема 10.** Модели анализа и прогнозирования доходности и риска ценных бумаг.	3,4	5,7
	ВСЕГО	**41,4**	**57**

10. ОБЕСПЕЧЕНИЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ДЛЯ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ И ИНВАЛИДОВ

В ходе реализации учебной дисциплины используются следующие дополнительные методы обучения, текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся в зависимости от их индивидуальных особенностей:

1) для слепых и слабовидящих:
   - лекции оформляются в виде электронного документа;
   - письменные задания оформляются увеличенным шрифтом или заменяются устным ответом;
2) для глухих и слабослышащих:
   - лекции оформляются в виде электронного документа;
   - письменные задания выполняются на компьютере в письменной форме;
   - зачет проводится в письменной форме на компьютере; возможно проведение в форме тестирования с использованием дистанционной системы Moodle;
3) для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:
   - лекции оформляются в виде электронного документа;
   - письменные задания заменяются устным ответом;
   - зачет проводится в устной форме.

При необходимости предусматривается увеличение времени для подготовки ответа.

Процедура проведения промежуточной аттестации для обучающихся устанавливается с учётом их индивидуальных психофизических особенностей. Промежуточная аттестация может проводиться в несколько этапов.

При проведении процедуры оценивания результатов обучения предусматривается

использование технических средств, необходимых в связи с индивидуальными особенностями обучающихся. Эти средства могут быть предоставлены университетом, или могут использоваться собственные технические средства.

Проведение процедуры оценивания результатов обучения допускается с использованием дистанционных образовательных технологий.

Обеспечивается доступ к информационным и библиографическим ресурсам в сети Интернет для каждого обучающегося в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

1) для слепых и слабовидящих:
- в печатной форме увеличенным шрифтом;
- в форме электронного документа.

2) для глухих и слабослышащих:
- в печатной форме;
- в форме электронного документа.

3) для обучающихся с нарушениями опорно-двигательного аппарата:
- в печатной форме;
- в форме электронного документа.

11. ИНДИВИДУАЛЬНЫЕ ЗАДАНИЯ

Вопросы для текущего модульного контроля (ТМК)

Смысловой модуль 1. Общие основы функционирования рынка ценных бумаг.

1. Дайте определение категории «ценная бумага».
2. Перечислите признаки ценных бумаг.
3. Раскройте свойства ценных бумаг.
4. Объясните разницу между «правом на бумагу» и «правом из бумаги».
5. Дайте определение «долевой ценной бумаги» и «долговой ценной бумаги», отметьте общее и отличное.
6. Институциональная структура рынка ценных бумаг.
7. Торговые посредники.
8. Институты учетной системы рынка ценных бумаг.
9. Охарактеризуйте составляющие системы регулирования рынка ценных бумаг.
10. Перечислите цели государственного регулирования рынка ценных бумаг.
11. Проанализируйте в чем отличие между рыночным и государственным регулированием рынка ценных бумаг.
12. Перечислите цели эмиссии.
13. Раскройте различия между открытой и закрытой эмиссией.
14. Перечислите этапы эмиссии ценных бумаг и охарактеризуйте каждый этап.
15. Назовите и охарактеризуйте сегменты рынка долгового капитала.
16. Дайте определение векселя и раскройте цели его выпуска.
17. Укажите отличия между простым и переводным векселем.
18. Дайте определение облигации и перечислите ее свойства.
19. Дайте определение акции и квалифицируйте ее как ценную бумагу.
20. Перечислите фундаментальные свойства акций.
21. Раскройте цель выпуска акций.
22. Объясните разницу между размещенными, оплаченными и объявленными акциями.
23. Дайте определение производной ценной бумаги.
24. Перечислите цели операций с деривативами.
25. Опишите методику хеджирования при помощи деривативов.
26. Назовите и охарактеризуйте секторы международного рынка капитала.
27. Охарактеризуйте историю развития и современное состояние рынка еврооблигаций.
28. Перечислите особенности выпуска еврооблигаций.
29. Перечислите цели выпуска государственных облигаций.

30. Перечислите виды государственных ценных бумаг.

31. Опишите механизм выпуска государственных ценных бумаг.

Смысловой модуль 2. Организация деятельности рынка ценных бумаг.

Задача

Номинал облигации 100 руб., ожидаемая сумма купонных выплат 5 руб, рыночная цена облигации 85 руб., срок до погашения 4 месяца.

Определите: доходность облигации к погашению.

Задача

Фирма приобрела 3 банковских векселя 1 марта 1998 г. сроком по предъявлении, но не ранее 1 июня 1998 г. Номинал каждого векселя - 100 тыс. руб. Процентный доход, гарантированный банком по векселям, - 25% годовых. Векселя были предъявлены фирмой к платежу банку 1 июля 1998 г.

Определите доходность операции с векселями.

Задача

Рассчитайте доходность инвестиций, если первоначальные инвестиции составляют 500 тыс. руб., сумма продисконтированных денежных потоков – 1200 тыс. руб.

Задача

Страйк-цена опциона пут 28 руб. Опционная премия - 2 руб. Спот-цена базового актива равна 26,5 руб. за единицу.

Определите внутреннюю и временную стоимость.

Вопросы к контрольной работе (АПР)

1. Понятие «ценные бумаги» и их классификация.
2. Структура долгового рынка.
3. Опционы: определение и виды.
4. Эмиссия ценных бумаг.
5. Понятие, функции и классификация деривативов.
6. Волатильность и методы ее оценки.
7. Фундаментальные свойства ценных бумаг.
8. Вексель: понятие и виды. Операции с векселями.
9. Опционная премия.
10. Эмитенты: определение и выполняемые функции. Категории эмитентов.
11. Классификация облигаций в зависимости от источника получения дохода, срока погашения.
12. Рынок еврооблигаций.
13. Классификация рынка ценных бумаг.
14. Процедура размещения ценных бумаг.
15. Фьючерсный контракт: определение и свойства.
16. Биржа: функции и задачи.
17. Акция и ее фундаментальные свойства
18. Риск и доходность ценных бумаг.
19. Рынок ценных бумаг как сегмент финансового рынка: сущность и задачи.
20. Этапы эмиссии ценных бумаг.
21. Цели операций с деривативами.
22. Инвесторы: определение и выполняемые функции. Категории инвесторов.
23. Классификация облигаций в зависимости от возможности досрочного погашения и возможности обмена на акции.
24. Депозитарные расписки: назначение и порядок выпуска.
25. Профессиональные участники рынка ценных бумаг.
26. Классификация облигаций в зависимости от эмитента, срока выплаты номинала, обеспечения.
27. Американские депозитарные расписки: виды и порядок выпуска.

28. Посредники на рынке ценных бумаг. Маркет-мейкеры и маркет-тейкеры.
29. Оценка стоимости облигаций.
30. Государственные облигации.
31. Участники рынка ценных бумаг, обеспечивающие исполнение сделок с ценными бумагами.
32. Рейтинг облигаций.
33. Облигации с государственной гарантией.
34. Информационная инфраструктура рынка ценных бумаг.
35. Показатели развития рынка облигаций.
36. Инфраструктурные облигации.
37. Участники рынка ценных бумаг.
38. Облигации и их свойства.
39. Свопы: определение и виды.
40. Процедура заключения сделок на бирже.
41. Объявленные, размещенные и оплаченные акции.
42. Ликвидность рынка ценных бумаг.
43. Саморегулируемые организации.
44. Операции с собственными акциями.
45. Модель CAMP.
46. Содержание и цели регулирования рынка ценных бумаг.
47. Акции в зависимости от источника генерируемого дохода.
48. Технический анализ.
49. Составляющие системы регулирования рынка ценных бумаг.
50. Номинальная и рыночная цена акции. Капитализация.
51. Соотношение между риском и доходностью ценных бумаг.
52. Государственное и рыночное прямое регулирование мирового финансового рынка.
53. Доходность по акциям.

12. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ ЗНАНИЙ ОБУЧАЮЩИХСЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ

Оценочные средства детализируются по видам работ в оценочных материалах по учебной дисциплине, которые утверждаются на заседании кафедры.

Система оценивания по учебной дисциплине по очной форме обучения*

Форма контроля	**Макс. количество баллов**	
	За одну работу	**Всего**
Текущий контроль:		
- дискуссия, собеседование (темы 1-4)	3	12
- тестирование (темы 5-10)	2	8
- контрольная работа	20	20
Промежуточная аттестация	*экзамен*	*60*
Итого за семестр	*100*	

* в соответствии с утвержденными оценочными материалами по учебной дисциплине

Система оценивания по учебной дисциплине по очно-заочной форме обучения*

Форма контроля	**Макс. количество баллов**	
	За одну работу	**Всего**
Текущий контроль:		
- дискуссия, собеседование (темы 1-4)	3	12
- тестирование (темы 5-10)	2	8
- контрольная работа	20	20
Промежуточная аттестация	*экзамен*	*60*
Итого за семестр	*100*	

* в соответствии с утвержденными оценочными материалами по учебной дисциплине

Вопросы для подготовки к зачету:

1. Понятие «ценные бумаги» и их классификация.
2. Структура долгового рынка.
3. Опционы: определение и виды.
4. Эмиссия ценных бумаг.
5. Понятие, функции и классификация деривативов.
6. Волатильность и методы ее оценки.
7. Фундаментальные свойства ценных бумаг.
8. Вексель: понятие и виды. Операции с векселями.
9. Опционная премия.
10. Эмитенты: определение и выполняемые функции. Категории эмитентов.
11. Классификация облигаций в зависимости от источника получения дохода, срока погашения.
12. Рынок еврооблигаций.
13. Участники РЦБ и их взаимодействие.
14. Международные ценные бумаги: виды, характеристики, перспективы развития.
15. Классификация рынка ценных бумаг.
16. Процедура размещения ценных бумаг.
17. Фьючерсный контракт: определение и свойства.
18. Биржа: функции и задачи.
19. Задачи современных фондовых бирж.
20. Акция и ее фундаментальные свойства
21. Риск и доходность ценных бумаг.
22. Рынок ценных бумаг как сегмент финансового рынка: сущность и задачи.
23. Этапы эмиссии ценных бумаг.
24. Виды биржевых аукционов.
25. Цели операций с деривативами.
26. Инвесторы: определение и выполняемые функции. Категории инвесторов.
27. Классификация облигаций в зависимости от возможности досрочного погашения и возможности обмена на акции.
28. Депозитарные расписки: назначение и порядок выпуска.
29. Профессиональные участники рынка ценных бумаг.
30. Классификация облигаций в зависимости от эмитента, срока выплаты номинала, обеспечения.
31. Роль фондового рынка в развитии и экономических систем рыночного типа
32. Американские депозитарные расписки: виды и порядок выпуска.
33. Посредники на рынке ценных бумаг. Маркет-мейкеры и маркет-тейкеры.
34. Оценка стоимости облигаций.
35. Государственные облигации.
36. Участники рынка ценных бумаг, обеспечивающие исполнение сделок с ценными бумагами.
37. Рейтинг облигаций.

38. Функции рынка ценных бумаг в современных экономических условиях
39. Облигации с государственной гарантией.
40. Информационная инфраструктура рынка ценных бумаг.
41. Показатели развития рынка облигаций.
42. Рынок ценных бумаг: структура, роль в макро и микроэкономике, участники
43. Инфраструктурные облигации.
44. Участники рынка ценных бумаг.
45. Облигации и их свойства.
46. Свопы: определение и виды.
47. Торговые системы на фондовом рынке
48. Процедура заключения сделок на бирже.
49. Характеристика срочных сделок в системе биржевой торговли
50. Объявленные, размещенные и оплаченные акции.
51. Складские свидетельства: понятие, область применения.
52. Ликвидность рынка ценных бумаг.
53. Саморегулируемые организации.
54. Операции с собственными акциями.
55. Модель САМР.
56. Содержание и цели регулирования рынка ценных бумаг.
57. Акции в зависимости от источника генерируемого дохода.
58. Технический анализ.
59. Составляющие системы регулирования рынка ценных бумаг.
60. Номинальная и рыночная цена акции. Капитализация.
61. Соотношение между риском и доходностью ценных бумаг.
62. Государственное и рыночное прямое регулирование мирового финансового рынка.
63. Доходность по акциям.
64. Инвестиционные качества ценных бумаг.
65. Основы портфельной теории.
66. Листинг и делистинг.
67. Классификация акций.
68. Фундаментальный анализ.Функции рынка ценных бумаг.
69. Андеррайтинг.
70. Форвардный контракт.
71. В чем состоит привлекательность еврооблигаций?
72. Этапы эмиссии американской депозитарной расписки.
73. Методы оценки риска портфеля ценных бумаг.
74. Портфель ценных бума
75. Диверсификация портфеля ценных бумаг
76. Отличительные черты иныестиционного портыеля, от портфеля ценных бумаг
77. Форвард и фючерс, сходства и отличая
78. Виды операций с собственными акциями
79. Операция сплит, что такое, как проводят?
80. Государственные облигации
81. Концессионные облигации
82. Порядок выпуска концессионных облигаций
83. Преимущества государственного партнерства для государственного и частного сектора
84. Имеет ли право государство выпускать ценную бумагу «Акция», ответ обосновать.
85. Порядок выпуска Американской депозитарной расписки.
86. Чем представлен долговой рынок капиталла?
87. Мировые облигации, положительные и отрицательные стороны
88. Акция и ее фундаментальные свойства
89. Суть метода анализа ценных бумаг по Марковицу.

90. Назначение инвестиционного портфеля и портфеля ценных бумаг.

13. РАСПРЕДЕЛЕНИЕ БАЛЛОВ, КОТОРЫЕ ПОЛУЧАЮТ ОБУЧАЮЩИЕСЯ

Максимальное количество баллов за текущий контроль и самостоятельную работу										**Максимальная сумма баллов**
Смысловой модуль № 1				Смысловой модуль № 2						
Т1	Т2	Т3	Т4	Т5	Т6	Т7	Т8	Т9	Т10	
10	10	10	10	10	10	10	10	10	10	100

Примечание. Т1, Т2, ... Т10 – номера тем соответствующих смысловых модулей

Соответствие государственной шкалы оценивания академической успеваемости и шкалы

Сумма баллов за все виды учебной деятельности	**По государственной шкале**	**Определение**
90-100	«Отлично» (5)	отличное выполнение с незначительным количеством неточностей
80-89	«Хорошо» (4)	в целом правильно выполненная работа с незначительным количеством ошибок (до 10%)
75-79		в целом правильно выполненная работа с незначительным количеством ошибок (до 15%)
70-74	«Удовлетворительно» (3)	неплохо, но со значительным количеством недостатков
60-69		выполнение удовлетворяет минимальные критерии
35-59	«Неудовлетворительно» (2)	с возможностью повторной аттестации
0-34		с обязательным повторным изучением дисциплины (выставляется комиссией)

14. РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА

Основная литература:

1. Выгодчикова, И. Ю. Методы анализа рынка ценных бумаг [Электронный ресурс]: учебное пособие / И. Ю. Выгодчикова. — Электрон. текстовые данные. — Саратов: Ай Пи Ар Медиа, 2019. — 200 с. — 978-5-4497-0058-2. — Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/83920.html.

2. Выгодчикова, И. Ю. Математические модели рынка ценных бумаг : учебное пособие / И. Ю. Выгодчикова. — Москва : Ай Пи Ар Медиа, 2021. — 257 с. — ISBN 978-5-4497-0982-0. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/104669.html

3. Николаева, И. П. Рынок ценных бумаг : учебник для бакалавров / И. П. Николаева. — 2-е изд. — Москва : Дашков и К, 2020. — 255 с. — ISBN 978-5-394-03586-9. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/110960.html

Дополнительная литература:

1. Газалиев, М. М. Рынок ценных бумаг: учебное пособие для бакалавров / М. М. Газалиев, В. А. Осипов. — 2-е изд. — Москва: Дашков и К. 2020. — 160 с. — ISBN 978-5-394-03548-7. —

Текст: электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/110961.html.

2. Дж., Фабоцци Рынок облигаций: анализ и стратегии / Фрэнк Фабоцци Дж.; перевод А. Левинзон; под редакцией А. Дзюра, Е. Дроновой. — 2-е изд. — Москва: Альпина Паблишер. 2020. — 949 c. — ISBN 5-9614-0468-4. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/93059.html.

3. Рынок ценных бумаг: учебное пособие и практикум / А. В. Золкина, А. А. Панасюк, А. Ю. Анисимов, И. А. Кокорев. — Москва : Институт мировых цивилизаций, 2019. — 84 c. — ISBN 978-5-6043054-7-8. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/94841.html.

4. Тарасова, А. Ю. Валютные операции коммерческих банков [Электронный ресурс] : учебное пособие / А. Ю. Тарасова ; Федеральное государственное образовательное бюджетное учреждение высшего образования «Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации», Ярославский филиал . ─ Ярославль : Канцлер, 2019, 106 с. ─ Локал. компьютер сеть НБ ДонНУЭТ. ─ 978-5-6041805-4-9.

5. Чудиновских, М. В. Правовое регулирование рынка ценных бумаг [Электронный ресурс]: учебник / М. В. Чудиновских. — Электрон. текстовые данные. — Саратов: Ай Пи Эр Медиа, 2018. — 191 c. — 978-5-4486-0194-1. — Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/71576.htm.

6. Маляров, А. Н. Индивидуальное инвестирование на фондовых рынках : монография / А. Н. Маляров. — Самара : Самарский государственный технический университет, 2022. — 400 c. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/122201.html

7. Коришева, О. В. Рынок ценных бумаг и биржевое дело: технический анализ : учебное пособие / О. В. Коришева. — Москва : Российский университет транспорта (МИИТ), 2021. — 69 c. — Текст: электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/122132.html.

8. Коришева, О. В. Рынок ценных бумаг и биржевое дело: фундаментальный анализ : учебное пособие / О. В. Коришева. — Москва : Российский университет транспорта (МИИТ), 2021. — 51 c. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/122133.html

Учебно-методические издания:

1. Малецкий А.В. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс]: конспект лекций для студ. направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (профиль «Финансы и кредит»), оч. и заоч. форм обучения / А.В.. Малецкий; М-во образования и науки ДНР, ГОВПО "Донец. нац. ун-т экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского", Каф. финансов. ─ Донецк: ДонНУЭТ, 2020. ─ Локал. компьютер. сеть НБ ДонНУЭТ.

2. Малецкий А.В. Рынок ценных бумаг [Текст]: Учебно-методическое пособие для обучающихся укрупненной группы направлений подготовки и специальностей 38.00.00 «Экономика и управление» образовательной программы высшего профессионального образования – бакалавриат, специалитет очной и заочной форм обучения. / А. В. Малецкий; М-во образования и науки ДНР, ГОВПО "Донец. нац. ун-т экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского", Каф. финансов . ─ Донецк : [ДонНУЭТ], 2020. ─ 215 с.

3. Малецкий А.В. Рынок ценных бумаг [Текст]: метод. указания для провед. практ. и семинар. занятий по дисциплине для студ. направления подготовки 38.03.01 «Экономика» образовательный уровень «бакалавриат» оч. и заоч. форм обучения / М-во образования и науки ДНР; ГОВПО «ДонНУЭТ имени М. Туган-Барановского»; – Донецк: [ДонНУЭТ], 2020. Учеб.-метод. комплекс дисциплины.

4. Малецкий А.В. Рынок ценных бумаг [Текст]: метод. рекомендации для самост. работы студентов направления подготовки 38.03.01 «Экономика», оч. и заоч. форм обучения / А.В. Малецкий; М-во образования и науки ДНР, ГОВПО "Донец. нац. ун-т экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского", Каф. финансов. ─ Донецк : [ДонНУЭТ], 2020. ─ Учеб.-

метод. комплекс дисциплины.

5. Малецкий А.В. Рынок ценных бумаг [Текст]: индивид. задания для студентов направления подготовки 38.03.01 «Экономика», оч. и заоч. форм обучения / А.В. Малецкий; М-во образования и науки ДНР, ГОВПО "Донец. нац. ун-т экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского", Каф. финансов. ─ Донецк: [ДонНУЭТ], 2020. ─ Учеб.-метод. комплекс дисциплины.

6. Малецкий А.В., Верич Ю.Л. Рынок ценных бумаг [Текст]: Средства диагностики по дисциплине «Рынок ценных бумаг» для студ направления 38.03.01 "Экономика", профиль Финансы и кредит, профиль Финансы и кредит (Пенсионный фонд), профиль Банковское дело, направления 38.05.01 "Экономическая безопасность" / Ю. Л. Верич, А. В. Малецкий; ГОВПО Донец. нац. ун-т. экономики и торговли им. М. Туган-Барановского, финансов. - Донецк: ГОВПО ДонНУЭТ, 2018. - 42 с.

7. Малецкий А.В. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс]: дистанционный курс Moodle для обучающихся направления подгот. Экономика (Профиль: Внешнеэкономическая деятельность) образовательной программы высш. проф. образования – бакалавриат оч. и заоч. форм обучения / А.В. Малецкий. – Донецк: ГО ВПО «ДонНУЭТ», 2021.

15. ИНФОРМАЦИОННЫЕ РЕСУРСЫ

1. Автоматизированная библиотечная информационная система UNILIB [Электронный ресурс] – Версия 2.110. – Электрон. дан. – [Донецк, 2021]. – Локал. сеть Науч. б-ки ГО ВПО Донец. нац. ун-та экономики и торговли им. М. Туган-Барановского. – Систем. требования: ПК с процессором ; Windows ; транспорт. протоколы TCP/IP и IPX/SPX в ред. Microsoft ; мышь. – Загл. с экрана.

2. IPRbooks: Электронно-библиотечная система [Электронный ресурс] : [«АЙ Пи Эр Медиа»] / [ООО «Ай Пи Эр Медиа»]. – Электрон. текстовые, табл. и граф. дан. – Саратов, [2018]. – Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru. – Загл. с экрана.

3. СЭБ «Лань» : Электронно-библиотечная система [Электронный ресурс] / [ООО «Издательство «Лань»]. – Электрон. текстовые дан. – [Электронно-библиотечная система Издательства Лань, 2016-]. – Режим доступа : https://e.lanbook.com/ – Загл. с титул. экрана.

4. Бизнес+Закон [Электронный ресурс] : Агрегатор правовой информации / [Информационно-правовая платформа]. – Электрон. текстовые дан. – [Донецк, 2020-]. – Режим доступа : https://bz-plus.ru. – Загл. с экрана.

5. «Полпред Справочники» [Электронный ресурс] : электрон. б-ка / [База данных экономики и права]. – Электрон. текстовые дан. – [Москва : ООО «Полпред Справочники», 2010-]. – Режим доступа : https://polpred.com. – Загл. с экрана.

6. Book on lime : Электронно-библиотечная система [Электронный ресурс] : ООО «Книжный дом университета». – Электрон. текстовые дан. – Москва, 2017. – Режим доступа : https://bookonlime.ru.– Загл. с экрана.

7. Elibrary.ru [Электронный ресурс] : науч. электрон. б-ка / ООО Науч. электрон. б-ка. – Электрон. текстовые. и табл. дан. – [Москва] : ООО Науч. электрон. б-ка., 2000- .– Режим доступа : https://elibrary.ru. – Загл. с экрана.

8. Научная электронная библиотека «КиберЛенинка» [Электронный ресурс] / [ООО «Итеос» ; Е. Кисляк, Д. Семячкин, М. Сергеев]. – Электрон. текстовые дан. – [Москва : ООО «Итеос», 2012-]. – Режим доступа : http://cyberleninka.ru. – Загл. с экрана.

9. «Национальная Электронная Библиотека» [Электронный ресурс] / [Информационная система]. – Электрон. текстовые дан. – Москва, 2015. – Режим доступа : https://rusneb.ru/ – Загл. с экрана.

10. Электронный каталог Научной библиотеки Донецкого национального университета экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского [Электронный ресурс] / НБ ДонНУЭТ. – Электрон. дан. – [Донецк, 1999-]. – Режим доступа: http://catalog.donnuet.education – Загл. с экрана.

11. Система дистанционного обучения Донецкого национального университета экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского [Электронный ресурс] / Режим доступа: http://distant.donnuet.education/

12. Народный совет Донецкой Народной Республики. Официальный сайт [Электронный ресурс] / Народный совет. – Электрон. текст. данные. – Донецк: Народный совет, – Режим доступа: http://dnrsovet.su/ru/. – Название с экрана.

13. Главное управление статистики Донецкой Народной Республики. Официальный сайт [Электронный ресурс] / Главстат. – Электрон. текст. данные. – Донецк: Главное управление статистики. сор. 2015-2017. – Режим доступа: http://glavstat.govdnr.ru/. – Название с экрана.

14. Министерство экономического развития Донецкой Народной Республики. Официальный сайт [Электронный ресурс] / Электрон. текст. данные. – Донецк: Министерство экономического развития ДНР, сор. 2015-2018. – Режим доступа: http://mer.govdnr.ru. – Название с экрана.

16. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Минимально необходимый для реализации ОПОП ВО бакалавриата перечень материально-технического обеспечения включает аудиторный фонд в соответствии с утвержденным расписанием с использованием мультимедийного демонстрационного комплекса кафедры финансов и экономической безопасности (проектор, ноутбук).

17. КАДРОВОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Фамилия, имя, отчества	Условия привлечения (по основному месту работы, на условиях внутреннего/ внешнего совместительства; на условиях договора гражданско-правового характера (далее – договор ГПХ)	Должность, ученая степень, ученое звание	Уровень образования, наименование специаль-ности, направления подготовки, наименование присвоенной квалификации	Сведения о дополнительном профессиональном образовании
Малецкий Антон Викторович	По основному месту работы	Должность – доцент, кандидат экономических наук, ученое звание доцент	Высшее, менеджмент организаций, магистр, диплом кандидата экономических наук ДК № 019737	1. Удостоверение о повышении квалификации №110400009602 от 28.02.2022г., «Информационные технологии в образовании», 72 часа, Филиал Ухтинского государственного технического университета, г. Усинск 2. Удостоверение о повышении квалификации №612400026672, 21.09.2022г., «Актуальные вопросы преподавания в образовательных учреждениях высшего образования: нормативно-правовое, психолого-педатогическое и методическое сопровождение» 24 часа, ФГБОУ ВО "Донской государственный технический университет", Ростов-на-Дону. 3.Удостоверение о повышении квалификации №QB 0522107033 от 28.11.2022г., «Разработка и внедрение дистанционных курсов на базе дистанционного обучения Moodle», 76 часа, ГО ВПО "ДонНУЭТ" ЦДПО, Донецк 4. Удостоверение о повышении квалификации №612400030707 от 19.05.2023г., «Организационно-методические аспекты разработки и реализации программ высшего образования по направлениям подготовки Экономика и управление», 36 часов, ФГБОУ ВО "Донской государственный технический университет", Ростов-на-Дону.

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ
Б1.В.ДВ.01.02 РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ

Направление подготовки 38.03.01 Экономика
Профиль: Финансы и кредит
Трудоемкость учебной дисциплины: 3 з.е.
Планируемые результаты обучения по учебной дисциплине:

знать: закономерности развития рынка ценных бумаг; функции и принципы организации деятельности профессиональными участниками рынка ценных бумаг; статистические показатели, используемые на рынке ценных бумаг для оценки динамики его развития; виды ценных бумаг, принципы их выпуска и обращения, а также закономерности выбора компанией источника финансирования в зависимости от стадии жизненного цикла компании и цикла развития рынка ценных бумаг; правила регулирования рынка ценных бумаг, функции государственного регулятора рынка ценных бумаг и саморегулируемых организаций.

уметь: обобщать и систематизировать информацию, характеризующую деятельность компаний на рынке ценных бумаг; анализировать основные показатели результатов торгов ценными бумагами на фондовой бирже с использование информации, представленной на сайтах фондовых бирж, рейтинговых агентств и инвестиционных компаний; использовать для выполнения аналитических заданий современные технические средства и информационные технологии; оценивать условия и последствия принимаемых управленческих решений на рынке ценных бумаг по привлечению и размещению капитала; анализировать основные финансовые показатели, характеризующие ценные бумаги.

владеть: методологией экономического исследования на макроуровне; методами планирования проведения научного исследования и совокупностью способов и приемов в области исследования методов и инструментов валютного регулирования; навыками применения инструментов сравнительного и ситуационного анализа.

Компетенции выпускников и индикаторы их достижения:

Код и наименование компетенции	*Код и наименование индикатора достижения компетенции*
ПК-5. Способен проводить мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков	ИД-1пк-5 Проводит исследования финансового рынка и изучает предложения финансовых услуг (в том числе действующих правил и условий, тарифной политики и действующих форм документации) ИД-2пк-5 Осуществляет мониторинг информационных источников финансовой информации

Наименование смысловых модулей и тем учебной дисциплины:

Смысловой модуль 1. Общие основы функционирования рынка ценных бумаг. Тема 1. Рынок ценных бумаг: сущность, функции и роль в экономике. Тема 2. Профессиональные участники рынка ценных бумаг. Тема 3. Система регулирования рынка ценных бумаг. Тема 4. Эмиссия и обращение ценных бумаг.

Смысловой модуль 2. Организация деятельности рынка ценных бумаг. Тема 5. Рынок долгового капитала. Тема 6. Рынок акций. Тема 7. Рынок производных ценных бумаг. Тема 8. Международные рынки капитала. Тема 9. Государственные ценные бумаги. Тема 10. Модели анализа и прогнозирования доходности и риска ценных бумаг.

Форма промежуточной аттестации: экзамен

Разработчик:
Малецкий А.В., кандидат экономических наук, доцент

(подпись)

Заведующий кафедрой финансов и экономической безопасности
Омельянович Л.А., доктор экономических наук, профессор

(подпись)