

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тольяттинский государственный университет»

Б1.В.ДВ.01.01
(индекс дисциплины)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Моделирование на рынке ценных бумаг

(наименование дисциплины)

по направлению подготовки
38.04.01 Экономика

направленность (профиль)
Бизнес-аналитика

Форма обучения: заочная

Год набора: 2023

Общая трудоемкость: 3 ЗЕ

Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр	3	Итого
Форма контроля	Экзамен	
Вид занятий		
Лекции	4	4
Лабораторные		
Практические	4	4
Руководство: курсовые работы (проекты) / РГР		
Промежуточная аттестация	0,35	0,35
Контактная работа	8,35	8,35
Самостоятельная работа	91	91
Контроль	8,65	8,65
Итого	108	108

Рабочую программу составил(и):

Доцент института финансов, экономики и управления, кандидат экономических наук,
доцент, Шерстобитова А.А.

(должность, ученое звание, степень, Фамилия И.О.)

Профессор института финансов, экономики и управления, доктор экономических наук,
доцент, Курилова А.А.

(должность, ученое звание, степень, Фамилия И.О.)

Рецензирование рабочей программы дисциплины:



Отсутствует



Рецензент

(должность, ученое звание, степень, Фамилия И.О.)

Рабочая программа дисциплины составлена на основании ФГОС ВО и учебного плана
направления подготовки (специальности) 38.04.01 Экономика

Срок действия рабочей программы дисциплины до «24» мая 2026 г.

УТВЕРЖДЕНО

На заседании института финансов, экономики и управления

(протокол заседания № 1 от «31» августа 2022 г.).

1. Цель освоения дисциплины

Цель освоения дисциплины – заключается в развитии у студентов системного представления о структуре и тенденциях развития российского и мирового рынка ценных бумаг, формирования понятия о многообразии экономических процессов на рынке ценных бумаг, а также в приобретении умений и навыков, позволяющих будущим специалистам на профессиональном уровне заниматься теорией и практикой становления и развития рынка ценных бумаг в России.

2. Место дисциплины в структуре ОПОП ВО

Дисциплины и практики, на освоении которых базируется данная дисциплина: «Экономическая теория (продвинутый уровень)», «Фундаментальный анализ на рынке ценных бумаг».

Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины необходимо как предшествующее: «Анализ валютного рынка», «Управление капиталом компании».

3. Планируемые результаты обучения

Формируемые и контролируемые компетенции (код и наименование)	Индикаторы достижения компетенций (код и наименование)	Планируемые результаты обучения
ПК-2. Способен моделировать развитие бизнес-анализа в организации	ПК -2.2. Моделирует бизнес-процессы в организации и предлагает направления развития организации	Знать: модели рынка ценных бумаг как альтернативные источники финансирования экономики
		Уметь: моделировать бизнес-процессы
		Владеть: навыками составления механизма принятия решений по развитию организации на рынке ценных бумаг

4. Структура и содержание дисциплины

Модуль (раздел)	Вид учебной работы	Наименование тем занятий (учебной работы)	Семестр	Объем, ч.	Баллы	Интерактив, ч.	Формы текущего контроля (наименование оценочного средства)
	Лек Пр	Тема 1. Модели рынка ценных бумаг как альтернативные источники финансирования экономики 1. Понятие рынка ценных бумаг, его сущность и функции. 2. Понятие ценной бумаги 3. История появления ценных бумаг 4. Модели рынка ценных бумаг как альтернативные источники финансирования экономики 5. Моделирование на рынке ценных бумаг: цели, задачи, методы.	3	2		12	Промежуточный тест Итоговое тестирование Задание 1
	Лек Пр	Тема 2. Механизм принятия решений на рынке ценных бумаг (фундаментальный и технический анализ) 1. Принципы технического анализа. Фундаментальный анализ 2. Графические методы технического анализа 3. Фигуры технического анализа 4. Технический анализ и стратегии инвесторов		2		12	Промежуточный тест Итоговое тестирование Задание 2
	Лек Пр	Тема 3. Депозитарно-регистрационный механизм рынка ценных бумаг 1. Депозитарная и расчетно-клиринговая инфраструктура: понятие, функции, варианты организационного устройства 2. Депозитарий 3. Клиринговая организация		2		8	Промежуточный тест Итоговое тестирование

		4. Организация расчетов на рынке ценных бумаг 5. Сеть регистраторов				
	Лек	Тема 4. Система государственного регулирования рынка ценных бумаг: органы государственного надзора, законодательно-правовая база регулирования, национальные особенности регулирования рынка	2		8	Промежуточный тест Итоговое тестирование
	Пр	1. Регулирующие функции государства на рынке ценных бумаг 2. Органы регулирования рынка ценных бумаг на различных уровнях 3. Саморегулируемые организации 4. Структура законодательства по ценным бумагам				
		Тема 5. Валютный рынок: виды и механизм функционирования Валютный рынок: биржевой, межбанковский 2. Валютный курс и факторы на него влияющие 3. Закономерности функционирования оптового и срочного валютного рынка			8	Промежуточный тест Итоговое тестирование
		Тема 6. Взаимосвязь рынка ценных бумаг и валютного рынка 1. Влияние валютного рынка на РЦБ. 2. Способы обработки информации на валютном рынке			9	Промежуточный тест Итоговое тестирование
	СР		91		3	
	ПА		0,35			
	Контроль		8,65		40	
Итого:			108	100		

5. Образовательные технологии

В рамках изучения дисциплины «Моделирование на рынке ценных бумаг» предусмотрено использование дистанционных образовательных технологий.

6. Методические указания по освоению дисциплины

При подготовке к ответам на тесты по темам курса и выполнению заданий студенту необходимо тщательно изучить электронный учебник по дисциплине, предлагаемую литературу, дополнительные материалы.

Студент самостоятельно работает с дополнительной и основной литературой, Интернет-ресурсами.

7. Оценочные средства

7.1. Паспорт оценочных средств

Семестр	Код контролируемой компетенции (или ее части)	Наименование оценочного средства
3	ПК-1	Задания 1-2, вопросы к экзамену 1-60, Промежуточный тест Итоговое тестирование

7.2. Типовые задания или иные материалы, необходимые для текущего контроля

7.2.1 Задания

Задание 1

Напишите эссе на тему: «Модели рынка ценных бумаг как альтернативные источники финансирования экономики»

Задание 2

Проведите подробный фундаментальный анализ рынка акций выбранной компании.
Проведите подробный технический анализ рынка акций выбранной компании.
Результаты анализа должны быть подкреплены фактическими данными. Приведите краткий обзор используемых инструментов анализа. При осуществлении технического анализа необходимо привести в выполненном задании все используемые графики.
Рекомендации.
Информацию о динамике курса акций рекомендуется брать с официального сайта <https://www.finam.ru/>

Критерии оценки

Формы текущего контроля	Критерии и нормы оценки
Задание 1	4 балла – тема эссе раскрыта полностью, работа выполнена самостоятельно, чётко выражена позиция автора 3 балла – тема эссе недостаточно раскрыта, работа выполнена самостоятельно, позиция автора чётко не выражена 2 балла - тема эссе недостаточно раскрыта, работа выполнена недостаточно самостоятельно, позиция автора не выражена 1 балл – тема эссе не раскрыта, работа выполнена не самостоятельно, позиция автора не выражена 0 баллов – задание не выполнено
Задание 2	4 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, сделаны выводы 3 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, отсутствуют выводы 2 балла – задание выполнено не в полном объёме, есть незначительные замечания 1 балла – задание выполнено не в полном объёме, присутствуют существенные замечания 0 баллов – задание не выполнено

9.2. 2

Примерный перечень заданий, промежуточного и итогового тестирования

Укажите правильный ответ

1. Ценные бумаги являются имуществом:
А) движимым
Б) недвижимым
2. Эмиссионными ценными бумагами являются:
А) акции
Б) варранты
В) коносаменты
Г) опционы эмитента
Д) сберегательные сертификаты.
3. Ценная бумага, составляемая на имя первого держателя с оговоркой "приказу", является ...
А) именной
Б) ордерной
4. Ордерными ценными бумагами являются:
А) акции
Б) векселя
В) инвестиционные паи
Г) коносаменты
Д) чеки
5. Капитализация рынка ценных бумаг - это ... компаний, акции которых обращаются на фондовой бирже.
А) рыночная стоимость
Б) средняя величина капиталов
В) совокупность компаний
6. Фондовый рынок является частью рынка:
А) финансового
Б) денежного
В) капиталов
Г) реальных активов
Д) банковских кредитов
7. Рынки ценных бумаг по месту обращения ценных бумаг подразделяются на:
А) международный
Б) кассовый
В) биржевой
Г) региональный
Д) внебиржевой
8. Стихийным является рынок:
А) прибиржевой, «уличный», на котором торгуют ценными бумагами, не котирующимися на бирже

Б) испытывающий внезапные стихийные колебания (падения или подъемы) курсов ценных бумаг

В) функционирующий без всяких правил: правил доступа ценных бумаг и участников к торгам, механизма торговли, установления цен

9. Двойные непрерывные аукционные рынки используются на:

А) фондовой бирже

Б) первичном рынке ценных бумаг при эмиссии государственных долговых обязательств

В) вторичном дилерском рынке

10. Номинальная стоимость акций, приобретенных акционерами, составляет ... акционерного общества

А) собственный капитал

Б) уставный капитал

В) рыночную стоимость

11.

Акции ... конкретный срок погашения.

А) имеют

Б) не имеют

12. По российскому законодательству акции могут выпускаться как ценные бумаги:

А) на предъявителя

Б) именные

В) ордерные

13. Акционерное общество акции различного номинала размещать...

А) может только привилегированные

Б) может только простые

В) может простые и привилегированные

Г) не может

14. Облигация является:

А) титулом собственности инвестора на часть имущества эмитента

Б) долговым обязательством эмитента перед инвестором

В) долговым обязательством инвестора перед эмитентом.

15. Облигации право на участие в управлении эмитентом:

А) дают

Б) не дают

В) дают, если это записано в уставе

Г) дают, если это предусмотрено условиями эмиссии

16. В РФ выпускать облигации могут:

А) только физические лица

Б) только юридические лица

В) физические и юридические лица

17. Эмитировать облигации, являющиеся эмиссионными ценными бумагами, могут:

А) только юридические лица

Б) только физические лица

В) юридические и физические лица

18. В Российской Федерации облигации частных эмитентов могут выпускаться:

- А) только в документарной форме
- Б) как в документарной, так и в бездокументарной форме
- В) только в бездокументарной форме

19. Конвертируемые облигации - это облигации, которые:

- А) могут быть обменены на акции
- Б) обеспечивают получение дохода в свободно конвертируемой валюте
- В) обеспечивают индексацию номинала в соответствии с изменениями курса национальной валюты к свободно конвертируемой валюте

19. Бланковая закладная облигация А) это облигация:

- А) имя владельца которой не указано на самой облигации
- Б) выпущенная под залог всех активов предприятия
- В) выпущенная в документарной форме, бланк которой хранится в депозитарии

20. Регистрацию государственных ценных бумаг в России осуществляет ...

- А) Федеральная комиссия по рынку ценных бумаг
- Б) Министерство финансов
- В) Банк России

Критерии оценки:

Формы текущего контроля	Критерии и нормы оценки
Промежуточный тест (по теме 1)	Максимальное количество баллов - 8 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)
Промежуточный тест (по теме 2)	Максимальное количество баллов - 8 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)
Промежуточный тест (по теме 3)	Максимальное количество баллов - 8 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)
Промежуточный тест (по теме 4)	Максимальное количество баллов - 8 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)
Промежуточный тест (по теме 5)	Максимальное количество баллов - 8 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)
Промежуточный тест (по теме 6)	Максимальное количество баллов - 9 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)
Итоговое тестирование	Максимальное количество баллов - 40 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Итого	Максимальное количество баллов – 100 б.

7.3. Оценочные средства для промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины

7.3.1. Вопросы к промежуточной аттестации

Семестр 3

№ п/п	Вопросы к экзамену
1.	Понятие ценной бумаги. Виды ценных бумаг.
2.	Акция, понятие, основные характеристики. Виды акций.
3.	Простые и привилегированные акции. Их разновидности.
4.	Цена акции. Методы воздействия на рыночный курс акции.
5.	Доходность акций. Определение доходности.
6.	Андеррайтинг.
7.	Облигации. Основные характеристики, виды облигаций.
8.	Доходность облигаций.
9.	Государственные ценные бумаги (ЦБ). Виды государственных ЦБ.
10.	Определение доходности государственных ЦБ.
11.	Производные ЦБ и их характеристика (конвертируемые акции и облигации, варранты, опционы и фьючерсы).
12.	Форвард. Определение цены форварда.
13.	Фьючерс. Ценообразование фьючерса.
14.	Опцион. Виды опционов. Определение цены опциона.
15.	Варрант. Ценообразование варрантов.
16.	Финансовые инструменты на рынке ценных бумаг (РЦБ) (векселя; депозитные, сберегательные, инвестиционные сертификаты, секьюризация частных долгов).
17.	Вексель: содержание, формы, индоссамент, аваль.
18.	Депозитные и сберегательные сертификаты банков и определение их доходности.
19.	Международные ЦБ (евроноты, еврооблигации, евроакции).
20.	Структура РЦБ.
21.	Первичный РЦБ и его характеристика.
22.	Методы размещения ЦБ.
23.	Участники первичного внебиржевого РЦБ.
24.	Организационная структура и функции фондовой биржи.
25.	Участники биржевой торговли.
26.	Основные операции и сделки на бирже.
27.	Биржевая информация (биржевые индексы и их характеры).
28.	Листинг. Преимущества и недостатки.
29.	«Уличный» РЦБ и характеристика его деятельности.
30.	Участники вторичного рынка.
31.	Механизм принятия решений на РЦБ (фундаментальный и технический анализ).
32.	Эмиссия ЦБ.
33.	Депозитарно-регистрационный механизм РЦБ.
34.	Реестр владельцев ЦБ.
35.	Система государственного регулирования РЦБ. Органы государственного надзора. Законодательно-правовая база регулирования.
36.	Инвестиционная деятельность банков на РЦБ. Виды банковских операций с ЦБ. Выпуск банками ЦБ.
37.	Инвестиционная деятельность страховых компаний.
38.	Инвестиционная политика предприятий.

№ п/п	Вопросы к экзамену
39.	Граждане как инвесторы.
40.	Рынок ценных бумаг Российской Федерации. Структура, участники рынка. Основные операции на рынке.
41.	Валютный курс: общее понятие и виды. Обратный и девизный валютный курс
42.	Биржевой валютный рынок
43.	Межбанковский валютный рынок
44.	Оптовый и спотовый валютный рынок
45.	Валютный курс в малой открытой экономике
46.	Валютный курс в большой открытой экономике
47.	Валютный паритет
48.	Взаимосвязь валютного паритета и процентных ставок
49.	Фиксированный валютный курс в МОЭ
50.	Свободный валютный курс в МОЭ
51.	Фиксированный валютный курс в БОЭ
52.	Свободный валютный курс в БОЭ
53.	Взаимосвязь валютного рынка и рынка ценных бумаг
54.	«Финансовые пузыри» на валютном рынке
55.	«Финансовые пузыри» на рынке ценных бумаг
56.	Акции. Виды акций
57.	Облигации. Виды облигаций.
58.	Имитационное моделирование
59.	Инвестиционные модели
60.	Банковские сертификаты, вексель, чек и прочие простые ценные бумаги

7.3.2. Критерии и нормы оценки

Формы текущего контроля	Условия допуска	Критерии и нормы оценки
Промежуточный тест (по теме 1)	Отсутствуют	Максимальное количество баллов - 8 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)
Промежуточный тест (по теме 2)	Отсутствуют	Максимальное количество баллов - 8 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)
Промежуточный тест (по теме 3)	Отсутствуют	Максимальное количество баллов - 8 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)
Промежуточный тест (по теме 4)	Отсутствуют	Максимальное количество баллов - 8 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)
Промежуточный тест (по теме 5)	Отсутствуют	Максимальное количество баллов - 8 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)
Промежуточный тест (по теме 6)	Отсутствуют	Максимальное количество баллов - 9 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)

Формы текущего контроля	Условия допуска	Критерии и нормы оценки
Задание 1	Отсутствуют	<p>4 балла – тема эссе раскрыта полностью, работа выполнена самостоятельно, чётко выражена позиция автора</p> <p>3 балла – тема эссе недостаточно раскрыта, работа выполнена самостоятельно, позиция автора чётко не выражена</p> <p>2 балла - тема эссе недостаточно раскрыта, работа выполнена недостаточно самостоятельно, позиция автора не выражена</p> <p>1 балл – тема эссе не раскрыта, работа выполнена не самостоятельно, позиция автора не выражена</p> <p>0 баллов – задание не выполнено</p>
Задание 2	Отсутствуют	<p>4 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, сделаны выводы</p> <p>3 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, отсутствуют выводы</p> <p>2 балла – задание выполнено не в полном объёме, есть незначительные замечания</p> <p>1 балла – задание выполнено не в полном объёме, присутствуют существенные замечания</p> <p>0 баллов – задание не выполнено</p>
Заполненная анкета	Отсутствуют	<p>3 балла – анкета заполнена</p> <p>0 – анкета не заполнена</p>
Итоговое тестирование	Отсутствуют	Максимальное количество баллов - 40 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Итого	Отсутствуют	Максимальное количество баллов – 100 б.

Семестр	Форма проведения промежуточной аттестации	Критерии и нормы оценки	
3	Экзамен	«отлично»	Студент набрал 85 и более баллов по накопительному рейтингу
		«хорошо»	Студент набрал от 70 до 84 баллов по накопительному рейтингу
		«удовлетворительно»	Студент набрал от 55 до 69 баллов по накопительному рейтингу
		«неудовлетворительно»	Студент набрал 54 и менее баллов по накопительному рейтингу

8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

8.1. Обязательная литература

№ п/п	Авторы, составители	Заглавие (заголовок)	Тип (учебник, учебное пособие, учебно-методическое пособие, практикум, др.)	Год издания	Количество в научной библиотеке / Наименование ЭБС
1.	Галанов В. А.	Рынок ценных бумаг	учебник	2019	ЭБС «ZNANIUM.COM»
2.	Иванилова С. В.	Биржевое дело	учеб. пособие	2021	ЭБС «IPRbooks»
3.	М. Ю. Евсин, В. А. Спесивцев	Финансовые рынки : практикум	учеб. пособие	2020	ЭБС «ZNANIUM.COM»

8.2. Дополнительная литература

№ п/п	Авторы, составители	Заглавие (заголовок)	Тип (учебник, учебное пособие, учебно- методическое пособие, практикум, др.)	Год издания	Количество в научной библиотеке / Наименование ЭБС
1.	Николаева И. П.	Рынок ценных бумаг	учебник	2018	ЭБС «ZNANIUM.COM»
2.	Кириянов И. В.	Рынок ценных бумаг и биржевое дело	учеб. пособие	2018	ЭБС «ZNANIUM.COM»
3.	Чижик В. П.	Финансовые рынки и институты	учеб. пособие	2018	ЭБС «ZNANIUM.COM»

8.3. Перечень профессиональных баз данных и информационных справочных систем

— WebofScience[Электронный ресурс] : мультидисциплинарная реферативная база данных. – Philadelphia: ClarivateAnalytics, 2016– . – Режим доступа : apps.webofknowledge.com. – Загл. с экрана. – Яз. рус., англ.

— Scopus[Электронный ресурс] : реферативная база данных. – Netherlands: Elsevier, 2004– . – Режим доступа : scopus.com. – Загл. с экрана. – Яз. рус., англ.

— Elibrary[Электронный ресурс] : научная электронная библиотека. – Москва : НЭБ, 2000– . – Режим доступа : elibrary.ru. – Загл. с экрана. – Яз. рус., англ.

— SpringerLink[Электронный ресурс] : [база данных]. – Switzerland: SpringerNature, 1842– . – Режим доступа : link.springer.com. – Загл. с экрана. – Яз. англ.

— ScienceDirect[Электронный ресурс] : коллекция электронных книг издательства Elsevier. – Netherlands: Elsevier, 2018– . – Режим доступа : sciencedirect.com. – Загл. с экрана. – Яз. англ.

— Cambridgeuniversitypress[Электронный ресурс] : журналы издательства. – Cambridge: Cambridgeuniversitypress, 2018– . – Режим доступа : cambridge.org. – Загл. с экрана. – Яз. англ.

— NEICON[Электронный ресурс] : электронная информация : архив научных журналов. – Москва : НЭИКОH, 2002– . – Режим доступа : neicon.ru/resources/archive. – Загл. с экрана. – Яз. рус., англ.

8.4. Перечень программного обеспечения

№ п/п	Наименование ПО	Реквизиты договора (дата, номер, срок действия)
1	Windows: WinPro 10 RUS Upgrd OLP NL Acdmc	договор № 757 от 04.07.2018, срок действия – бессрочно; контракт № 1653 от 14.12.2018, срок действия – бессрочно
2	Office Standard: Office Stdandard 2013 Russian OLP NL AcademicEdition Office Stdandard 2016 Russian OLP NL AcademicEdition	контракт № 690 от 19.05.2015, срок действия – бессрочно договор № 757 от 04.07.2018, срок действия – бессрочно; контракт № 727 от 20.07.2016, срок действия – бессрочно
3	Mirapolis Human Capital Management	лицензионный договор № 614 от 20.06.2023, срок до 31.12.2023 включительно

8.5. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине

№ п/п	Наименование оборудованных учебных кабинетов, лабораторий, мастерских и др. объектов для проведения практических и лабораторных занятий, помещений для самостоятельной работы обучающихся (номер аудитории)	Перечень основного оборудования
1.	Аудитория веб-конференций. Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа. Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа.	Экран телевизионный, ширмы, прожектор на штативе. стол преподавательский, стулья преподавательские., транспарант-

№ п/п	Наименование оборудованных учебных кабинетов, лабораторий, мастерских и др. объектов для проведения практических и лабораторных занятий, помещений для самостоятельной работы обучающихся (номер аудитории)	Перечень основного оборудования
	Учебная аудитория для курсового проектирования (выполнения курсовых работ). Учебная аудитория для проведения групповых и индивидуальных консультаций Учебная аудитория для проведения занятий текущего контроля и промежуточной аттестации. (С-409)	перетяжка, системный блок .
2.	Помещение для самостоятельной работы обучающихся (С-916)	Компьютеры, столы, стулья