

Министерство науки и высшего образования РФ
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«СИБИРСКИЙ ФЕДЕРАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

СОГЛАСОВАНО

Заведующий кафедрой

**Кафедра финансов и управления
рисками**

наименование кафедры

подпись, инициалы, фамилия

«___» _____ 20__ г.

институт, реализующий ОП ВО

УТВЕРЖДАЮ

Заведующий кафедрой

**Кафедра финансов и управления
рисками**

наименование кафедры

**Ферова И.С., д-р.экон.наук,
профессор**

подпись, инициалы, фамилия

«___» _____ 20__ г.

институт, реализующий дисциплину

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
ОПЕРАЦИИ И ФИНАНСОВЫЕ
ИНСТРУМЕНТЫ НА ФОНДОВЫХ
И ТОВАРНЫХ РЫНКАХ**

Дисциплина Б1.В.ДВ.05.01 Операции и финансовые инструменты на
фондовых и товарных рынках

Направление подготовки / 38.05.01 Экономическая безопасность
специальность Специализация 38.05.01.06 Финансово-
экономическое обеспечение федеральных

Направленность
(профиль)

Форма обучения

очная

Год набора

2017

Красноярск 2021

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

составлена в соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по укрупненной группе

380000 «ЭКОНОМИКА И УПРАВЛЕНИЕ»

Направление подготовки /специальность (профиль/специализация)

Специальность 38.05.01 Экономическая безопасность Специализация

38.05.01.06 Финансово-экономическое обеспечение федеральных государственных органов, обеспечивающих безопасность Российской Федерации

Программу
составили

канд. экон. наук, доцент, Кропачев Сергей
Васильевич

1 Цели и задачи изучения дисциплины

1.1 Цель преподавания дисциплины

Основной целью преподавания дисциплины «Операции и финансовые инструменты на фондовых и товарных рынках» является формирование у студентов системы знаний и устойчивых представлений о сущности, структуре, функциях и механизме инвестирования на финансовом рынке, умений и практических навыков, необходимых для инвестирования на фондовом рынке и развитие способности и готовности адекватно и эффективно использовать их (знания, умения и навыки) для снижения рисков инвестирования.

1.2 Задачи изучения дисциплины

Задачи изучения дисциплины:

студенты должны усвоить основные понятия рынка ценных бумаг, ознакомиться с историей приватизации государственных предприятий в России и Красноярском крае, уметь рассчитывать доходность и курсовую стоимость облигаций и акций, сложный процент, дисконтирование и аннуитеты. Применение фьючерсных и опционных стратегий позволит построить арбитражные и малорисковые направления инвестирования на рынке ценных бумаг.

1.3 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

ПК-1: способностью подготавливать исходные данные, необходимые для расчета экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов	
Уровень 3	подходы и методы подготовки и анализа исходной информации для расчетов доходности и курсовой стоимости акций и облигаций, оценки финансовых рисков
Уровень 3	применять подходы и методы подготовки и анализа исходной информации для расчетов доходности и курсовой стоимости акций и облигаций, оценки финансовых рисков
Уровень 3	навыками подготовки и анализа исходной информации для расчетов доходности и курсовой стоимости акций и облигаций, оценки финансовых рисков
ПК-2: способностью обосновывать выбор методик расчета экономических показателей	
Уровень 3	методики расчета доходности и курсовой стоимости акций и облигаций, оценки финансовых рисков
Уровень 3	рассчитывать доходность, курсовую стоимость акций и облигаций, текущую стоимость ценных бумаг, оценивать финансовые риски

Уровень 3	современными методами снижения риска инвестирования на фондовом рынке
-----------	-----------------------------------------------------------------------

1.4 Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Инвестиционный анализ и управление инвестициями

Рынок ценных бумаг

Оценка рисков

Модели управления рисками при реализации государственных программ

1.5 Особенности реализации дисциплины

Язык реализации дисциплины Русский.

Дисциплина (модуль) реализуется без применения ЭО и ДОТ.

2. Объем дисциплины (модуля)

Вид учебной работы	Всего, зачетных единиц (акад.час)	Семестр
		8
Общая трудоемкость дисциплины	3 (108)	3 (108)
Контактная работа с преподавателем:	1 (36)	1 (36)
занятия лекционного типа	0,5 (18)	0,5 (18)
занятия семинарского типа		
в том числе: семинары		
практические занятия	0,5 (18)	0,5 (18)
практикумы		
лабораторные работы		
другие виды контактной работы		
в том числе: групповые консультации		
индивидуальные консультации		
иная внеаудиторная контактная работа:		
групповые занятия		
индивидуальные занятия		
Самостоятельная работа обучающихся:	2 (72)	2 (72)
изучение теоретического курса (ТО)		
расчетно-графические задания, задачи (РГЗ)		
реферат, эссе (Р)		
курсовое проектирование (КП)	Нет	Нет
курсовая работа (КР)	Нет	Нет
Промежуточная аттестация (Зачёт)		

3 Содержание дисциплины (модуля)

3.1 Разделы дисциплины и виды занятий (тематический план занятий)

№ п/п	Модули, темы (разделы) дисциплины	Занятия лекционного типа (акад. час)	Занятия семинарского типа		Самостоятельная работа, (акад. час)	Формируемые компетенции
			Семинары и/или Практические занятия (акад. час)	Лабораторные работы и/или Практикумы (акад. час)		
1	2	3	4	5	6	7
1	Определение акции, облигации. Их виды и классификация	1	1	0	4	ПК-1 ПК-2
2	Приватизация государственных предприятий в России и Красноярском крае	1	1	0	4	ПК-1 ПК-2
3	Доходность и курсовая стоимость облигаций и акций	2	2	0	6	ПК-1 ПК-2
4	Сложный процент, дисконтирование и аннуитеты.	2	2	0	4	ПК-1 ПК-2
5	Форвардные и фьючерсные контракты.	2	2	0	6	ПК-1 ПК-2
6	Опционы колл и пут	2	2	0	6	ПК-1 ПК-2
7	Определение, функции, классификация и подходы к учету финансовых рисков	2	2	0	6	ПК-1 ПК-2

8	Фьючерсные стратегии	2	3	0	12	ПК-1 ПК-2
9	Опционные стратегии	4	3	0	24	ПК-1 ПК-2
Всего		18	18	0	72	

3.2 Занятия лекционного типа

№ п/п	№ раздела дисциплины	Наименование занятий	Объем в акад. часах		
			Всего	в том числе, в инновационной форме	в том числе, в электронной форме
1	1	Определение акции, облигации. Их виды и классификация	1	0	0
2	2	Приватизация государственных предприятий в России и Красноярском крае	1	0	0
3	3	Доходность и курсовая стоимость облигаций и акций	2	0	0
4	4	Сложный процент, дисконтирование и аннуитеты.	2	0	0
5	5	Форвардные и фьючерсные контракты.	2	0	0
6	6	Опционы колл и пут	2	0	0
7	7	Определение, функции, классификация и подходы к учету финансовых рисков	2	0	0
8	8	Фьючерсные стратегии	2	0	0
9	9	Опционные стратегии	4	0	0
Всего			18	0	0

3.3 Занятия семинарского типа

№ п/п	№ раздела дисциплины	Наименование занятий	Объем в акад. часах		
			Всего	в том числе, в инновационной форме	в том числе, в электронной форме
1	1	Определение акции, облигации. Их виды и классификация	1	0	0

2	2	Приватизация государственных предприятий в России и Красноярском крае	1	0	0
3	3	Доходность и курсовая стоимость облигаций и акций	2	0	0
4	4	Сложный процент, дисконтирование и аннуитеты.	2	0	0
5	5	Форвардные и фьючерсные контракты.	2	0	0
6	6	Опционы колл и пут	2	0	0
7	7	Определение, функции, классификация и подходы к учету финансовых рисков	2	0	0
8	8	Фьючерсные стратегии	3	0	0
9	9	Опционные стратегии	3	0	0
Всего			18	0	0

3.4 Лабораторные занятия

№ п/п	№ раздела дисциплины	Наименование занятий	Объем в акад. часах		
			Всего	в том числе, в инновационной форме	в том числе, в электронной форме
Всего					

4 Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л1.1	Курилова А. А.	Управление инвестиционным портфелем: электронное учебное пособие	Тольятти: ТГУ, 2018
Л1.2	Коробейникова О. М., Коробейников Д. А.	Рынок ценных бумаг: учебное пособие для студентов специальности 38.05.01 «экономическая безопасность», специализация «судебная экономическая экспертиза»	Волгоград: Волгоградский ГАУ, 2019

5 Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации

Оценочные средства находятся в приложении к рабочим программам дисциплин.

6 Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

6.1. Основная литература			
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л1.1	Кириянов И. В.	Рынок ценных бумаг и биржевое дело: Учебное пособие	Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2018
Л1.2	Михайлов А.Ю.	Производственные финансовые инструменты: Учебное пособие	Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2018
Л1.3	Галанов В.А.	Производные финансовые инструменты: Учебник	Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2019
Л1.4	Чижик В.П.	Рынок ценных бумаг: Учебное пособие	Москва: Издательство "ФОРУМ", 2020
Л1.5	Галанов В. А.	Рынок ценных бумаг: Учебник	Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2021
Л1.6	Киселев А. Б.	Рынок ценных бумаг: учебное пособие	Кемерово: КузГТУ имени Т.Ф. Горбачева, 2020
6.2. Дополнительная литература			
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Господарчук Г. Г., Господарчук С.А.	Финансовые рынки и финансовые инструменты: Учебное пособие	Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2018

Л2.2	Стародубцева Е. Б.	Рынок ценных бумаг: Учебник	Москва: Издательский Дом "ФОРУМ", 2018
6.3. Методические разработки			
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л3.1	Курилова А. А.	Управление инвестиционным портфелем: электронное учебное пособие	Тольятти: ТГУ, 2018
Л3.2	Коробейникова О. М., Коробейников Д. А.	Рынок ценных бумаг: учебное пособие для студентов специальности 38.05.01 «экономическая безопасность», специализация «судебная экономическая экспертиза»	Волгоград: Волгоградский ГАУ, 2019

7 Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины (модуля)

Э1	РБК	www.rbc.ru
Э2	Национальная Фондовая Ассоциация	www.nfa.ru
Э3	ПАО Московская биржа	www.micex.ru
Э4	Финам	www.finam.ru
Э5	Риски при торговле на фондовом рынке	www.b2forex.com
Э6	Хеджирование фьючерсами на фондовом рынке	www.tickbytick.ru
Э7	Какие есть риски на фондовом рынке и как их избежать?	www.barrel.ru
Э8	Финансовые риски на российском рынке акций	www.stockportal.ru
Э9	Российский рынок облигаций	www.cbonds.ru/index.phtml

8 Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

При изучении теоретического материала по темам и разделам дисциплины «Операции и финансовые инструменты на фондовых и товарных рынках» необходимо использовать нормативные правовые акты (федеральные законы, законы субъектов Российской Федерации, приказы, письма, методические указания, информационные материалы ЦБ РФ, ПАО «Московская биржа» и др.), публикации периодической печати, информационно-справочные системы, такие как «Консультант Плюс», «Гарант» и т.п. Помимо прочего, информационно-справочные системы содержат тематически сгруппированные аннотации и подборки статей, официальные и профессиональные комментарии законов и нормативных актов.

При изучении литературы необходимо уделять особое внимание изучению всех вопросов, входящих в программу курса, а также подготовке ответов на контрольные вопросы к практическим занятиям. На практических занятиях студенты решают задачи и разбирают ситуации по темам дисциплины.

Самостоятельная работа охватывает изучение студентами вопросов теоретического курса, выполнение домашних работ, включающих решение задач, анализ конкретных ситуаций, связанных с деятельностью брокерских и инвестиционных компаний, подготовку доклада и презентации, выполнение групповых заданий, подготовка к экзамену. Таким образом, самостоятельная работа осуществляется в индивидуальном и групповом формате.

Изучение теоретического материала состоит из подготовки к лекциям и семинарским занятиям.

Подготовка к лекциям подразумевает ответы на контрольные вопросы, это позволяет систематизировать знания по теме, облегчает понимание и, следовательно, усвоение материалов лекции студентами, превращая их из пассивных слушателей в активных думающих участников. Этот вид самостоятельной работы предполагает систематические занятия студентов в течение всего семестра. Результатом этого вида работы является конспект лекций, с соответствующими пометками, замечаниями и ответами на вопросы.

Подготовка к семинарским занятиям предусматривает:

- изучение основной и дополнительной литературы;
- ответы на вопросы для самопроверки знаний,
- подготовка к обсуждению вопросов на семинарском занятии.

В процессе самостоятельной работы бакалавры должны подготовить теоретическую базу для обсуждения вопросов семинарского занятия и для эффективного участия в обсуждениях в группах. Результатом данного вида самостоятельной работы студентов будет их выступление на практическом (семинарском) занятии.

Задания по самостоятельному изучению теоретического материала выдаются за неделю до семинарского занятия. Проверка самостоятельной работы осуществляется в форме устного опроса и экспресс-тестирования.

Подготовка тезисов на научную студенческую конференцию включает самостоятельный поиск оригинальных статистических и фактических данных, их систематизацию, осмысление и использование для выступления с докладом на научной студенческой конференции.

Индивидуальные и групповые задания. Задачи для решения дома, а также расчетно-графические задания на практических занятиях.

В процессе обучения по дисциплине «Операции и финансовые инструменты на фондовых и товарных рынках» осуществляется

текущий контроль формирования компетенций по результатам работы на практических занятиях и выполнения самостоятельной работы (доклада, решения задач, индивидуальных и групповых заданий), а также результатов итогового теста.

Формирование компетенций по дисциплине отражается в общей оценке по результатам экзамена, которая складывается из 100 баллов. Оценки определяются следующим образом:

- «удовлетворительно» выставляется в случае набора студентом от 51 балла до 66 баллов включительно;

- «хорошо» выставляется в случае набора студентом от 67 баллов до 83 баллов включительно;

- «отлично» выставляется в случае набора студентом не менее 84 баллов из 100.

Доступ к учебной литературе организован на основе использования электронно-библиотечных систем:

1. Производные финансовые инструменты : учебник / В.А. Галанов. — 2-е изд, перераб. и доп.— М. : ИНФРА-М, 2017. — 221 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). Режим доступа: www.dx.doi.org/10.12737/21804.

2. Опционы: Полный курс для профессионалов: Полный курс для профессионалов. Опционы / Вайн С., - 4-е изд., испр. и доп. - М.:Альпина Пабли., 2016. - 438 с.: 70x100 1/16 ISBN 978-5-9614-5111-5. Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=915809>

Студентам также доступны для использования следующие электронно-библиотечные системы:

1. ЭБС «znanium.com» ООО «Научно-издательский центр ИНФРА-М» [электронный ресурс]: 44926, из них учебников и уч. пособий (за последние 5 лет): 9745, 646 журналов. - режим доступа: <http://znanium.com/>;

2. ЭБС «Лань» ООО «ЭБС Лань» [электронный ресурс]: всего: 42364 книг, 626 журналов, из них по договору 5768 книг. - режим доступа: <https://e.lanbook.com/>;

3. ЭБС «Национальный цифровой ресурс «РУКОНТ» ОАО ЦКБ «БИБКОМ» [электронный ресурс]: кол-во полнотекстовых документов, доступных в ЭБС 919. - режим доступа: <http://www.rucont.ru/>.

4. ЭБС «IBOOKS.RU» [электронный ресурс]: кол-во полнотекстовых документов, доступных в ЭБС 561. - режим доступа: <http://ibooks.ru/> ;

5. ЭБС издательства «проспект» [электронный ресурс]: кол-во полнотекстовых документов, доступных в ЭБС 1100. - режим доступа:<http://ebs.prospekt.org/>

9 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю) (при необходимости)

9.1 Перечень необходимого программного обеспечения

9.1.1	Microsoft® Windows XP (Microsoft® Vista Business Russian Upgrade Academic OPEN No Level) Лиц сертификат 43158512, от 07.12.2007, бессрочный
9.1.2	Microsoft® Office Professional Plus 2007 Russian Academic OPEN No Level - Лиц сертификат 43158512, от 07.12.2007, бессрочный
9.1.3	ESET NOD32 Antivirus Business Edition for 2750 users - Лиц сертификат EAV-0189835462, от 10.04.2017, срок - до 26.04.2018
9.1.4	Справочно-правовая система "КонсультантПлюс" специальный выпуск - ЛСВ (сетевая 50 станций). Договор с ООО ИЦ "Искра" № 21787900202 от 26.05.2016 г. Бессрочный

9.2 Перечень необходимых информационных справочных систем

9.2.1	Электронное средство обучения Moodle, URL адрес http://study.sfu-kras.ru/login/index.php ;
9.2.2	Поисковые системы: Google или Яндекс;
9.2.3	Электронно-библиотечная система обеспечивает возможность индивидуального доступа для каждого обучающегося из любой точки, в которой имеется доступ к сети Интернет Научная библиотека СФУ http://bik.sfu-kras.ru/ ;
9.2.4	Словари. ру. – Режим доступа: http://slovari.ru/dictsearch ;
9.2.5	Электронно-библиотечная система «Лань»: http://e.lanbook.com ;
9.2.6	Электронно-библиотечная система "ИНФРА-М": http://www.znaniium.com ;
9.2.7	Электронная библиотека диссертаций (ЭБД) РГБ: http://dvs.rsl.ru (доступ к полному тексту), http://diss.rsl.ru (доступ к каталогу)
9.2.8	ЭБ Издательского дома «Гребенников»: http://grebennikon.ru ;
9.2.9	Научная электронная библиотека (eLIBRARY.RU): http://elibrary.ru ;
9.2.1 0	Государственный архив Красноярского края (ГАКК): http://красноярские-архивы.рф ;
9.2.1 1	ИАС «Статистика»: http://www.ias-stat.ru ;
9.2.1 2	Электронная библиотека «Гумер» – Режим доступа: http://www.gumer.info/ ;
9.2.1 3	Электронная библиотека «Куб» – Режим доступа: http://www.koob.ru/ ;
9.2.1 4	www.hedging.ru - Хеджинг без риска;
9.2.1 5	www.prognoz.ru - Компания «Прогноз» - разработчик информационно-аналитических систем и систем поддержки принятия решений для банков и финансовых институтов;
9.2.1 6	www.banklist.ru - Аналитический центр для российских банков; w.rbc.ru - РБК;

9.2.1 7	www.cbonds.ru/index.phtml - Российский рынок облигаций;
9.2.1 8	www.riskmanager.ru -Клуб российских риск-менеджеров;
9.2.1 9	www.rrm.rea.ru - РЭА Риск-менеджмент;
9.2.2 0	www.risks.ru - Институт управления рисками;
9.2.2 1	http://www.minfin.ru/ - Министерство финансов РФ;
9.2.2 2	http://www.minregion.ru/ - Министерство экономического развития и торговли РФ.

10 Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)

6 кабинетов с программно-аппаратным комплексом с ПО SANACO LAB 300 на16 мест; проектором PANASONIC PT-F200NT; интерактивной доской Interwrite;интерактивной плазменной панелью Smartboard - пр.Свободный 79, корп.3, 3 этаж и ул. Маерчака 3, 6, 7 этажи;

3 семинарских аудитории с досками обратной проекции SMARTBoard - пр.Свободный 79, корп.3, 3 этаж и ул. Маерчака 3, 6, 7 этажи;

4 компьютерных класса оснащенные компьютерами Kraftway, с досками прямой проекции. Проектор EPSON EMP-X5 - пр.Свободный 79, корп.3, 3 этаж и ул. Маерчака 3, 6, 7 этажи;

6 мобильных тележек (класс AquaCartMC116, специальное ПО для коллективной работы, WindowosXP, мышь оптическая, тележка сейф, проект) - пр.Свободный 79, корп.3, 3 этаж и ул. Маерчака 3, 6, 7 этажи;

6 лекционных аудиторных комплексов снабженных: Мультимедийный проектор Epson EMP-X5, пульт дистанционного управления , Сдвоенная радиосистема Audio-Technica ATW-702/701P; Консоль управления #1 HP TFT7600 RKM в составе LCD монитор и клавиатура; Инсталляционный усилитель мощности Electro-Voice PA2250T; Акустическая система для фонового озвучивания Electro-Voice EVID 4.2Т.Колонка; Компьютер Kraftway Credo модель KC35 - в/контр. Intel GRAPHICS Media Accelerator 950. до224Мб с\контрол. 10/100/100) - пр.Свободный 79, корп.3, 3 этаж и ул. Маерчака 3, 6, 7 этажи.

Информационно-торговая система QUIK для проведения учебных торгов на ПАО"Московская биржа".