

Документ подписан простой электронной подписью
 Информация о владельце:
 ФИО: Зайко Татьяна Ивановна
 Должность: Ректор
 Дата подписания: 30.05.2024 17:22:54
 Уникальный программный ключ:
 cf6863c76438e5984b0fd5e14e7154bfba10e205

ФЕДЕРАЛЬНОЕ АГЕНТСТВО МОРСКОГО И РЕЧНОГО ТРАНСПОРТА

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования "Сибирский государственный университет водного транспорта"

ФТД.01 Биржевое дело

рабочая программа дисциплины (модуля)

Закреплена за кафедрой **Экономики и управления**

Образовательная программа 38.03.02 Направление подготовки "Менеджмент"
 Профиль "Производственный менеджмент"
 год начала подготовки 2022

Квалификация **бакалавр**

Форма обучения **очная**

Общая трудоемкость **1 ЗЕТ**

Часов по учебному плану 36
 в том числе:
 аудиторные занятия 28
 самостоятельная работа 8

Виды контроля в семестрах:
 зачеты 3

Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	3 (2.1)		Итого	
Неделя	15 1/6			
Вид занятий	уп	ип	уп	ип
Лекции	14	14	14	14
Практические	14	14	14	14
Итого ауд.	28	28	28	28
Контактная работа	28	28	28	28
Сам. работа	8	8	8	8
Итого	36	36	36	36

Рабочая программа дисциплины

Биржевое дело

разработана в соответствии с ФГОС:

Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - бакалавриат по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент (приказ Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 970)

составлена на основании учебного плана образовательной программы:

38.03.02 Направление подготовки "Менеджмент"

Профиль "Производственный менеджмент"

год начала подготовки 2022

Рабочую программу составил(и):

ст. преподаватель, Володина Оксана Анатольевна

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры **Экономики и управления**

Заведующий кафедрой Виниченко Виктория Александровна

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1	Цель изучения дисциплины «Биржевое дело» состоит в освоении теоретических и знаний о закономерностях создания и функционирования биржевых рынков, их роли в экономике государства и мировой экономике, Получение теоретических и практических знаний проведении биржевых операций, анализе рынков, прогнозировании биржевых цен.
1.2	Дисциплина «Биржевое дело» является составной частью системы экономических наук и представляет собой прикладную дисциплину, которая опирается на такие фундаментальные дисциплины как высшая математика, макроэкономика, микроэкономика, статистика, экономика предприятия и тесно связана с другими дисциплинами прикладной экономики.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП

Цикл (раздел) ООП:	ФТД
2.1	Требования к предварительной подготовке обучающегося:
2.2	Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:

3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

ПКС-1: Способен использовать инструменты фундаментального и технического анализа при прогнозировании биржевых цен и оценке рисков	
:	

В результате освоения дисциплины обучающийся должен

3.1	Знать:
3.1.1	Место, роль биржевого рынка в экономике, закономерности биржевого ценообразования, организационно-правовые основы деятельности институтов биржевого рынка
3.2	Уметь:
3.2.1	Анализировать текущую ситуацию на биржевом рынке, оценивать влияние различных факторов на цены биржевых активов, проводить фундаментальный и технический анализ биржевых активов, формировать прогноз цен биржевых активов.
3.2.2	Осуществлять различные виды биржевых операций, применять методы снижения рисков биржевых операций.
3.3	Владеть:
3.3.1	Отдельными инструментами фундаментального и технического анализа при прогнозировании цен и оценке рисков.
3.3.2	Механизмами отдельных биржевых операций, в том числе для снижения риска

4. СТРУКТУРА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Вид занятия	Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр / Курс	Часов	Литература	ПрПо дгот
Раздел	Раздел 1. Организация работы биржи				
Лек	Тема 1.1 Понятие биржи. Основные принципы устройства и организации биржевой торговли /Лек/	3	1	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0
Лек	Тема 1.2 Профессиональная деятельность на биржевом рынке /Лек/	3	1	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0
Ср	Тема 1.2 Профессиональная деятельность на биржевом рынке /Ср/	3	5	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0
Лек	Тема 1.3 Технологии биржевой торговли. /Лек/	3	1	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0
Лек	Тема 1.4 Биржевые операции /Лек/	3	2	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0

Пр	Тема 1.4 Биржевые операции /Пр/	3	4	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0
Раздел	Раздел 2. Биржевые товары. Фрахт как транспортный биржевой товар				
Лек	Тема 2.1 Биржевой товар и его свойства /Лек/	3	2	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0
Лек	Тема 2.2 Фьючерсные контракты /Лек/	3	1	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0
Пр	Тема 2.2 Фьючерсные контракты /Пр/	3	3	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0
Лек	Тема 2.3 Ценные бумаги /Лек/	3	2	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0
Раздел	Раздел 3. Расчеты на биржевом рынке				
Лек	Тема 3.1 Проведение расчетов по биржевым сделкам /Лек/	3	1	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0
Пр	Тема 3.2 Доходность биржевых сделок /Пр/	3	4	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0
Раздел	Раздел 4. Прогнозирование биржевых цен				
Лек	Тема 4.1 Виды биржевых цен. Котировочная цена /Лек/	3	1	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0
Лек	Тема 4.2 Методы анализа и прогнозирования биржевых цен /Лек/	3	2	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0
Пр	Тема 4.2 Методы анализа и прогнозирования биржевых цен /Пр/	3	3	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0
Ср	Тема 4.2 Методы анализа и прогнозирования биржевых цен /Ср/	3	3	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0

5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Раздел 1 Организация работы биржи

Тема 1.1 Понятие биржи и основные принципы устройства и организации биржевой торговли. [1,2]

Возникновение биржевой торговли, особенности, биржевой торговли как одной из форм оптовой торговли. Понятие биржи. Функции биржи. Виды бирж. Создание и управление биржей. Устройство торгового зала. Лица, присутствующие в торговом зале. Правила торговли. Жесты и жаргон профессионалов биржевого рынка

Тема 1.2 Профессиональная деятельность на биржевом рынке [1,2,3]

Институты биржевого рынка. Брокерская и дилерская деятельность. Функции брокерских фирм и их место в биржевой торговле. Выбор брокерской фирмы. Виды поручений клиентов брокерам.

Тема 1.3 Технологии биржевой торговли. Биржевые сделки и биржевые операции. [1,2]

Технологии простого, голландского аукционов, онкольный и двухсторонний аукцион. Внебиржевая торговля. Стихийный и дилерский рынок. Классификация биржевых сделок. Сделки спот (кассовые) и срочные сделки. Классификация биржевых операций. Спекуляция ее сущность и значение для рынка. Методы спекуляции. Хеджирование, его сущность, значение и виды. Аут-трейд и способы его проведения.

Тема 1.4 Биржевые операции [2]

Понятие биржевой операции и биржевой сделки. Виды биржевых сделок. Виды биржевых операций. Спекуляция, ее роль на биржевом рынке. Методы спекуляции: позиционная торговля, скалпинг, арбитраж, спред. Опционы как

биржевые инструменты. Виды опционов. Понятия опционной торговли. Определение результатов опционной сделки. Премия опциона и ее структура. Хеджирование. Инструменты биржевого хеджирования. Виды хеджирования. Правила хеджирования. Базис хеджирования. Риск при хеджировании.

Раздел 2 Биржевые товары. Фрахт как транспортный биржевой товар

Тема 2.1 Биржевой товар и его свойства [1,2,3,4]

Требования к биржевому товару. Стандарты и образцы. Виды биржевых товаров. Биржевая торговля фрахтом. Поставка товара.

Тема 2.2 Фьючерсные контракты [1,2, 4]

Фьючерсные контракты как биржевой товар. Отличия фьючерсных контрактов от форвардных. Достоинства фьючерсной торговли. Фьючерсный контракт как инструмент биржевого рынка. .

Тема 2.3 Ценные бумаги [1, 2, 3, 4]

Понятие ЦБ. Оценка «качества» ценных бумаг и процедура листинга. Виды ценных бумаг. Инвестиционные качества ценных бумаг Простые и производственные ценные бумаги. Опционы как ценные бумаги и биржевой инструмент.

Раздел 3 Расчеты на биржевом рынке

Тема 3.1 Проведение расчетов по биржевым сделкам [1,2]

Функции расчетной палаты. Виды счетов. Маржа первоначальная и поддерживаемая. Корректировка по рынку.

Тема 3.2 Доходность биржевых сделок [2,3]

Понятие доходности . Доходность за период. Виды доходности. Простой, сложный, комбинированный проценты. Применение показателя доходности при принятии инвестиционных решений.

Раздел 4 Прогнозирование биржевых цен

Тема 4.1 Виды биржевых цен. Котировочная цена [2,3]

Биржевые цены их виды, назначение и использование. Методики определения котировочной цены.

Тема 4.2 Методы анализа и прогнозирования биржевых цен. [2,3]

Факторы, влияющие на биржевые цены. Фундаментальный анализ, порядок его проведения, достоинства и недостатки. Технический анализ. Виды биржевых графиков. Построение трендов. Аналитические и графические индикаторы.

6. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

6.1. Перечень видов оценочных средств

Решение и защита задач, подготовка к зачёту

6.2. Темы письменных работ

Не предусмотрено

6.3. Контрольные вопросы и задания

Вопросы к зачёту

1. Методы спекуляции. Преимущества и недостатки.
2. Быки и медведи. Их цели. Какие позиции открывают. Бычий и медвежий рынок.
3. Длинные и короткие позиции, как открыть? И как закрыть?
4. Открытие позиции
5. Закрытие позиции
6. Фьючерсный контракт
7. Спецификация фьючерса. Перечислить стандартные параметры.
8. Регулирование поставки по фьючерсным контрактам. Перерасчеты.
9. Спред. Условие спреда. Правило спреда.
10. Виды товаров-предметов спреда.
11. Опцион. Дать определение.
12. Понятия опционной торговли (премия, цена исполнения, исполнение опциона). Три варианта возможностей владельца опциона.
13. Доходность биржевой (финансовой) сделки. Формула для расчета доходности.
14. Виды ценных бумаг в России.

15. Классификация ценных бумаг.
16. Хеджирование. Дать определение.
17. Правило хеджирования будущей сделки.
18. Правило хеджирования уже совершенной сделки.
19. Инструменты хеджирования. Базис хеджирования.
20. Хеджирование на весь срок фьючерса и на часть срока фьючерса. Сравнить риски.
21. Методы анализа и прогнозирования биржевых цен. Перечислить. В чем их суть?
22. Виды биржевых графиков.
23. Расчеты на биржевом рынке. «Маржа». Котировочная цена. Корректировка по рынку.

Тест

Выберите правильный вариант ответа:

Повышение доли спекулятивного капитала на биржевом рынке приводит

1. К снижению ликвидности биржевых активов
2. К повышению ликвидности биржевых активов
3. Ликвидность биржевых активов не зависит от доли спекулятивного капитала

Качество товара по фьючерсному контракту соответствует:

1. стандарту
2. образцу
3. зависит от цены

Выберите правильный вариант ответа:

При каком методе спекуляции открытые позиции удерживаются меньше всего времени?

1. спред
2. скалпинг
3. позиционная торговля

Расчетная палата является:

1. подразделением биржи
2. сторонней организацией, работающей по договору с биржей
3. может быть 1 и 2

Задачи

Решите задачи и дайте ответ:

Сколько выиграет (потеряет) покупатель, купив акцию за 600 рублей, если по ней будут выплачиваться дивиденды в размере 60 рублей в течение 3 лет, по истечении которых ее можно будет продать за 3940 рублей? Норма дисконта 10 (100) % годовых.

Рыночная цена акции 60 рублей. Есть европейский пут-опцион на эту акцию с ценой исполнения 50 рублей. Стоит ли его исполнять, если за него уплачена премия 10 рублей?

6.4. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания

Методика оценки зачета

При условии выполнения требований РПД (М) и отсутствия пропусков занятий зачет по дисциплине (модулю) выставляется обучающемуся без дополнительных испытаний.

При условии выполнения требований РПД (М), но наличии пропусков занятий для получения зачета обучающийся проходит итоговое тестирование.

Итоговый тест по дисциплине содержит теоретическую часть, направленную на оценку знаний и практическую часть, направленную на оценку умений и навыков, характеризующих 1-4 этапы формирования компетенции ПКС-1 «способен использовать инструменты фундаментального и технического анализа при прогнозировании биржевых цен и оценке рисков».

Итоговая оценка со значениями «зачтено–не зачтено», выставляется на основе итогового устного опроса по всем разделам дисциплины. Оценка «не зачтено» ставится в случае, если обучающийся не ответил на 6 вопросов подряд, выбранных преподавателем из опросного листа в случайном порядке. Если из 6 вопросов, выбранных преподавателем из опросного листа в случайном порядке, обучающийся правильно отвечает на 4 вопроса, то он получает оценку «зачтено».

Методика оценки решения задач

Максимальный балл «5» ставится, если обучающийся самостоятельно и правильно решил задачу, объяснил полученный результат в форме вывода.

Средний балл «4» ставится, если обучающийся выполняет требования к получению максимального балла «5», но допускает ошибки, которые исправляет самостоятельно, либо при незначительной помощи преподавателя.

Средний балл «3» ставится, если обучающийся знает алгоритм решения задач данного типа, но не может решить задачу самостоятельно и сделать вывод по результатам решения задачи.

Минимальный балл «2» ставится, если обучающийся способен понять ход решения задачи после объяснения преподавателя и решить задачу без ошибок, либо способен исправить указанные преподавателем ошибки самостоятельно.

Минимальный балл «1» ставится, если обучающийся способен понять ход решения задачи после объяснения преподавателя, но допускает ошибки, которые не может исправить без помощи преподавателя.

Итоговый балл 3 (удовлетворительно), 4(хорошо) или 5 (отлично) соответствует критерию оценивания этапа формирования компетенции «освоен».

Итоговый балл 2 и 1 (неудовлетворительно) соответствует критерию оценивания этапа формирования компетенции «не освоен».

7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

7.1 Рекомендуемая литература

7.1.1. Основная литература

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л1.1	Володина О. А.	Основы биржевого дела. Организационно-правовые основы работы биржи: учебник	Новосибирск: СГУВТ, 2017
Л1.2	Дегтярева Ольга Ильинична	Биржевое дело: учебник	Москва: Магистр; ИНФРА-М, 2014

7.1.2. Дополнительная литература

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Шапкин А. С., Шапкин В. А.	Теория риска и моделирование рискованных ситуаций: учебник	Москва: Дашков и К, 2017

7.2 Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"

Э1	Информационное агентство «РБК»
Э2	Федеральная служба государственной статистики
Э3	Сибирский государственный университет водного транспорта
Э4	Московская биржа

8. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Назначение	Оборудование
Помещение для самостоятельной работы обучающихся	Комплект учебной мебели; ПК – 2 шт., подключенных к сети "Интернет" и обеспечивающих доступ в электронную информационно-образовательную среду Университета
Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа	Аудиторная доска; Комплект учебной мебели; Мультимедийное оборудование: проектор (стационарный), экран (стационарный), ПК (переносной)
Учебная аудитория для проведения практических занятий	Аудиторная доска; Комплект учебной мебели; Мультимедийное оборудование: проектор (стационарный), экран (стационарный), ПК (переносной)
Учебная аудитория для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации	Аудиторная доска; Комплект учебной мебели; Мультимедийное оборудование: проектор (стационарный), экран (стационарный), ПК (переносной)