

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: ЧУМАЧЕНКО ТАТЬЯНА АЛЕКСАНДРОВНА
Должность: РЕКТОР
Дата подписания: 08.02.2022 16:40:46
Уникальный программный ключ:
9c9f7aaffa4840d284abe156657b8f85432bdb16



МИНИСТЕРСТВО ПРОСВЕЩЕНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«ЮЖНО-УРАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ
ГУМАНИТАРНО-ПЕДАГОГИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ»
(ФГБОУ ВО «ЮУрГГПУ»)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Шифр	Наименование дисциплины (модуля)
Б1.В.ДВ	Финансовые рынки и институты

Код направления подготовки	38.03.02
Направление подготовки	Менеджмент
Наименование (я) ОПОП (направленность / профиль)	Управление человеческими ресурсами
Уровень образования	бакалавр
Форма обучения	заочная

Разработчики:

Должность	Учёная степень, звание	Подпись	ФИО
Доцент	Кандидат экономических наук		Федосеев Андрей Васильевич

Рабочая программа рассмотрена и одобрена (обновлена) на заседании кафедры (структурного подразделения)

Кафедра	Заведующий кафедрой	Номер протокола	Дата протокола	Подпись
Кафедра экономики, управления и права	Рябчук Павел Георгиевич	1	28.08.2019	
Кафедра экономики, управления и права	Рябчук Павел Георгиевич	1	13.09.2020	

ОГЛАВЛЕНИЕ

1. Пояснительная записка	3
2. Трудоемкость дисциплины (модуля) и видов занятий по дисциплине (модулю)	4
3. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий	5
4. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины	9
5. Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине (модулю)	11
6. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины	15
7. Перечень образовательных технологий	17
8. Описание материально-технической базы	18

1. ПОЯСНИТЕЛЬНАЯ ЗАПИСКА

1.1 Дисциплина «Финансовые рынки и институты» относится к вариативной части основной профессиональной образовательной программы по направлению подготовки 38.03.02 «Менеджмент» (уровень образования бакалавр).

1.2 Общая трудоемкость дисциплины составляет 2 з.е., 72 час.

1.3 Изучение дисциплины «Финансовые рынки и институты» основано на знаниях, умениях и навыках, полученных при изучении обучающимися следующих дисциплин: «Макроэкономика», «История экономики и экономических учений», «Статистика», «Мировая экономика», «Основы рыночной экономики», «Социология».

1.4 Дисциплина «Финансовые рынки и институты» формирует знания, умения и компетенции, необходимые для освоения следующих дисциплин: «Банковское дело», «Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски», «Финансовый менеджмент», «Финансы, денежное обращение и кредит», «Бухгалтерский учет, экономический анализ, аудит», «Государственное регулирование экономики».

1.5 Цель изучения дисциплины:

формирование у студентов целостного представления о функционировании финансовых рынков, видах и практическом применении финансовых инструментов, механизме принятия инвестиционных решений, портфельном инвестировании.

1.6 Задачи дисциплины:

1) изучение основ дисциплины, основных понятий, теоретических положений, методов и структуры финансовых рынков и финансовой системы

2) изучение экономической сущности ценных бумаг и производных финансовых инструментов, рассмотрение особенностей конкретных видов ценных бумаг, условий их выпуска и обращения, возможностей использования в хозяйственной практике экономических субъектов

3) изучение участников (профессиональных участников, эмитентов, инвесторов) финансовых рынков, их взаимодействия при организации выпуска и обращения ценных бумаг, а также операций различных категорий участников с финансовыми инструментами

4) изучение операций на финансовых рынках, принципов инвестирования.

1.7 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине в форме требований к знаниям, умениям, владениям способами деятельности и навыками их применения в практической деятельности (компетенциям):

№ п/п	Компетенция (содержание и обозначение в соответствии с ФГОС ВО и ОПОП)	Конкретизированные цели освоения дисциплины		
		знать	уметь	владеть
1	ПК-2 владением различными способами разрешения конфликтных ситуаций при проектировании межличностных, групповых и организационных коммуникаций на основе современных технологий управления персоналом, в том числе, в межкультурной среде	3.1 основные характеристики финансовых рынков, функции и принципы взаимодействия их участников, а также методы инвестиционного анализа	У.1 прогнозировать перспективы и тенденции развития финансовых рынков	В.1 инструментами инвестиционного анализа и принятия инвестиционных решений

**2. ТРУДОЕМКОСТЬ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) И ВИДОВ ЗАНЯТИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ
(МОДУЛЮ)**

Наименование раздела дисциплины (темы)	Виды учебной работы, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах)				Итого часов
	Л	ЛЗ	ПЗ	СРС	
Итого по дисциплине	6	2	4	56	68
Первый период контроля					
<i>Роль и функции финансовых рынков в экономике</i>	6	2	4	56	68
Основы и структура финансового рынка	2			6	8
Доходность и риск на финансовом рынке	2	2		4	8
Ценные бумаги. Классификации ценных бумаг	2		2	4	8
Операции на финансовых рынках. Принципы инвестирования			2	6	8
Кредитный рынок				6	6
Рынок драгоценных металлов и драгоценных камней				6	6
Страховой рынок и его участники				6	6
Фондовый рынок				6	6
Институциональные инвесторы на рынке ценных бумаг				6	6
Регулирование финансового рынка				6	6
Итого по видам учебной работы	6	2	4	56	68
<i>Форма промежуточной аттестации</i>					
Зачет					4
Итого за Первый период контроля					72

**3. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ), СТРУКТУРИРОВАННОЕ ПО ТЕМАМ
(РАЗДЕЛАМ) С УКАЗАНИЕМ ОТВЕДЕННОГО НА НИХ КОЛИЧЕСТВА
АКАДЕМИЧЕСКИХ ЧАСОВ И ВИДОВ УЧЕБНЫХ ЗАНЯТИЙ**

3.1 Лекции

Наименование раздела дисциплины (модуля)/ Тема и содержание	Трудоемкость (кол-во часов)
1. Роль и функции финансовых рынков в экономике	6
Формируемые компетенции, образовательные результаты: ПК-2 (3.1, В.1, У.1)	
1.1. Основы и структура финансового рынка 1. Финансовый рынок. 2. Денежный рынок. 3. Финансовая система и финансовый рынок. Учебно-методическая литература: 1, 2, 3, 7, 8 Профессиональные базы данных и информационные справочные системы: 1, 2, 3	2
1.2. Доходность и риск на финансовом рынке 1. Процентные ставки и факторы их определяющие. 2. Доходность и риск на финансовом рынке. 3. Асимметрия информации: ложный выбор и моральный риск. Учебно-методическая литература: 1, 2, 3, 6, 7, 8 Профессиональные базы данных и информационные справочные системы: 1, 2, 3	2
1.3. Ценные бумаги. Классификации ценных бумаг 1. Акции. Обыкновенные и привилегированные акции. 2. Дивиденды. Дивидендная политика. 3. Фондовые индексы. 4. Ценные бумаги, связанные с акциями. Учебно-методическая литература: 1, 2, 3, 6, 7 Профессиональные базы данных и информационные справочные системы: 1, 2, 3	2

3.2 Лабораторные

Наименование раздела дисциплины (модуля)/ Тема и содержание	Трудоемкость (кол-во часов)
1. Роль и функции финансовых рынков в экономике	2
Формируемые компетенции, образовательные результаты: ПК-2 (3.1, В.1, У.1)	
1.1. Доходность и риск на финансовом рынке 1. Виды финансовых посредников (институтов) и их место на финансовом рынке. 2. Депозитные институты. 3. Контрактные институты. Учебно-методическая литература: 1, 2, 3, 4, 6, 7, 8 Профессиональные базы данных и информационные справочные системы: 1, 2	2

3.3 Практические

Наименование раздела дисциплины (модуля)/ Тема и содержание	Трудоемкость (кол-во часов)
1. Роль и функции финансовых рынков в экономике	4
Формируемые компетенции, образовательные результаты: ПК-2 (3.1, В.1, У.1)	
1.1. Ценные бумаги. Классификации ценных бумаг 1. Хеджирование фьючерсными контрактами. 2. Опционы. Виды опционов. 3. Свопы. Виды свопов. Учебно-методическая литература: 1, 2, 3, 6, 7, 8 Профессиональные базы данных и информационные справочные системы: 1, 2	2

<p>1.2. Операции на финансовых рынках. Принципы инвестирования</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Эмиссия эмиссионных ценных бумаг. Этапы эмиссии. 2. Способы размещения эмиссионных ценных бумаг. <p>Учебно-методическая литература: 1, 2, 6, 7, 8 Профессиональные базы данных и информационные справочные системы: 1</p>	2
--	---

3.4 СРС

Наименование раздела дисциплины (модуля)/ Тема для самостоятельного изучения	Трудоемкость (кол-во часов)
1. Роль и функции финансовых рынков в экономике	56
Формируемые компетенции, образовательные результаты: ПК-2 (3.1, В.1, У.1)	
<p>1.1. Основы и структура финансового рынка</p> <p>Задание для самостоятельного выполнения студентом: Изучив лекционный материал, основную и рекомендуемую литературу, подготовить доклад на тему:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Финансовый рынок. 2. Денежный рынок. 3. Финансовая система и финансовый рынок. <p>Учебно-методическая литература: 1, 2, 5, 6, 7, 8 Профессиональные базы данных и информационные справочные системы: 1, 2, 3</p>	6
<p>1.2. Доходность и риск на финансовом рынке</p> <p>Задание для самостоятельного выполнения студентом: Изучив лекционный материал, основную и рекомендуемую литературу, подготовить доклад на тему:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Процентные ставки и факторы их определяющие. 2. Доходность и риск на финансовом рынке. 3. Асимметрия информации: ложный выбор и моральный риск. <p>Учебно-методическая литература: 1, 2, 4, 6, 7, 8 Профессиональные базы данных и информационные справочные системы: 1, 2</p>	4
<p>1.3. Ценные бумаги. Классификации ценных бумаг</p> <p>Задание для самостоятельного выполнения студентом: Изучив лекционный материал, основную и рекомендуемую литературу, подготовить доклад на тему:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Акции. Обыкновенные и привилегированные акции. 2. Дивиденды. Дивидендная политика. 3. Фондовые индексы. 4. Ценные бумаги, связанные с акциями. <p>Учебно-методическая литература: 1, 2, 4, 5, 6, 7 Профессиональные базы данных и информационные справочные системы: 1</p>	4
<p>1.4. Операции на финансовых рынках. Принципы инвестирования</p> <p>Задание для самостоятельного выполнения студентом: Изучив основную и рекомендуемую литературу, подготовить доклад на тему:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Эмиссия эмиссионных ценных бумаг. Этапы эмиссии. 2. Способы размещения эмиссионных ценных бумаг. <p>Учебно-методическая литература: 1, 2, 6, 7, 8 Профессиональные базы данных и информационные справочные системы: 1</p>	6

<p>1.5. Кредитный рынок</p> <p>Задание для самостоятельного выполнения студентом:</p> <p>Изучив основную и рекомендуемую литературу, подготовить доклад на тему:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Понятие кредитного рынка. 2. Функции кредитного рынка. Роль кредитного рынка. 3. Сегменты кредитного рынка. 4. Взаимоотношения кредитного рынка с другими сегментами финансового рынка. 5. Формы и виды кредита <p>Учебно-методическая литература: 1, 2, 3, 4, 5, 7, 8 Профессиональные базы данных и информационные справочные системы: 1</p>	6
<p>1.6. Рынок драгоценных металлов и драгоценных камней</p> <p>Задание для самостоятельного выполнения студентом:</p> <p>Изучив основную и рекомендуемую литературу, подготовить доклад на тему:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Понятие и сущность рынка драгоценных металлов и драгоценных камней. 2. Сегменты рынка ДМ и ДК. Структура рынка ДМ и ДК. 3. Функции рынка ДМ и ДК. 4. Банковские операции на рынке ДМ и ДК. 5. Особенности рынка золота. 6. Специфика рынка ДМ. 7. Роль рынка ДМ и ДК в экономике. <p>Учебно-методическая литература: 1, 2, 3, 7 Профессиональные базы данных и информационные справочные системы: 1, 3</p>	6
<p>1.7. Страховой рынок и его участники</p> <p>Задание для самостоятельного выполнения студентом:</p> <p>Изучив основную и рекомендуемую литературу, подготовить доклад на тему:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Понятие страхового рынка, его функции и место в системе финансового рынка. 2. Структура страхового рынка. 3. Классификация страхования. 4. Организационно-правовые формы страховых компаний. 5. Регулирование страхового рынка. 6. Основные тенденции развития страхового бизнеса. <p>Учебно-методическая литература: 1, 2, 3, 7, 8 Профессиональные базы данных и информационные справочные системы: 1</p>	6
<p>1.8. Фондовый рынок</p> <p>Задание для самостоятельного выполнения студентом:</p> <p>Изучив основную и рекомендуемую литературу, подготовить доклад на тему:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Рынок акций 2. Рынок корпоративных облигаций 3. Государственные и муниципальные ценные бумаги 4. Еврооблигации 5. Производные финансовые инструменты <p>Учебно-методическая литература: 1, 2, 3, 6, 7, 8, 9, 10 Профессиональные базы данных и информационные справочные системы: 1, 3</p>	6
<p>1.9. Институциональные инвесторы на рынке ценных бумаг</p> <p>Задание для самостоятельного выполнения студентом:</p> <p>Изучив основную и рекомендуемую литературу, подготовить доклад на тему:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Понятие институциональных инвесторов, их функции и виды. 2. Инвестиционные фонды как участники рынка ценных бумаг, их виды и функции. 3. Инвестиционные фонды в Российской Федерации: особенности организации и принципы их функционирования. 4. Особенности деятельности паевых инвестиционных фондов. <p>Учебно-методическая литература: 1, 2, 3, 6, 8, 9, 10 Профессиональные базы данных и информационные справочные системы: 1, 2, 3</p>	6

1.10. Регулирование финансового рынка

6

Задание для самостоятельного выполнения студентом:

Изучив основную и рекомендуемую литературу, подготовить доклад на тему:

1. Понятие, виды и цели регулирования.
2. Цели, объекты и субъекты государственного регулирования.
3. Нормативная база регулирования.
4. Методы государственного регулирования.
5. Саморегулируемые организации на рынке ценных бумаг.
6. Перспективы формирования международного финансового центра в России.

Учебно-методическая литература: 1, 2, 3, 6, 7, 8, 10

Профессиональные базы данных и информационные справочные системы: 1

4. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

4.1. Учебно-методическая литература

№ п/п	Библиографическое описание (автор, заглавие, вид издания, место, издательство, год издания, количество страниц)	Ссылка на источник в ЭБС
Основная литература		
1	Рыбин В.Н. Финансовые рынки. Часть 1. Финансовые рынки Российской Федерации [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Рыбин В.Н., Рыбин А.В.— Электрон. текстовые данные.— Москва: Русайнс, 2018.— 73 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/78869.html .— ЭБС «IPRbooks»	http://www.iprbookshop.ru/78869.html
2	Шуляк П.Н. Финансы [Электронный ресурс]: учебник для бакалавров/ Шуляк П.Н., Белотелова Н.П., Белотелова Ж.С.— Электрон. текстовые данные.— Москва: Дашков и К, 2019.— 383 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/85182.html .— ЭБС «IPRbooks»	http://www.iprbookshop.ru/85182.html
3	Николаева И.П. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс]: учебник для бакалавров/ Николаева И.П.— Электрон. текстовые данные.— Москва: Дашков и К, 2018.— 255 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/85269.html .— ЭБС «IPRbooks»	http://www.iprbookshop.ru/85269.html
Дополнительная литература		
4	Строгонова Е.И. Финансы и кредит [Электронный ресурс]: учебное пособие для обучающихся по направлению подготовки бакалавриата «Менеджмент»/ Строгонова Е.И.— Электрон. текстовые данные.— Краснодар, Саратов: Южный институт менеджмента, Ай Пи Эр Медиа, 2018.— 88 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/78049.html .— ЭБС «IPRbooks»	http://www.iprbookshop.ru/78049.html
5	Нешитой А.С. Финансы и кредит [Электронный ресурс]: учебник/ Нешитой А.С.— Электрон. текстовые данные.— Москва: Дашков и К, 2019.— 576 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/85303.html .— ЭБС «IPRbooks»	http://www.iprbookshop.ru/85303.html
6	Мокропуло А.А. Корпоративные финансы [Электронный ресурс]: учебное пособие для обучающихся, по направлению подготовки бакалавриата «Экономика»/ Мокропуло А.А., Саакян А.Г.— Электрон. текстовые данные.— Краснодар, Саратов: Южный институт менеджмента, Ай Пи Эр Медиа, 2018.— 153 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/78371.html .— ЭБС «IPRbooks»	http://www.iprbookshop.ru/78371.html
7	Пробин П.С. Финансовые рынки [Электронный ресурс]: учебное пособие для студентов вузов обучающихся по направлению подготовки «Экономика» (квалификация (степень) «бакалавр»)/ Пробин П.С., Проданова Н.А.— Электрон. текстовые данные.— Москва: ЮНИТИ-ДАНА, 2017.— 175 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/81586.html .— ЭБС «IPRbooks»	http://www.iprbookshop.ru/81586.html
8	Авдокушин Е.Ф. Международные финансовые отношения (основы финансомики) [Электронный ресурс]: учебное пособие для бакалавров/ Авдокушин Е.Ф.— Электрон. текстовые данные.— Москва: Дашков и К, 2019.— 132 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/85596.html .— ЭБС «IPRbooks»	http://www.iprbookshop.ru/85596.html
9	Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс]: учебник для бакалавров/ В.А. Зверев [и др].— Электрон. текстовые данные.— Москва: Дашков и К, 2018.— 256 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/85268.html .— ЭБС «IPRbooks»	http://www.iprbookshop.ru/85268.html
10	Скрипниченко М.В. Фондовые рынки и фондовые операции [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Скрипниченко М.В., Мальцев Д.М., Голубев А.А.— Электрон. текстовые данные.— Санкт-Петербург: Университет ИТМО, 2014.— 91 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/65356.html .— ЭБС «IPRbooks»	http://www.iprbookshop.ru/65356.html

4.2. Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы, используемые при осуществлении образовательного процесса по дисциплине

№ п/п	Наименование базы данных	Ссылка на ресурс
1	База данных «Финансовые рынки» ЦБ РФ	https://www.cbr.ru/finmarket/

2	База данных финансово-экономические показатели Российской Федерации	https://www.minfin.ru/ru/statistics/
3	База данных «Макроэкономика» - информационно-аналитический раздел официального сайта Министерства финансов РФ	http://info.minfin.ru/prices_index.php

5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

5.1. Описание показателей и критериев оценивания компетенций

Код компетенции по ФГОС					
Код образовательного результата дисциплины	Текущий контроль				Промежуточная аттестация
	Доклад/сообщение	Кейс-задачи	Ситуационные задачи	Тест	
ПК-2					
3.1	+			+	+
B.1		+			+
У.1			+		+

5.2. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций.

5.2.1. Текущий контроль.

Типовые задания к разделу "Роль и функции финансовых рынков в экономике":

1. Доклад/сообщение

1. Финансовый рынок: структура, роль в макро- и микроэкономике, участники
2. Фундаментальные факторы, воздействующие на финансовые рынки
3. Финансовая глобализация: сущность, формы проявления, тенденции
4. Сравнительная характеристика финансовых систем
5. Проблема информационных асимметрий на финансовом рынке и ее решение в различных типах финансовых систем
6. Риски на финансовом рынке
7. Секьюритизация финансовых активов: мировой опыт и перспективы на российском фондовом рынке
8. Современное состояние, структура и тенденции развития мирового финансового рынка
9. Мировой рынок акций: современное состояние, проблемы и перспективы развития
10. Мировой рынок облигаций: современное состояние, проблемы и перспективы развития
11. Мировой рынок производных финансовых инструментов: современное состояние, структура, тенденции развития
12. Российский финансовый рынок: современное состояние, структура, перспективы развития
13. Ключевые проблемы развития российского финансового рынка и методы их решения
14. Перспективы формирования мирового финансового центра в России
15. Российский рынок акций: эволюция, современное состояние и перспективы развития
16. Управление акционерным капиталом
17. Корпоративное управление в российских и зарубежных компаниях
18. Недружественные поглощения компаний в российской и зарубежной практике: сущность, технологии, методы противодействия
19. Производные инструменты, связанные с акциями: классификация, область и масштабы применения
20. Рынок корпоративных облигаций в России
21. Рынок «мусорных» облигаций: история, современное состояние и перспективы развития
22. Ипотечные облигации: зарубежный опыт и перспективы на российском рынке
23. Коммерческие бумаги: зарубежный опыт и перспективы на российском рынке
24. Рынок государственных и муниципальных ценных бумаг в России: структура, механизм выпуска и обращения ценных бумаг, риски
25. Рынок евробумаг: структура, механизм эмиссии, операции
26. Вексель: этапы развития, область, масштабы и технологии использования на современном финансовом рынке
27. Использование депозитных и сберегательных сертификатов коммерческих банков в российской и зарубежной практике
28. Товарораспорядительные ценные бумаги: российский и зарубежный опыт
29. Российские ценные бумаги на международных финансовых рынках
30. Фьючерсы и опционы как инструменты хеджирования рисков
31. Рынок производных финансовых инструментов: современное состояние, структура, тенденции развития
32. Финансовый инжиниринг с использованием ценных бумаг и производных финансовых инструментов
33. Выход предприятий на рынок ценных бумаг
34. Конструирование эмиссии ценных бумаг
35. IPO: стратегия, опыт и перспективы для российских компаний.
36. Технология проведения IPO
37. Инвестирование в ценные бумаги иностранных эмитентов: возможности и перспективы для российских инвесторов
38. Рынок слияний и поглощений: зарубежный опыт и российская практика
39. Арбитражные и хеджевые стратегии на финансовом рынке России
40. Спекулятивные стратегии на рынке ценных бумаг
41. Маржинальная торговля на рынке ценных бумаг
42. Залог (заклад) ценных бумаг в операциях на финансовом рынке
43. Недобросовестная деятельность на рынке ценных бумаг и методы ее предупреждения и пресечения
44. Манипулятивные сделки и практика их регулирования
45. Инсайдерские сделки и практика их регулирования
46. Запрещенные торговые практики на рынке ценных бумаг
47. Методы оценки стоимости ценных бумаг
48. Управление портфелем ценных бумаг: понятие, стратегии, риски
49. Модели формирования оптимального портфеля ценных бумаг
50. Модель определения оптимального инвестиционного портфеля Марковица
51. Модель оценки финансовых активов (CAPM) и возможности ее практического применения на российском рынке ценных бумаг
52. Концепция эффективного рынка и ее проверка на российском рынке ценных бумаг
53. Теории оценки финансовых активов (CAPM), арбитражного ценообразования (АРТ) и границы их применения (тестирование на конкретных примерах)
54. Методы анализа конъюнктуры рынка ценных бумаг
55. Фундаментальный анализ и его роль в принятии инвестиционных решений
56. Технический анализ фондовых рынков: зарубежный опыт и возможности использования в российских условиях
57. Электронные сети коммуникаций и альтернативные торговые системы и возможности их использования на российском фондовом рынке
58. Интернет-услуги на рынке ценных бумаг: международный и российский опыт

Количество баллов: 20

2. Кейс-задачи

Составьте структуру международного финансового рынка. Изобразите графически.

— Какие критерии вы использовали для классификации финансового рынка?

— Удалось ли вам сделать единую схему, на которой отражены все виды финансовых рынков? Если нет, то почему?

Количество баллов: 30

3. Ситуационные задачи

Предложите оптимальную стратегию поведения различных субъектов финансового рынка в следующей ситуации:

На рынке торгуется акция А с ценой (по состоянию на 01.XX.2020 г.) равной 56,12\$. С вероятностью 75% ожидается рост цены акции примерно на 20% в течение месяца. С вероятностью 15% цена акции понизится на 15%. С пятипроцентной вероятностью цена облигации не изменится. На рынке в настоящий момент есть американские опционы “пут” на данную акцию с любыми страйками в диапазоне от 50 до 80 долларов США. Опционы “колл” отсутствуют. Также на рынке есть фьючерсы на покупку акций по курсу, на пять процентов превышающем текущую цену и на продажу акций по курсу, меньшим текущего на 12%.

Количество баллов: 25

4. Test

1) Характерной особенностью реализации отношений на рынке являются:

- А) распределение и перераспределение финансовых ресурсов;
- Б) первичный и вторичный продажу эмитированных ценных бумаг;
- В) финансирование финансово-кредитных учреждений;
- Г) финансирования государственных социальных программ;

2) Структура рынка зависит от таких признаков (возможно несколько правильных ответов):

- А) срока обращения финансовых ресурсов;
- Б) инвестиционного состава;
- В) характера движения финансовых ресурсов;
- Г) Все ответы верны;

3) Признак рынка, в зависимости от срока обращения делится на:

- А) рынок ценных бумаг;
- Б) рынок денег, рынок капитала;
- В) рынок прямого финансирования и рынок не прямого финансирования;
- Г) первичный и вторичный рынок;

4) В зависимости с позиций которой рассматриваются финансовые сделки выделяют такие виды признаков финансового рынка:

- А) по принципу оборачиваемости, по характеру движения, формой организации;
- Б) первичный рынок, вторичный рынок;
- В) рынок краткосрочных займов, валютный рынок, рынок краткосрочных финансовых ресурсов;
- Г) рынок ценных бумаг, рынок долгосрочных финансовых займов;

5) Казначейские обязательства, депозитные сертификаты, коммерческие бумаги, банковские акцепты, соглашения об обратном выкупе являются:

- А) Финансовыми объектами рынка;
- Б) Финансовыми средствами рынка;
- В) Финансовыми инструментами рынка;
- 6) Опционы это ценные бумаги, которые:

- А) обязывают поставить определенное количество ценных бумаг на определенный дату;
- Б) обязывают купить определенное количество ценных бумаг на определенный дату;
- В) дают право на продажу или покупку определенного количества ценных бумаг по определенной цене, в определенную дату;
- Г) дают право на продажу определенного количества ценных бумаг, по определенной цене;

7) Если инвестор вкладывает средства в акционерный капитал, такая операция оформляется инструментами собственности:

- А) акциями;
- Б) облигациями;
- В) векселями;
- Г) аккредитивами;

8) Краткосрочные казначейские обязательства рассчитываются на срок до

- А) одного месяца;
- Б) 6 месяцев
- В) одного года;
- Г) до двух лет;

9) Какой из приведенных видов векселя существует:

- А) Хозяйственный вексель;
- Б) Простой вексель;
- В) Сложный вексель;
- Г) Материальное вексель;

10) На рынке ценных бумаг основными прямыми участниками финансовых операций являются:

- А) Эмитенты, инвесторы;
- Б) Кредиторы, поставщики;
- В) Продавцы покупатели;

Г) Юридические и физические лица;

11) Каким видом ценных бумаг можно пользоваться одновременно как на внутреннем так и на внешнем рынке:

- А) Облигация;
- Б) евроакции;
- В) Вексель;
- Г) Акция;

12) Облигация это:

- А) Ценная бумага, удостоверяющая безусловное денежное обязательство векселедателя уплатить после наступления срока определенную сумму денег владельцу векселя;
- Б) Ценная бумага, удостоверяющая внесение ее владельцем денежных средств и подтверждающая обязательство возместить ему номинальную стоимость этой ценной бумаги в предусмотренный в ней срок с выплатой фиксированного процента;
- В) Ценная бумага без установленного срока обращения, удостоверяющая долевое участие в уставном фонде акционерного общества и право на участие в управлении им, дающая право ее владельцу на получение части прибыли в виде дивиденда, а также на участие в распределении имущества при ликвидации акционерного общества;
- Г) Вид ценных бумаг на предъявителя, размещаемых исключительно на добровольных началах среди

5.2.2. Промежуточная аттестация

Промежуточная аттестация проводится в соответствии с Положением о текущем контроле и промежуточной аттестации в ФГБОУ ВО «ЮУрГПУ».

Первый период контроля

1. Зачет

Вопросы к зачету:

1. Финансовый рынок: структура, роль в экономике, участники
2. Фундаментальные факторы, воздействующие на финансовые рынки
3. Проблема информационных асимметрий на финансовом рынке и ее решение в различных типах финансовых систем
4. Риски на финансовом рынке
5. Современное состояние, структура и тенденции развития мирового финансового рынка
6. Мировой рынок производных финансовых инструментов: современное состояние, структура, тенденции развития
7. Российский финансовый рынок: современное состояние, структура, перспективы развития
8. Ключевые проблемы развития российского финансового рынка и методы их решения
9. Перспективы формирования мирового финансового центра в России
10. Российский рынок акций: эволюция, современное состояние и перспективы развития
11. Рынок государственных и муниципальных ценных бумаг в России: структура, механизм выпуска и обращения ценных бумаг, риски
12. Российские ценные бумаги на международных финансовых рынках
13. Финансовый инжиниринг с использованием ценных бумаг и производных финансовых инструментов
14. Инвестирование в ценные бумаги иностранных эмитентов: возможности и перспективы для российских инвесторов
15. Управление портфелем ценных бумаг: понятие, стратегии, риски. Модели формирования оптимального портфеля ценных бумаг
16. Концепция эффективного рынка и ее проверка на российском рынке ценных бумаг
17. Состояние и перспективы развития брокерско-дилерских компаний в России
18. Развитие корпоративного финансирования на российском рынке ценных бумаг
19. Инвесторы на рынке ценных бумаг России
20. Модели регулятивной инфраструктуры рынка ценных бумаг: зарубежный опыт и российская практика
21. Проблемы и тенденции государственного регулирования рынка ценных бумаг в России
22. Саморегулируемые организации на рынке ценных бумаг: зарубежный опыт и практика деятельности в России
23. Защита прав и законных интересов инвесторов в ценные бумаги в российской и зарубежной практике
24. Защита прав акционеров на российском фондовом рынке
25. Развитие информационной инфраструктуры рынка ценных бумаг в России
26. Фондовые индексы и их применение в финансовом и экономическом анализе

Типовые практические задания:

1. Итальянская компания поставляет мрамор в Швейцарию. Валюта цены контракта – евро, оплата мрамора предполагается через 3 месяца после поставки.
Стоимость контракта составляет 1,5 млн. евро. Курс на дату подписания контракта установлен на уровне 1 евро за 1 швейцарский франк. Подвергается ли швейцарский импортер валютному риску? Каковы для него будут финансовые результаты от этой операции в следующих случаях: если курс изменится в сторону усиления швейцарского франка (до 1,2 евро за швейцарский франк); если евро окрепнет до уровня 0,8 евро за швейцарский франк.
Мы видим, что согласно условиям задачи швейцарский импортер подвергается транзакционному валютному риску. Объясните, что вы понимаете под транзакционным валютным риском и как можно хеджировать данный вид риска.
2. Компания из Великобритании имеет дочернюю фирму в США, стоимость чистых активов которой составила на 1 января 560 тыс. долл. США. Курсы валют при этом составляли на 1 января – 1 фунт стерлингов – 1,75 долл. США, на 1 декабря того же года – 1 фунт стерлингов – 1,83 долл. США. Определить результат изменения валютного курса для английской компании.

3. Клиент продает 5 млн евро, а покупает швейцарские франки.

Курсы валют:

USD/ЕВРО – 1,4880 / 1,4890;

USD/ФРАНК – 5,1225 / 5,1240.

Требуется:

- 1) определить курс покупки для клиента;
- 2) определить доход (расход) банка от покупки марок;
- 3) рассчитать курс покупки марок для банка.

5.3. Примерные критерии оценивания ответа студентов на экзамене (зачете):

Отметка	Критерии оценивания
"Отлично"	<ul style="list-style-type: none">-дается комплексная оценка предложенной ситуации-демонстрируются глубокие знания теоретического материала и умение их применять-последовательное, правильное выполнение всех заданий-умение обоснованно излагать свои мысли, делать необходимые выводы
"Хорошо"	<ul style="list-style-type: none">-дается комплексная оценка предложенной ситуации-демонстрируются глубокие знания теоретического материала и умение их применять-последовательное, правильное выполнение всех заданий-возможны единичные ошибки, исправляемые самим студентом после замечания преподавателя-умение обоснованно излагать свои мысли, делать необходимые выводы
"Удовлетворительно" ("зачтено")	<ul style="list-style-type: none">- затруднения с комплексной оценкой предложенной ситуации-неполное теоретическое обоснование, требующее наводящих вопросов преподавателя- выполнение заданий при подсказке преподавателя- затруднения в формулировке выводов
"Неудовлетворительно" ("не зачтено")	<ul style="list-style-type: none">-неправильная оценка предложенной ситуации-отсутствие теоретического обоснования выполнения заданий

6. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

1. Лекции

Лекция - одна из основных форм организации учебного процесса, представляющая собой устное, монологическое, систематическое, последовательное изложение преподавателем учебного материала с демонстрацией слайдов и фильмов. Работа обучающихся на лекции включает в себя: составление или слежение за планом чтения лекции, написание конспекта лекции, дополнение конспекта рекомендованной литературой.

Требования к конспекту лекций: краткость, схематичность, последовательная фиксация основных положений, выводов, формулировок, обобщений. В конспекте нужно помечать важные мысли, выделять ключевые слова, термины. Последующая работа над материалом лекции предусматривает проверку терминов, понятий с помощью энциклопедий, словарей, справочников с выписыванием толкований в тетрадь. В конспекте нужно обозначить вопросы, термины, материал, который вызывает трудности, пометить и попытаться найти ответ в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удается разобраться в материале, необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на консультации, на практическом занятии.

2. Лабораторные

Лабораторные занятия проводятся в специально оборудованных лабораториях с применением необходимых средств обучения (лабораторного оборудования, образцов, нормативных и технических документов и т.п.).

При выполнении лабораторных работ проводятся: подготовка оборудования и приборов к работе, изучение методики работы, воспроизведение изучаемого явления, измерение величин, определение соответствующих характеристик и показателей, обработка данных и их анализ, обобщение результатов. В ходе проведения работ используются план работы и таблицы для записей наблюдений.

При выполнении лабораторной работы студент ведет рабочие записи результатов измерений (испытаний), оформляет расчеты, анализирует полученные данные путем установления их соответствия нормам и/или сравнения с известными в литературе данными и/или данными других студентов. Окончательные результаты оформляются в форме заключения.

3. Практические

Практические (семинарские занятия) представляют собой детализацию лекционного теоретического материала, проводятся в целях закрепления курса и охватывают все основные разделы.

Основной формой проведения практических занятий и семинаров является обсуждение наиболее проблемных и сложных вопросов по отдельным темам, а также решение задач и разбор примеров и ситуаций в аудиторных условиях.

При подготовке к практическому занятию необходимо, ознакомиться с его планом; изучить соответствующие конспекты лекций, главы учебников и методических пособий, разобрать примеры, ознакомиться с дополнительной литературой (справочниками, энциклопедиями, словарями). К наиболее важным и сложным вопросам темы рекомендуется составлять конспекты ответов. Следует готовить все вопросы соответствующего занятия: необходимо уметь давать определения основным понятиям, знать основные положения теории, правила и формулы, предложенные для запоминания к каждой теме.

В ходе практического занятия надо давать конкретные, четкие ответы по существу вопросов, доводить каждую задачу до окончательного решения, демонстрировать понимание проведенных расчетов (анализов, ситуаций), в случае затруднений обращаться к преподавателю.

4. Зачет

Цель зачета – проверка и оценка уровня полученных студентом специальных знаний по учебной дисциплине и соответствующих им умений и навыков, а также умения логически мыслить, аргументировать избранную научную позицию, реагировать на дополнительные вопросы, ориентироваться в массиве информации.

Подготовка к зачету начинается с первого занятия по дисциплине, на котором обучающиеся получают предварительный перечень вопросов к зачету и список рекомендуемой литературы, их ставят в известность относительно критериев выставления зачета и специфике текущей и итоговой аттестации. С самого начала желательно планомерно осваивать материал, руководствуясь перечнем вопросов к зачету и списком рекомендуемой литературы, а также путем самостоятельного конспектирования материалов занятий и результатов самостоятельного изучения учебных вопросов.

По результатам сдачи зачета выставляется оценка «зачтено» или «не зачтено».

5. Доклад/сообщение

Доклад – развернутое устное (возможен письменный вариант) сообщение по определенной теме, сделанное публично, в котором обобщается информация из одного или нескольких источников, представляется и обосновывается отношение к описываемой теме.

Основные этапы подготовки доклада:

1. четко сформулировать тему;
2. изучить и подобрать литературу, рекомендуемую по теме, выделив три источника библиографической информации:
 - первичные (статьи, диссертации, монографии и т. д.);
 - вторичные (библиография, реферативные журналы, сигнальная информация, планы, граф-схемы, предметные указатели и т. д.);
 - третичные (обзоры, компилятивные работы, справочные книги и т. д.);
3. написать план, который полностью согласуется с выбранной темой и логично раскрывает ее;
4. написать доклад, соблюдая следующие требования:
 - структура доклада должна включать краткое введение, обосновывающее актуальность проблемы; основной текст; заключение с краткими выводами по исследуемой проблеме; список использованной литературы;
 - в содержании доклада общие положения надо подкрепить и пояснить конкретными примерами; не пересказывать отдельные главы учебника или учебного пособия, а изложить собственные соображения по существу рассматриваемых вопросов, внести свои предложения;
5. оформить работу в соответствии с требованиями.

6. Ситуационные задачи

Ситуационная задача представляет собой задание, которое включает в себя характеристику ситуации из которой нужно выйти, или предложить ее исправить; охарактеризовать условия, в которых может возникнуть та или иная ситуация и предложить найти выход из нее и т.д.

При выполнении ситуационной задачи необходимо соблюдать следующие указания:

1. Внимательно прочитать текст предложенной задачи и вопросы к ней.
2. Все вопросы логично связаны с самой предложенной задачей, поэтому необходимо работать с каждым из вопросов отдельно.
3. Вопросы к задаче расположены по мере усложнения, поэтому желательно работать с ними в том порядке, в котором они поставлены.

7. Тест

Тест это система стандартизованных вопросов (заданий), позволяющих автоматизировать процедуру измерения уровня знаний и умений обучающихся. Тесты могут быть аудиторными и внеаудиторными. Преподаватель доводит до сведения студентов информацию о проведении теста, его форме, а также о разделе (теме) дисциплины, выносимой на тестирование.

При самостоятельной подготовке к тестированию студенту необходимо:

- проработать информационный материал по дисциплине. Проконсультироваться с преподавателем по вопросу выбора учебной литературы;
- выяснить все условия тестирования заранее. Необходимо знать, сколько тестов вам будет предложено, сколько времени отводится на тестирование, какова система оценки результатов и т.д.
- работая с тестами, внимательно и до конца прочесть вопрос и предлагаемые варианты ответов; выбрать правильные (их может быть несколько); на отдельном листке ответов выписать цифру вопроса и буквы, соответствующие правильным ответам. В случае компьютерного тестирования указать ответ в соответствующем поле (полях);
- в процессе решения желательно применять несколько подходов в решении задания. Это позволяет максимально гибко оперировать методами решения, находя каждый раз оптимальный вариант.
- решить в первую очередь задания, не вызывающие трудностей, к трудному вопросу вернуться в конце.
- оставить время для проверки ответов, чтобы избежать механических ошибок.

8. Кейс-задачи

Кейс – это описание конкретной ситуации, отражающей какую-либо практическую проблему, анализ и поиск решения которой позволяет развивать у обучающихся самостоятельность мышления, способность выслушивать и учитывать альтернативную точку зрения, а также аргументировано отстаивать собственную позицию.

Рекомендации по работе с кейсом:

1. Сначала необходимо прочитать всю имеющуюся информацию, чтобы составить целостное представление о ситуации; не следует сразу анализировать эту информацию, желательно лишь выделить в ней данные, показавшиеся важными.
2. Требуется охарактеризовать ситуацию, определить ее сущность и отметить второстепенные элементы, а также сформулировать основную проблему и проблемы, ей подчиненные. Важно оценить все факты, касающиеся основной проблемы (не все факты, изложенные в ситуации, могут быть прямо связаны с ней), и попытаться установить взаимосвязь между приведенными данными.
3. Следует сформулировать критерий для проверки правильности предложенного решения, попытаться найти альтернативные способы решения, если такие существуют, и определить вариант, наиболее удовлетворяющий выбранному критерию.
4. В заключении необходимо разработать перечень практических мероприятий по реализации предложенного решения.
5. Для презентации решения кейса необходимо визуализировать решение (в виде электронной презентации, изображения на доске и пр.), а также оформить письменный отчет по кейсу.

7. ПЕРЕЧЕНЬ ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫХ ТЕХНОЛОГИЙ

1. Кейс-технологии
2. Проектные технологии

8. ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ

1. компьютерный класс – аудитория для самостоятельной работы
2. учебная аудитория для лекционных занятий
3. учебная аудитория для семинарских, практических занятий
4. Лицензионное программное обеспечение:
 - Операционная система Windows 10
 - Microsoft Office Professional Plus
 - Антивирусное программное обеспечение Kaspersky Endpoint Security для бизнеса - Стандартный Russian Edition
 - Справочная правовая система Консультант плюс
 - 7-zip
 - Adobe Acrobat Reader DC