

МИНОБРНАУКИ РОССИИ
федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования
«Кузбасский государственный технический университет имени Т. Ф. Горбачева»

Филиал КузГТУ в г. Новокузнецке

УТВЕРЖДЕНО
Ученым советом филиала
КузГТУ в г. Новокузнецке
Протокол № 10 от 31 мая 2022

Рабочая программа дисциплины

Финансовые рынки и институты

Направление подготовки 38.03.01 Экономика
Направленность (профиль) 02 Финансы и кредит

Присваиваемая квалификация
«Бакалавр»

Формы обучения
очная, очно-заочная

Рабочая программа обсуждена на заседании
учебно-методического совета филиала КузГТУ
в г. Новокузнецке
Протокол № 5 от 18.05.2022

СОГЛАСОВАНО:
Заместитель директора по УР
 Е. А. Нагрелли

Новокузнецк 2022 г.

1 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине "Финансовые рынки и институты", соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Освоение дисциплины направлено на формирование:
 профессиональных компетенций:

ПК-7 - Способность выявлять, собирать и анализировать информацию бизнес-анализа для формирования возможных решений, способность описывать возможные решения

Результаты обучения по дисциплине определяются индикаторами достижения компетенций

Индикатор(ы) достижения:

способен собрать необходимые данные, проанализировать их, подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет

Результаты обучения по дисциплине:

Знать: основы построения, расчета и анализа современной системы показателей, характеризующих

- деятельность хозяйствующих субъектов на микро- и макроуровне.

Уметь: 1) использовать знания по теории финансовых рынков для принятия инвестиционных

- решений; 2) формулировать перспективы и тенденции развития финансовых рынков; 3) проводить

- самостоятельный инвестиционный анализ и принимать инвестиционные решения; 4) управлять

- финансовыми рисками по сформированному инвестиционному портфелю

Владеть: 1) системным представлением о структуре и тенденциях развития российских и

- международных рынков ценных бумаг; 2) навыками анализа экономических процессов,

- происходящих на финансовых рынках.

-

2 Место дисциплины "Финансовые рынки и институты" в структуре ОПОП бакалавриата

Для освоения дисциплины необходимы знания умения, навыки и (или) опыт профессиональной деятельности, полученные в рамках изучения следующих дисциплин: Деньги, кредит, банки, Корпоративные финансы, Экономическая безопасность, Экономическая теория, Экономика и управление организацией.

Дисциплина входит в Блок 1 «Дисциплины (модули)» ОПОП. Цель дисциплины - получение обучающимися знаний, умений, навыков и (или) опыта профессиональной деятельности, необходимых для формирования компетенций, указанных в пункте 1.

3 Объем дисциплины "Финансовые рынки и институты" в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам занятий) и на самостоятельную работу обучающихся

Общая трудоемкость дисциплины "Финансовые рынки и институты" составляет 8 зачетных единиц, 288 часов.

Форма обучения	Количество часов		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ
Курс 4/Семестр 7			
Всего часов	144		144
Контактная работа обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий):			
Аудиторная работа			
Лекции	16		4
Электронные лекции	16		4
Лабораторные занятия			
Практические занятия	16		4
Электронные практические занятия	16		4
Внеаудиторная работа			



1622171119

Форма обучения	Количество часов		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ
Индивидуальная работа с преподавателем:			
Консультация и иные виды учебной деятельности			
Самостоятельная работа	76		100
Форма промежуточной аттестации	экзамен /36		экзамен /36
Курс 4/Семестр 8			
Всего часов	144		144
Контактная работа обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий):			
Аудиторная работа			
Лекции	16	4	
Электронные лекции	16	4	
Лабораторные занятия			
Практические занятия	16	4	
Электронные практические занятия	16	4	
Внеаудиторная работа			
Индивидуальная работа с преподавателем:			
Консультация и иные виды учебной деятельности			
Самостоятельная работа	112		136
Форма промежуточной аттестации	зачет		зачет

4 Содержание дисциплины "Финансовые рынки и институты", структурированное по разделам (темам)

4.1. Лекционные занятия

1 семестр

Раздел дисциплины, темы лекций и их содержание	Трудоемкость в часах		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ
1. Роль и функции финансовых рынков в экономике. Сущность понятия «финансовый рынок». Виды финансовых рынков в экономике. Функции финансового рынка. Структура финансового рынка. Доходность и риск на финансовом рынке. Виды рисков, связанных с ценными бумагами.	4	-	1
2. Инструменты финансовых рынков. Основные инструменты финансовых рынков. Сущность, содержание и виды ценных бумаг. Акции. Обыкновенные и привилегированные акции. Стоимость акций. Показатели доходности акций. Облигации. Классификация облигаций. Стоимостная оценка и оценка доходности облигаций. Вексель. Виды векселей. Индоссамент. Ответственность по вексельному обязательству. Стоимостная оценка векселя. Доходность векселей. Депозитные и сберегательные сертификаты. Производные финансовые инструменты, их функции и цели применения.	4	-	1
3. Институты финансовых рынков. Виды финансовых посредников. Банки. Брокерско-дилерские компании. Профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг. Институциональные инвесторы. Страховые компании. Пенсионные фонды. Институты коллективного инвестирования. Фондовая биржа. Участники биржевых торгов. Листинг и делистинг. Механизм биржевой торговли. Виды биржевых аукционов.	4	-	1
4. Управление рисками на финансовых рынках. Классические методы управления рисками на рынке ценных бумаг. Управление рисками трейдеров, брокерских, дилерских и др. компаний. Уклонение от риска: отказ от ненадежных партнеров, отказ от рискованных проектов, страхование хозяйственных рисков, поиск гарантов. Упреждение рисков. Локализация: венчурные предприятия, создание специальных структурных подразделений (собособленным балансом) для выполнения рискованных проектов, заключение договоров о совместной деятельности для реализации рискованных проектов. Диссипация риска: диверсификация и ее возможности. Самострахование как метод компенсации риска: система резервов, подходы к формированию, механизм использования, преимущества и недостатки. Трансферт риска. Страхование риска. Механизм использования инвестиционных рисков. Секьюритизация рисков.	4	-	1

Итого	16	-	4
-------	----	---	---

2 семестр

Раздел дисциплины, темы лекций и их содержание	Трудоемкость в часах		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ
1. Регулирование финансовых рынков. Государственное регулирование финансового рынка. Защита прав и законных интересов инвесторов как важнейшая функция государства на финансовом рынке. Саморегулирование финансового рынка.	4	-	1
2. Оценка эффективности реальных инвестиций. Бюджетная (социальная) эффективность проектов. Экономическая оценка эффективности инвестиционных проектов.	4	-	1
3. Показатели качества ценных бумаг. Виды оцениваемых ценных бумаг. Инвестиционные показатели качества ценных бумаг. Формы рейтинговой оценки. Экономическая эффективность финансовых инвестиций. Использование цифровых коммуникаций.	4	-	1
4. Операции на финансовых рынках. Принципы инвестирования. Кассовые и срочные сделки. Маржинальные сделки. Сделки РЕПО. Инвестиционный портфель. Пассивные и активные стратегии управления инвестиционным портфелем. Понятие фундаментального анализа. Понятие и постулаты технического анализа. Методы технического анализа с использованием компьютерных систем.	4	-	1
Итого	16	-	4

4.2 Практические (семинарские) занятия

1 семестр

Тема занятия	Трудоемкость в часах		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ
1. Роль и функции финансовых рынков в экономике	4	-	1
2. Инструменты финансовых рынков	4	-	1
3. Институты финансовых рынков	4	-	1
4. Управление рисками на финансовых рынках	4	-	1
Итого	16	-	4

2 семестр

Тема занятия	Трудоемкость в часах		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ
1. Регулирование финансовых рынков	4	-	1
2. Оценка эффективности реальных инвестиций	4	-	1
3. Показатели качества ценных бумаг	4	-	1
4. Операции на финансовых рынках.	4	-	1
Итого	16	-	4

4.3 Самостоятельная работа обучающегося и перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

1 семестр

Вид СРС	Трудоемкость в часах		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ
1. Ознакомление с содержанием основной и дополнительной литературы, методических материалов, конспектов лекций для подготовки к занятиям	46	-	70
2. Подготовка к тестированию	30	-	30
3. Подготовка к промежуточной аттестации	36	-	36
Итого:	112	-	136

2 семестр

Вид СРС	Трудоемкость в часах		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ



1622171119

1.Ознакомление с содержанием основной и дополнительной литературы, методических материалов, конспектов лекций для подготовки к занятиям	82	-	100
2. Подготовка к тестированию	30	-	36
Итого:	112	-	136

5 Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине "Финансовые рынки и институты"

5.1 Паспорт фонда оценочных средств

Формы текущего контроля	Компетенции, формируемые в результате освоения дисциплины	Индикатор достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине	Уровень
Опрос по контрольным вопросам, проведение контрольных работ, тестирование	ПК-7	способен собрать необходимые данные, проанализировать их, подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет	<p>Знать: основы построения, расчета и анализа современной системы показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов на микро- и макроуровне.</p> <p>Уметь: 1) использовать знания по теории финансовых рынков для принятия инвестиционных решений; 2) формулировать перспективы и тенденции развития финансовых рынков; 3) проводить самостоятельный инвестиционный анализ и принимать инвестиционные решения; 4) управлять финансовыми рисками по сформированному инвестиционному портфелю</p> <p>Владеть: 1) системным представлением о структуре и тенденциях развития российских и международных рынков ценных бумаг; 2) навыками анализа экономических процессов, происходящих на финансовых рынках.</p>	Высокий или средний



1622171119

Высокий уровень достижения компетенции - компетенция сформирована частично, рекомендованные оценки: отлично, хорошо, зачтено.
Средний уровень достижения компетенции - компетенция сформирована частично, рекомендованные оценки: хорошо, удовлетворительно, зачтено.
Низкий уровень достижения компетенции - компетенция не сформирована частично, оценивается неудовлетворительно или не зачтено.

5.2.1. Оценочные средства при текущей аттестации

Текущий контроль успеваемости и аттестационные испытания обучающихся могут быть организованы с использованием ресурсов ЭИОС КузГТУ.

Текущий контроль по темам 1, 3 заключается в опросе по контрольным вопросам и проведению контрольных работ по темам 2, 4. Возможно проведение контроля с использованием ресурсов ЭИОС КузГТУ.

Опрос по контрольным вопросам:

При проведении текущего контроля обучающимся будет письменно, либо устно задано два вопроса, на которые они должны дать ответы.

Примерный перечень контрольных вопросов:

1 семестр	2 семестр
Тема 1. Роль и функции финансовых рынков в экономике. 1. Сущность понятия «финансовый рынок». Виды финансовых рынков в экономике. 2. Функции финансового рынка. 3. Структура финансового рынка. 4. Доходность и риск на финансовом рынке.	Тема 1. Регулирование финансовых рынков. 1. Государственное регулирование финансового рынка. 2. Саморегулирование финансового рынка.
Тема 3. Институты финансовых рынков. 1. Виды финансовых посредников. 2. Профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг. 3. Институциональные инвесторы. 4. Фондовая биржа. Механизм биржевой торговли. 5. Участники биржевых торгов.	Тема 3. Показатели качества ценных бумаг. 1. Инвестиционные показатели качества ценных бумаг. 2. Формы рейтинговой оценки. 3. Экономическая эффективность финансовых инвестиций.

Критерии оценивания:

- 85-100 баллов - при правильном и полном ответе на два вопроса;

- 65-84 баллов - при правильном и полном ответе на один из вопросов и правильном, но не полном ответе на другой из вопросов;

- 25-64 баллов - при правильном и неполном ответе только на один из вопросов;

- 0-24 баллов - при отсутствии правильных ответов на вопросы.

Количество баллов	0-24	25-64	65-84	85-100
Шкала оценивания	неуд	удовл	хорошо	отлично

Порядок проведения контрольных работ

Контрольные работы по темам 2, 4 состоят из 5 заданий.

Примеры задач для проведения контрольных работ:

1 семестр	2 семестр
-----------	-----------



1622171119

<p>Тема 3. Инструменты финансовых рынков.</p> <p>1. Организация приобрела за 90 % от номинала депозитный сертификат со сроком погашения через 6 месяцев номинальной стоимостью 200 тыс. руб. Определить годовую доходность: 1) если организация дожждется окончания срока обращения сертификата; 2) если владелец сертификата решит через 3 месяца его продать по ставке дисконта по 3-х месячным сертификатам 4%.</p> <p>2. Через 81 день после выдачи векселя векселедержатель полностью погасил его, выплатив 100000 руб. Определить вексельную сумму, если в векселе указана процентная ставка 28,9 %. Год считать равным 360 дням.</p>	<p>Тема 2. Оценка эффективности реальных инвестиций.</p> <p>1. Проект рассчитан на три года, объём инвестиций – 126 млн. руб. Чистый денежный поток: 1-й год 45 млн. руб.; 2-й год 54 млн. руб.; 3-й год 75 млн. руб. Определить чистую текущую стоимость проекта и индекс рентабельности инвестиционного проекта. Ставку дисконтирования определить исходя из сложившейся ситуации на рынке. Премия за риск 10 %.</p> <p>2. На предприятии осуществлены реконструкция и техническое перевооружение производства, на проведение которых было израсходовано 5 млн. руб. в результате этого денежные поступления по годам за расчетный период составили: 1 год – 1,2 млн. руб.; 2 год – 1,8млн. руб.; 3 год – 2,0 млн. руб.; 4 год – 2,5 млн. руб.; 5 год – 1,5 млн. руб. Ставка дисконта составляет 20% годовых. Определите срок окупаемости с использованием дисконтированных поступлений и без учета дисконтированных поступлений.</p>
<p>Тема 4. Управление рисками на финансовых рынках</p> <p>1. Хозяйствующий субъект предполагает произвести платежи в ближайшем будущем в иностранной валюте в будущем. Он заключает форвардный контракт на покупку валюты с параметрами: сумма 10000 евро; срок исполнения через 3 месяца; курс рубля за 1 евро 90 руб. Определить затраты хозяйствующего субъекта и его действия в ситуации: а) курс на рынке 93 руб.; б) курс на рынке 88 руб. Как следует повести себя хозяйствующему субъекту в каждом из случаев? Ответ обосновать.</p> <p>2. На основе котировок обыкновенных акций на ММВБ (минимум 2-х компаний), применив статистический метод анализа сделать вывод о целесообразности вложения капитала по данным направлениям. Минимальное количество случаев наблюдения 10. Колеблемость акций эмитентов анализируется за одинаковые периоды времени (день, неделя, месяц, год). Выбор компании-эмитента студент осуществляет самостоятельно.</p>	<p>4. Операции на финансовых рынках.</p> <p>1. Текущая цена акции компании А составляет на дату t_0 850 руб. Остаток средств на счете инвестора 200000 руб. Инвестор ожидает роста котировок в течение ближайших 45 дней. На дату t_1 цена акции А составила: а) 950 руб.; б) 700 руб. Определите финансовый результат операции. Комиссия брокера 0,05 %. Брокер кредитует инвестора с плечом 1:1. Плата за кредит 20 % годовых. Рассмотрите также ситуацию, когда инвестор использует только собственные средства.</p> <p>2. Проведите простой технический анализ динамики цены любого биржевого актива. Постройте по видимым максимумам и минимумам графика линии поддержки/сопротивления, линии тренда и линии канала. При решении задачи необходимо ответить на следующие вопросы: испытывает ли цена сопротивление при преодолении уровней? Как часто цена «отскакивает» от линий и уровней, как часто «пробивает» их? Насколько «масштабные» линии влияют на движение цены?</p>

Критерии оценки контрольных работ

Верное выполнение заданий 1-5 оценивается 2 баллами. За неверное решение или отсутствие решения выставляется 0 баллов. Частично правильное решение задания оценивается в 1 балл. Максимальное количество баллов (верное выполнение всех заданий) оценивается в 10 баллов.

Шкала оценивания результатов контрольных работ:

Количество баллов	0-2	3-5	6-8	9-10
Шкала оценивания	неуд	удовл	хорошо	отлично

Тестирование:

При проведении текущего контроля обучающихся с помощью ресурсов ЭИОС КузГТУ необходимо выполнить 30 тестовых заданий.

Примеры тестовых заданий:

1 семестр	2 семестр
-----------	-----------



1622171119

<p>Тема 1. Роль и функции финансовых рынков в экономике</p> <p>1. Понятие конъюнктуры рынка ценных бумаг включает:</p> <p>а) соотношение между спросом и предложением на ценные бумаги, колеблющиеся под влиянием различных экономических и политических факторов.</p> <p>б) совокупность ценовых показателей в отдельный момент времени для бумаг.</p> <p>в) совокупность ценных бумаг, обращающихся на рынке ценных бумаг.</p> <p>г) совокупность эмитентов и инвесторов - участников рынка ценных бумаг.</p> <p>2. При продаже центральным банком ценных бумаг на открытом рынке денежная масса:</p> <p>а) увеличивается;</p> <p>б) уменьшается;</p> <p>в) неизменна.</p>	<p>Тема 1. Регулирование финансовых рынков.</p> <p>1. Акционер АО имеет право требовать доступ к информации о количестве акций других акционеров АО:</p> <p>а) не имеет.</p> <p>б) да, если он владеет свыше 5% голосующих акций.</p> <p>в) да, если он владеет свыше 3% голосующих акций.</p> <p>г) да, если он владеет свыше 1% голосующих акций.</p> <p>2. Самая жесткая система государственного регулирования рынка ценных бумаг сформировалась:</p> <p>а) в России.</p> <p>б) в США.</p> <p>в) в Германии;</p> <p>г) в Японии.</p> <p>д) в США.</p>
<p>Тема 2. Инструменты финансовых рынков</p> <p>1. Тратта - это:</p> <p>а) платательщик по переводному векселю.</p> <p>б) согласие платателя оплатить вексель.</p> <p>в) переводной вексель.</p> <p>г) векселедатель переводного векселя.</p> <p>2. Типы привилегированных акций - это:</p> <p>а) некумулятивные.</p> <p>б) с фиксированным дивидендом.</p> <p>в) неголосующие.</p> <p>г) с ограниченным правом голоса.</p>	<p>Тема 2. Оценка эффективности реальных инвестиций.</p> <p>1. Для определения IRR проекта используется метод:</p> <p>а) Критического пути.</p> <p>б) Цепных подстановок.</p> <p>в) Последовательных итераций.</p> <p>2. Дисконтирование - это:</p> <p>а) Процесс вложения денег равными долями через равные промежутки времени.</p> <p>б) Приведение денежного потока инвестиционного проекта к единому моменту времени.</p> <p>в) Определение ожидаемого дохода от инвестиционного проекта.</p>
<p>Тема 3. Институты финансовых рынков</p> <p>1. Фондовая биржа должна иметь лицензию:</p> <p>а) профессионального участника рынка ценных бумаг;</p> <p>б) фондовой биржи;</p> <p>в) регистратора;</p> <p>г) клиринговой компании.</p> <p>2. Видом профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг является деятельность:</p> <p>а) дилерская.</p> <p>б) страховая.</p> <p>в) депозитарная.</p> <p>г) депозитарная.</p>	<p>Тема 3. Показатели качества ценных бумаг</p> <p>1. Ликвидность финансового актива - это:</p> <p>а) возможность быстрого обмена финансового актива на денежные средства без существенных потерь.</p> <p>б) возможность совершения сделок купли-продажи финансового актива.</p> <p>в) установление цены финансового актива на основе спроса и предложения.</p> <p>г) установление цены на финансовый актив на основе биржевых торгов.</p> <p>2. Доходность ценной бумаги зависит от риска:</p> <p>а) прямо пропорционально.</p> <p>б) обратно пропорционально.</p> <p>в) не зависит.</p>
<p>Тема 4. Управление рисками на финансовых рынках</p> <p>1. По мере снижения рисков, которые несет на себе ценная бумага:</p> <p>а) падает её ликвидность.</p> <p>б) растет её доходность.</p> <p>в) растет ее ликвидность и падает ее доходность.</p> <p>2. Хеджирование - это:</p> <p>а) "продажа" риска.</p> <p>б) "покупка" риска.</p> <p>в) совершение сделок "без риска".</p>	<p>4. Операции на финансовых рынках. Принципы инвестирования.</p> <p>1. Как называется портфель, который формируется из наиболее рискованных, но и самых доходных ценных бумаг?</p> <p>а) агрессивный;</p> <p>б) прогрессивный;</p> <p>в) безсистемный.</p> <p>2. Срочные биржевые сделки - это:</p> <p>а) сделки, которые исполняются немедленно.</p> <p>б) сделки, которые исполняются в определенный момент в будущем.</p> <p>в) сделки, предполагающие поставку против платежа.</p> <p>г) сделки, расчет по которым осуществляется не позднее определенной даты (например, даты T+5, где T - день заключения сделки).</p>



Критерии оценивания тестовых заданий:

- 85-100 баллов – при правильном ответе на > 85% вопросов;
- 65-84 баллов – при правильном ответе на > 65% вопросов;
- 25-64 баллов – при правильном ответе на > 50% вопросов;
- 0-24 баллов – при отсутствии правильных ответов на вопросы.

Количество баллов	0-50	50-75	76-84	85-100
Шкала оценивания	неуд	удовл	хорошо	отлично

5.2.2 Оценочные средства при промежуточной аттестации

Формой промежуточной аттестации в 1 семестре является у студентов очной формы обучения экзамен, у студентов заочной формы обучения – зачет, в процессе которого определяется сформированность обозначенных в рабочей программе компетенций.

Формой промежуточной аттестации во 2 семестре является у студентов очной формы обучения зачет, у студентов заочной формы обучения – экзамен, в процессе которого определяется сформированность обозначенных в рабочей программе компетенций.

Инструментом измерения сформированности компетенций являются: 1) ответы обучающихся на вопросы во время опроса (или результаты выполнения тестовых заданий в системе ЭИОС КузГТУ); 2) результаты выполнения контрольных работ.

При проведении промежуточного контроля студент отвечает на 2 вопроса из списка вопросов промежуточной аттестации (их выбор случаен). Опрос может проводиться в письменной и (или) устной форме.

Критерии оценивания при ответе на вопросы:

- 85-100 баллов – при правильном и полном ответе на два вопроса;
- 65-84 баллов – при правильном и полном ответе на один из вопросов и правильном, но не полном ответе на другой из вопросов;
- 50-64 баллов – при правильном и неполном ответе только на один из вопросов;
- 0-49 баллов – при отсутствии правильных ответов на вопросы.

Количество баллов	0-49	50-64	65-84	85-100
Шкала оценивания	неуд	удовл	хорошо	отлично

Промежуточный контроль может быть также проведен с использованием ресурсов ЭИОС КузГТУ в форме тестирования. В этом случае обучающийся выполняет 30 тестовых заданий, выбранных случайным образом (примеры тестовых заданий приведены выше).

Критерии оценивания:

- 85- 100 баллов – при ответе на >85% вопросов
- 64 – 84 баллов – при ответе на >65 и <84% вопросов
- 50 – 64 баллов – при ответе на >49 и <64% вопросов
- 0 – 49 баллов – при ответе на <45% вопросов

Количество баллов	0-49	50-64	65-84	85-100
Шкала оценивания	неуд	удовл	хорошо	отлично
	Не зачтено		Зачтено	

Примерные вопросы к экзамену (зачету):

1 семестр	2 семестр
-----------	-----------



1622171119

<ol style="list-style-type: none"> 1. Сущность понятия «финансовый рынок». 2. Виды финансовых рынков в экономике. 3. Функции финансового рынка. 4. Структура финансового рынка. 5. Доходность и риск на финансовом рынке. 6. Виды рисков, связанных с ценными бумагами. 7. Основные инструменты финансовых рынков. 8. Сущность, содержание и виды ценных бумаг. 9. Акции. Обыкновенные и привилегированные акции. Стоимость акций. Показатели доходности акций. 10. Облигации. Классификация облигаций. Стоимостная оценка и оценка доходности облигаций. 11. Вексель. Виды векселей. Индоссамент. Ответственность по вексельному обязательству. Стоимостная оценка векселя. Доходность векселей. 10. Депозитные и сберегательные сертификаты. 11. Производные финансовые инструменты, их функции и цели применения. 12. Виды финансовых посредников. 13. Профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг. 14. Институциональные инвесторы. 15. Фондовая биржа. Участники биржевых торгов. 16. Механизм биржевой торговли. 17. Виды биржевых аукционов. 18. Классические методы управления рисками на рынке ценных бумаг. Управление рисками трейдеров, брокерских, дилерских и др. компаний. 19. Уклонение от риска. 20. Упреждение рисков. 21. Локализация. 22. Диссипация риска. 23. Самострахование. 24. Трансферт риска. 25. Страхование риска. 26. Хеджирование инвестиционных рисков. 27. Секьюритизация рисков. 	<ol style="list-style-type: none"> 1. Государственное регулирование финансового рынка. 2. Саморегулирование финансового рынка. 3. Бюджетная (социальная) эффективность проектов. 4. Экономическая оценка эффективности инвестиционных проектов. 5. Инвестиционные показатели качества ценных бумаг. 6. Формы рейтинговой оценки. 7. Экономическая эффективность финансовых инвестиций. 8. Принципы инвестирования. 9. Кассовые и срочные сделки. Маржинальные сделки. 10. Сделки РЕПО. 11. Инвестиционный портфель. Пассивные и активные стратегии управления инвестиционным портфелем. 12. Понятие фундаментального анализа. 13. Понятие и постулаты технического анализа. 14. Методы технического анализа с использованием компьютерных систем.
---	---

5.2.3. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующие этапы формирования компетенций

1. Текущий контроль успеваемости обучающихся, осуществляется в следующем порядке: в конце завершения освоения соответствующей темы обучающиеся, по распоряжению педагогического работника, убирают все личные вещи, электронные средства связи и печатные источники информации.

Для подготовки ответов на вопросы обучающиеся используют чистый лист бумаги любого размера и ручку. На листе бумаги обучающиеся указывают свои фамилию, имя, отчество (при наличии), номер учебной группы и дату проведения текущего контроля успеваемости.

Научно-педагогический работник устно задает два вопроса, которые обучающийся может записать на подготовленный для ответа лист бумаги. В течение установленного научно-педагогическим работником времени обучающиеся письменно формулируют ответы на заданные вопросы. По истечении указанного времени листы бумаги с подготовленными ответами обучающиеся передают научно-педагогическому работнику для последующего оценивания результатов текущего контроля успеваемости.

При подготовке ответов на вопросы обучающимся запрещается использование любых электронных и печатных источников информации. В случае обнаружения научно-педагогическим работником факта использования обучающимся при подготовке ответов на вопросы указанные источники информации - оценка результатов текущего контроля соответствует 0 баллов и назначается дата повторного прохождения текущего контроля успеваемости.

Результаты текущего контроля доводятся до сведения обучающихся в течение трех учебных дней, следующих за днем проведения текущего контроля успеваемости.

Обучающиеся, которые не прошли текущий контроль успеваемости в установленные сроки,



1622171119

обязаны пройти его в срок до начала процедуры промежуточной аттестации по дисциплине в соответствии с расписанием промежуточной аттестации.

Результаты прохождения процедур текущего контроля успеваемости обучающихся учитываются при оценивании результатов промежуточной аттестации обучающихся.

1. Промежуточная аттестация обучающихся проводится после завершения обучения по дисциплине в семестре в соответствии с календарным учебным графиком и расписанием промежуточной аттестации.

Для успешного прохождения процедуры промежуточной аттестации по дисциплине обучающиеся должны: 1) получить положительные результаты по всем предусмотренным рабочей программой формам текущего контроля успеваемости; 2) получить положительные результаты аттестационного испытания.

Для успешного прохождения аттестационного испытания обучающийся в течение времени, установленного научно-педагогическим работником, осуществляет подготовку ответов на два вопроса, выбранных в случайном порядке. Для подготовки ответов используется чистый лист бумаги и ручка. На листе бумаги обучающиеся указывают свои фамилию, имя, отчество (при наличии), номер учебной группы и дату проведения аттестационного испытания. При подготовке ответов на вопросы обучающимся запрещается использование любых электронных и печатных источников информации. По истечении указанного времени, листы с подготовленными ответами на вопросы обучающиеся передают научно-педагогическому работнику для последующего оценивания результатов промежуточной аттестации.

В случае обнаружения научно-педагогическим работником факта использования обучающимся при подготовке ответов на вопросы указанные источники информации - оценка результатов промежуточной аттестации соответствует 0 баллов и назначается дата повторного прохождения аттестационного испытания.

Результаты промежуточной аттестации обучающихся размещаются в ЭИОС КузГТУ.

Текущий контроль успеваемости и промежуточная аттестация обучающихся могут быть организованы с использованием ЭИОС КузГТУ, порядок и формы проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся при этом не меняется.

6 Учебно-методическое обеспечение

6.1 Основная литература

1. Деньги, кредит, банки. финансовые рынки. в 2 ч. часть 1.: учебник для вузов / Отв. ред. Янова С. Ю.. - Москва : Юрайт, 2020. - 299 с. - ISBN 978-5-534-07172-6. - URL: <https://urait.ru/book/dengi-kredit-banki-finansovye-rynki-v-2-ch-chast-1-453910> (дата обращения: 30.05.2022). - Текст : электронный.

2. Деньги, кредит, банки. финансовые рынки. в 2 ч. часть 2.: учебник для вузов / Янова С. Ю. [и др.] ; Отв. ред. Янова С. Ю.. - Москва : Юрайт, 2020. - 306 с. - ISBN 978-5-534-07174-0. - URL: <https://urait.ru/book/dengi-kredit-banki-finansovye-rynki-v-2-ch-chast-2-455616> (дата обращения: 30.05.2022). - Текст : электронный.

6.2 Дополнительная литература

1. Вершинина, А. А. Международные финансовые рынки и международные финансовые институты / А. А. Вершинина, К. В. Максимов, В. Ф. Максимова. - Москва : Евразийский открытый институт, 2009. - 175 с. - ISBN 9785374003055. - URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=90551 (дата обращения: 30.05.2022). - Текст : электронный.

2. Деньги, кредит, банки. финансовые рынки. в 2 ч. часть 1.: учебник для вузов / Отв. ред. Янова С. Ю.. - Москва : Юрайт, 2020. - 299 с. - ISBN 978-5-534-07172-6. - URL: <https://urait.ru/book/dengi-kredit-banki-finansovye-rynki-v-2-ch-chast-1-453910> (дата обращения: 30.05.2022). - Текст : электронный.

3. Зонova, О. В. Финансовые рынки : учебное пособие для студентов направлений подготовки 080100.62 "Экономика", 080200.62 "Менеджмент", 230700.62 "Прикладная информатика" / О. В. Зонova ; ФГБОУ ВПО Кузбас. гос. техн. ун-т им. Т. Ф. Горбачева. - Кемерово : КузГТУ, 2013. - 130 с. - URL: <http://library.kuzstu.ru/meto.php?n=91208&type=utchposob:common>. - Текст : непосредственный + электронный.

6.3 Методическая литература

1. Методические рекомендации по организации учебной деятельности обучающихся КузГТУ / ФГБОУ ВО «Кузбас. гос. техн. ун-т им. Т. Ф. Горбачева», Факультет приклад. информ. технологий ; сост. Л. И.



1622171119

Михалева. – Кемерово : КузГТУ, 2017. – 32 с. – URL: <http://library.kuzstu.ru/meto.php?n=553> (дата обращения: 30.05.2022). – Текст : электронный.

6.4 Профессиональные базы данных и информационные справочные системы

1. Электронная библиотечная система «Университетская библиотека онлайн» <http://biblioclub.ru/>
2. Электронная библиотечная система «Лань» <http://e.lanbook.com>
3. Электронная библиотека КузГТУ https://elib.kuzstu.ru/index.php?option=com_content&view=article&id=230&Itemid=229
4. Электронная библиотечная система Новосибирского государственного технического университета <https://clck.ru/UoXpv>
5. Электронная библиотечная система «Юрайт» <https://urait.ru/>
6. Справочная правовая система «КонсультантПлюс» <http://www.consultant.ru/>
7. Национальная электронная библиотека <https://rusneb.ru/>

6.5 Периодические издания

1. Вопросы экономики : журнал (печатный/электронный) <https://elibrary.ru/contents.asp?titleid=7715>
2. Деньги и кредит : теоретический научно-практический журнал (печатный/электронный) <https://elibrary.ru/contents.asp?titleid=8647>
3. Региональная экономика: теория и практика : научно-практический и аналитический журнал (печатный)
4. Российский экономический журнал : научно-практический журнал (печатный/электронный) <https://elibrary.ru/contents.asp?titleid=9065>
5. Финансовая экономика : всероссийский научно-аналитический журнал (электронный) <https://elibrary.ru/contents.asp?titleid=28699>
6. Финансовый директор : практический журнал по управлению финансами компании (печатный)
7. Финансовый менеджмент : журнал (печатный/электронный) <https://elibrary.ru/contents.asp?titleid=9552>
8. Финансы : теоретический и научно-практический журнал (печатный)
9. ЭКО : всероссийский экономический журнал (печатный/электронный) <https://elibrary.ru/contents.asp?titleid=8272>
10. Экономика и управление инновациями : научно-практический журнал (печатный/электронный) <https://economics.kuzstu.ru/>

7 Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

ЭИОС КузГТУ:

- a) Электронная библиотека КузГТУ. – Текст: электронный // Научно-техническая библиотека Кузбасского государственного технического университета им. Т. Ф. Горбачева : сайт. – Кемерово, 2001 – . – URL: <https://elib.kuzstu.ru/>. – Текст: электронный.
- b) Портал.КузГТУ : Автоматизированная Информационная Система (АИС) : [сайт] / Кузбасский государственный технический университет им. Т. Ф. Горбачева. – Кемерово : КузГТУ, [б. г.]. – URL: <https://portal.kuzstu.ru/>. – Режим доступа: для авториз. пользователей. – Текст: электронный.
- c) Электронное обучение : [сайт] / Кузбасский государственный технический университет им. Т. Ф. Горбачева. – Кемерово : КузГТУ, [б. г.]. – URL: <https://el.kuzstu.ru/>. – Режим доступа: для авториз. пользователей КузГТУ. – Текст: электронный.

8 Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины "Финансовые рынки и институты"

Самостоятельная работа обучающегося является частью его учебной деятельности, объемы самостоятельной работы по каждой дисциплине (модулю) практике, государственной итоговой аттестации, устанавливаются в учебном плане.

Самостоятельная работа по дисциплине (модулю), практике организуется следующим образом:

1. До начала освоения дисциплины обучающемуся необходимо ознакомиться с содержанием рабочей программы дисциплины (модуля), программы практики в следующем порядке:

1.1 содержание знаний, умений, навыков и (или) опыта профессиональной деятельности, которые будут сформированы в процессе освоения дисциплины (модуля), практики;



1622171119

1.2 содержание конспектов лекций, размещенных в электронной информационной среде КузГТУ в порядке освоения дисциплины, указанном в рабочей программе дисциплины (модуля), практики;

1.3 содержание основной и дополнительной литературы.

2. В период освоения дисциплины обучающийся осуществляет самостоятельную работу в следующем порядке:

2.1 выполнение практических и (или) лабораторных работы и (или) отчетов в порядке, установленном в рабочей программе дисциплины (модуля), практики;

2.2 подготовка к опросам и (или) тестированию в соответствии с порядком, установленном в рабочей программе дисциплины (модуля), практики;

2.3 подготовка к промежуточной аттестации в соответствии с порядком, установленном в рабочей программе дисциплины (модуля), практики.

В случае затруднений, возникших при выполнении самостоятельной работы, обучающемуся необходимо обратиться за консультацией к педагогическому работнику. Периоды проведения консультаций устанавливаются в расписании консультаций.

9 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине "Финансовые рынки и институты", включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем

Для изучения дисциплины может использоваться следующее программное обеспечение:

1. Mozilla Firefox
2. Google Chrome
3. 7-zip
4. ESET NOD32 Smart Security Business Edition
5. Kaspersky Endpoint Security
6. Браузер Спутник

10 Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине "Финансовые рынки и институты"

Для реализации программы учебной дисциплины предусмотрены специальные помещения:

1. Помещения для самостоятельной работы обучающихся должны оснащенные компьютерной техникой с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде Организации.

2. Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации.

11 Иные сведения и (или) материалы

1. Образовательный процесс осуществляется с использованием как традиционных так и современных интерактивных технологий.

В рамках аудиторных занятий применяются следующие интерактивные методы:

- разбор конкретных примеров;
- мультимедийная презентация.

2. Проведение групповых и индивидуальных консультаций осуществляется в соответствии с расписанием консультаций по темам, заявленным в рабочей программе дисциплины, в период освоения дисциплины и перед промежуточной аттестацией с учетом результатов текущего контроля.



1622171119