

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации

федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования

**«Санкт-Петербургский государственный университет промышленных технологий и дизайна»
ВЫСШАЯ ШКОЛА ТЕХНОЛОГИИ И ЭНЕРГЕТИКИ**

УТВЕРЖДАЮ
Директор ВШТЭ

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.10

(индекс дисциплины)

Финансовые рынки и институты

(Наименование дисциплины)

Кафедра: **9** Финансов и учета

Код

(Наименование кафедры)

Направление подготовки: **38.03.02 Менеджмент**

Профиль подготовки: **Финансовый менеджмент**

Уровень образования: **Прикладной бакалавриат**

План учебного процесса

Составляющие учебного процесса		Очное обучение	Очно-заочное обучение	Заочное обучение
Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий и самостоятельная работа обучающихся (часы)	Всего	144		
	Аудиторные занятия	65		
	Лекции	26		
	Лабораторные занятия			
	Практические занятия	39		
	Самостоятельная работа	43		
	Промежуточная аттестация	36		
Формы контроля по семестрам (номер семестра)	Экзамен	8		
	Зачет с оценкой			
	Контрольная работа			
	Курсовая работа	8		
Общая трудоемкость дисциплины (зачетные единицы)		4		

Форма обучения:	Распределение зачетных единиц трудоемкости по семестрам									
	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
Очная								4		
Очно-заочная										
Заочная										

Рабочая программа дисциплины составлена в соответствии с федеральным
государственным образовательным стандартом высшего образования
по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент

На основании учебных планов № бр 380302-123_20

Кафедра-разработчик: Финансов и учета

Заведующий кафедрой: Морозов О.А.

СОГЛАСОВАНИЕ:

Выпускающая кафедра: Финансов и учета

Заведующий кафедрой: Морозов О.А.

Методический отдел: Смирнова В.Г.

1. ВВЕДЕНИЕ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1. Место преподаваемой дисциплины в структуре образовательной программы

Блок 1: Базовая Обязательная Дополнительно является факультативом
 Вариативная По выбору

1.2. Цель дисциплины

Сформировать компетенции обучающегося о существующей структуре финансового рынка, о содержании экономических отношений субъектов финансового рынка, о методах анализа и оценки перспектив этих отношений.

1.3. Задачи дисциплины

- Формирование современных подходов к использованию финансовых механизмов в управлении экономикой.
- Формирование устойчивых знаний о функциях институтов финансового рынка.
- Формирование прикладных навыков анализа содержания финансовых отношений.

1.4. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Код компетенции	Формулировка компетенции	Этап формирования
ПК- 4	умением применять основные методы финансового менеджмента для оценки активов, управления оборотным капиталом, принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала, в том числе, при принятии решений, связанных с операциями на мировых рынках в условиях глобализации	3
Планируемые результаты обучения Знать: 1) закономерности функционирования финансовых рынков и институтов; 3) источники финансирования, институты и инструменты финансового рынка; 4) виды ценных бумаг и условия их котировки; Уметь: 1) обосновать решения в сфере управления оборотным капиталом и выбора источников финансирования; 2) проводить оценку финансовых инструментов; 3) давать оценку операциям корпораций на первичном рынке ценных бумаг. Владеть: 1) основными моделями оценки акций и облигаций; 2) навыками анализа котировки облигаций корпорации.		
ПК-9	способностью оценивать воздействие макроэкономической среды на функционирование организаций и органов государственного и муниципального управления, выявлять и анализировать рыночные и специфические риски, а также анализировать поведение потребителей экономических благ и формирование спроса на основе знания экономических основ поведения организаций, структур рынков и конкурентной среды отрасли	3
Планируемые результаты обучения Знать: 1) законодательную и нормативную базу, регламентирующую осуществление деятельности на финансовых рынках; 2) инструменты секторов финансовых рынков 3) структуру и состав участников секторов финансовых рынков. Уметь: 1) определять целесообразность формирования целевых денежных фондов и использования их для повышения эффективности деятельности организации 2) формировать обоснованное решение по выбору партнеров на финансовых рынках на основе анализа их деятельности. Владеть: 1) Методами оценки риска в инвестировании. 2) Методами инвестиционного анализа и анализа финансовых рынков.		

1.5. Дисциплины (практики) образовательной программы, в которых было начато формирование компетенций, указанных в п.1.4:

- Финансовая математика(ПК-4)
- Финансы(ПК-4)
- Финансовый менеджмент(ПК-4)
- Оценка и управление стоимостью предприятий (ПК-4)
- Экономическая теория ч.1(ПК-9)
- Экономическая теория ч.2(ПК-9)
- Организация рекламного дела(ПК-9)
- Маркетинг(ПК-9,)
- Экономика фирмы(ПК-9,)
- Страхование дело(ПК-9)
- Мировая экономика(ПК-9)
- Деньги,кредит,банки(ПК-9)
- Управление рисками(ПК-9)
- Налоги и налогообложение(ПК-9)

Учебная (практика по получению первичных профессиональных умений и навыков) (ПК-4, ПК-9))

2. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Наименование и содержание учебных модулей, тем и форм контроля	Объем (часы)		
	очное обучение	очно-заочное обучение	заочное обучение
Учебный модуль 1. Финансовые рынки: место и роль в рыночной экономике			

Наименование и содержание учебных модулей, тем и форм контроля	Объем (часы)		
	очное обучение	очно-заочное обучение	заочное обучение
Тема 1. Сущность и виды финансовых рынков, их участники. Назначение финансовых рынков, их взаимосвязь. Финансовые рынки – сфера интеграции капитала. Виды финансовых рынков. Регулирование финансовых рынков. Основные участники финансовых рынков.	4		
Тема 2. Капитал, финансы и финансовые рынки. Основные черты капитала, его формы и виды. Взаимосвязь капитала и финансов в управлении денежными ресурсами. Финансовая экономика, основные направления ее исследований. Место и роль финансовых рынков, их виды. Биржевая система как институциональная основа функционирования финансовых рынков.	4		
Тема 3. Фондовый рынок, его назначение и структурные элементы. Формы организации рынка ценных бумаг. Признаки классификации ЦБ, их основные виды. Показатели торговли ценными бумагами. Методические подходы к оценке ЦБ. Модели оценки акций и облигаций. Организация первичного рынка ЦБ, его участники. Назначение первичного рынка ЦБ, оформление торгов. Принципы разделения участников биржевых торгов. Корпоративные мероприятия на вторичном рынке ЦБ.	10		
Тема 4. Рынок капиталов, его институциональная структура на фондовом рынке. Ссудный капитал, его виды и формы. Институты рынка капиталов, роль банков в регулировании движения кредитных ресурсов. Фондовые биржи, инвестиционные фонды и центры. Риски в инвестировании. Оценки капитальных активов. Приведенная стоимость и дисконтирование. Виды и формы кредитования. Источники кредитного капитала. Мероприятия корпораций по финансированию и оптимизации структуры капитала, их оценка через маржинальную (предельную) себестоимость мобилизации капитала. Международный кредитный рынок (МКР), принципы организации и основные функции. Структура МКР, его участники: кредиторы и заемщики. Участие России на МКР.	4		
Тема 5. Современные особенности развития финансовых рынков. Особенности финансового рынка Российской Федерации. Основные тенденции развития современного мирового финансового рынка. Глобализация финансового рынка. Усложнение характера рисков на финансовом рынке.	6		
Текущий контроль 1 Контрольная работа	1		
Учебный модуль 2. Рынок денег, его взаимосвязь с фондовым рынком			

Наименование и содержание учебных модулей, тем и форм контроля	Объем (часы)		
	очное обучение	очно-заочное обучение	заочное обучение
Тема 6. Деньги как рыночная категория. Основы теории денег: природа и сущность денег, кругооборот денег и доходов, модели денежного обращения, его параметры. Функции денег, их влияние на денежную массу. Зависимость денежной массы от состояния экономики и финансовой системы страны. Предложение денег, спрос на деньги, формирование цены денег. Денежная масса и денежная база, связь их динамики с кредитным обращением. Состояние рынка капиталов и уровень цены денег.	6		
Тема 7. Принцип организации и функционирования валютного рынка. Виды и формы денег; кредитные деньги. Спрос на кредитные деньги, его природа и характеристики. Предложение денег; его формализация и инструменты определения, эмиссионный результат. Эмиссия как результат спроса и предложения денег. Единство рынка денег, концентрированный характер предложения ссудного капитала. Государственные займы. Биржевая спекуляция. Формы взаимосвязи рынка денег с рынками капиталов и ценных бумаг. Основные принципы организации валютных рынков. Виды валют, их стоимостные характеристики. Методы работы на валютных рынках. Валютная позиция. Сущность и техника проведения наличных сделок: операции «форвард»; фьючерс; операции с опционом; операции «своп». Виды валютных рисков, их характеристика. Методы страхования валютных рисков.	8		
Тема 8. Основное назначение и принципы формирования и развития рынка золота. Восстановление абсолютной ликвидности золота. Законодательная основа развития рынка драгметаллов и регулирования его государством. Развитие финансовых инструментов на основе драгоценных металлов. Условия и порядок кредитования развития рынка стандартного золота. Политика Центробанка в регулировании рынка драгоценных металлов. Структура международного рынка драгоценных металлов. Структура международного рынка золота.	18		
Текущий контроль 2 Контрольная работа	1		
Учебный модуль 3. Рынок производных финансовых инструментов.			
Тема 9. Производные ценные бумаги. Сущность и значение производных ЦБ; финансовый инжиниринг по созданию новых финансовых продуктов и услуг. Основные группы производных финансовых инструментов, их создание, применение, основные свойства. Фьючерсные и форвардные контракты, модели их цены.	18		
Тема 10. Рынок кредитных деривативов. Сущность и назначение кредитных деривативов в управлении кредитным риском, их отличие от производных финансовых инструментов: преимущества и недостатки. Основные виды страховых сделок: условия и характер выполнения. Факторы развития рынка кредитных деривативов. Хедж-фонды, их значение на финансовом рынке. Финансовые центры кредитного рынка.	18		
Текущий контроль 3. Контрольная работа	2		
Курсовая работа	8		
Промежуточная аттестация по дисциплине ЭКЗАМЕН	36		
ВСЕГО:	144		

3. ТЕМАТИЧЕСКИЙ ПЛАН

3.1. Лекции

Номера изучаемых тем	Очное обучение		Очно-заочное обучение		Заочное обучение	
	Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)
1	8	4				

Номера изучаемых тем	Очное обучение		Очно-заочное обучение		Заочное обучение	
	Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)
2	8	2				
3	8	2				
4	8	2				
5	8	2				
6	8	4				
7	8	2				
8	8	2				
9	8	4				
10	8	2				
ВСЕГО:		26				

3.2. Практические и семинарские занятия

Номера изучаемых тем	Наименование и форма занятий	Очное обучение		Очно-заочное обучение		Заочное обучение	
		Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)
1.	Семинар. занятия – ознакомление с ролью и функциями финансовых рынков в экономике	8	6				
2	Практ. занятия – расчет типовых задач по ценным бумагам	8	21				
3	Практ. занятия – расчет типовых задач по производным финансовым инструментам	8	12				
ВСЕГО:		39					

3.3. Лабораторные занятия

Не предусмотрено

4. КУРСОВОЕ ПРОЕКТИРОВАНИЕ

4.1. Цели курсовой работы – изучение финансового рынка и финансовых посредников. Задачи, которые складываются из поставленной цели, следующие: рассмотреть сущность и признаки финансового рынка; изложить классификацию и инструменты финансовых рынков; описать рынок ценных бумаг как сегмент финансового рынка; проанализировать финансовый рынок и инвестиционную деятельность организаций; охарактеризовать особенности формирования финансовых рынков в России.

4.2. Тематика курсовой работы.

1. Проблемы и перспективы развитие фондового рынка в России.
2. Финансовые риски, их оценка и методы страхования рисков.
3. Критерии выбора типа облигаций для их размещения.
4. Ценообразование облигаций, оценка и анализ факторов, определяющих цену облигаций.
5. Принципы формирования портфеля акций на российском рынке
6. Оценка рисков инвестирования в акции в России и на зарубежных рынках
7. Анализ развития российского рынка акций.
8. Модели ценообразования акций и возможности их применения в России.
9. Анализ развития рынка государственных ценных бумаг в России.
10. Фондовые индексы: взаимодействие российских и зарубежных индексов.
11. Анализ причин финансового кризиса и пути выхода из кризисного состояния.
12. Проблемы глобализации финансовых рынков.
13. Модели развития фондовых рынков (на примере конкретных стран) и их применимость для России
14. Проблемы формирования инфраструктуры фондового рынка в России
15. Сравнительный анализ облигаций и банковского кредита: преимущества и недостатки
16. Проблемы оценки качества облигаций
17. Прогнозирование вероятности дефолта по корпоративным облигациям
18. Сравнительный анализ обыкновенных акций, привилегированных и облигаций. Их роль в финансировании компаний

19. Становление рынка ипотечных облигаций в России

20. Модели развития рынка ипотечных облигаций: сравнительный анализ

4.3. Требования к выполнению и представлению результатов курсовой работы

Работа выполняется обучающимися индивидуально. Результаты проведенного исследования представляются в виде пояснительной записки объемом 25-30 стр. печатного текста (шрифт 14).

5. ТЕКУЩИЙ КОНТРОЛЬ УСПЕВАЕМОСТИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ

Номера учебных модулей, по которым проводится контроль	Форма контроля знаний	Очное обучение		Очно-заочное обучение		Заочное обучение	
		Номер семестра	Кол-во	Номер семестра	Кол-во	Номер семестра	Кол-во
1,2,3	Контрольная работа	8	3				

6. САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА ОБУЧАЮЩЕГОСЯ

Виды самостоятельной работы обучающегося	Очное обучение		Очно-заочное обучение		Заочное обучение	
	Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)
Усвоение теоретического материала	8	20				
Подготовка к практическим занятиям	8	15				
Выполнение курсовых работ	8	8				
Подготовка к экзамену	8	36				
		43				

7. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

7.1. Характеристика видов и используемых инновационных форм учебных занятий

Наименование видов учебных занятий	Используемые инновационные формы	Объем занятий в инновационных формах (часы)		
		очное обучение	очно-заочное обучение	заочное обучение
Лекции	Проблемная лекция, разбор конкретных ситуаций	4		
Практические и семинарские занятия	Поиск вариантов решения проблемных ситуаций, презентация домашнего задания	4		
ВСЕГО:		8		

7.2. Система оценивания успеваемости и достижений обучающихся для промежуточной аттестации

традиционная балльно-рейтинговая

8. ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

8.1. Учебная литература

а) основная учебная литература

1. 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.— М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2015.— 175 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/34528>.— ЭБС «IPRbooks».

2. Николаева И.П. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс]: учебник для бакалавров/ Николаева И.П.— Электрон. текстовые данные.— М.: Дашков и К, 2015.— 256 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/35306>.— ЭБС «IPRbooks».

б) дополнительная учебная литература

3. Шатохин К.С. Финансовые рынки и инструменты [Электронный ресурс]: рынок ценных бумаг. Курс лекций/ Шатохин К.С.— Электрон. текстовые данные.— М.: Издательский Дом МИСиС, 2013.— 126 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/56611>.— ЭБС «IPRbooks».
4. Натепрова Т.Я. Учет ценных бумаг и финансовых вложений [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Натепрова Т.Я., Трубицына О.В.— Электрон. текстовые данные.— М.: Дашков и К, 2015.— 224 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/52256>.— ЭБС «IPRbooks».
5. Рыбин В.Н. Финансовые рынки. Часть 1. Финансовые рынки Российской Федерации [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Рыбин В.Н., Рыбин А.В.— Электрон. текстовые данные.— М.: Русайнс, 2015.— 74 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/48998>.— ЭБС «IPRbooks».
6. Сахарова Л.А. Финансовые рынки и институты [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Сахарова Л.А.— М.: Русайнс, 2015.— 171 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/61677>.— ЭБС «IPRbooks».

8.2. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

1. Джон Богл Инвесторы против спекулянтов [Электронный ресурс]: кто на самом деле управляет фондовым рынком/ Джон Богл— Электрон. текстовые данные.— М.: Манн, Иванов и Фербер, 2014.— 353 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/39209>.— ЭБС «IPRbooks».
2. Питер Бернштейн Фундаментальные идеи финансового мира [Электронный ресурс]: эволюция/ Питер Бернштейн— Электрон. текстовые данные.— М.: Альпина Паблишер, 2016.— 256 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/41499>.— ЭБС «IPRbooks».
3. Итяшева И.А. Правовое регулирование ценных бумаг и рынка ценных бумаг [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Итяшева И.А., Слепко Г.Е., Стражевич Ю.Н.— Электрон. текстовые данные.— М.: Международный юридический институт, 2013.— 246 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/34407>.— ЭБС «IPRbooks».
4. Виктор Нидерхоффер Практика биржевых спекуляций [Электронный ресурс]/ Виктор Нидерхоффер, Лорел Кеннер— Электрон. текстовые данные.— М.: Альпина Паблишер, 2016.— 507 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/48591>.— ЭБС «IPRbooks».

8.3. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", необходимых для освоения дисциплины

1. Банк России; URL: <http://www.cbr.ru>
2. Министерство Финансов РФ; URL: <http://www.minfin.ru>
3. Счетная палата РФ; URL: <http://www.ach.gov.ru>
4. ММВБ; URL: <http://www.micex.ru>
5. РТС; URL: <http://www.rts.ru>
6. РосБизнесКонсалтинг; URL: <http://www.rbc.ru>
7. Национальное Рейтинговое Агентство; URL: <http://www.ra-national.ru>
8. Рейтинговое агентство «Эксперт»; URL: <http://www.reaper.ru>

8.4. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем

Информационно – правовой портал ГАРАНТ [Электронный ресурс]. URL: <http://www.garant.ru>,
Компьютерная справочно-правовая система КонсультантПлюс [Электронный ресурс]

1. Microsoft Windows 8.
2. Microsoft Office Professional 2013

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

1. Компьютерный класс с мультимедийным комплексом и выходом в интернет

8.6. Иные сведения и (или) материалы

Массивы статистических данных, подлежащие изучению, должны быть взяты из информационно-справочных систем или из журнала «Эксперт».

9. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

Виды учебных занятий и самостоятельная работа обучающихся	Организация деятельности обучающегося
Лекции	Конспект лекций: кратко, схематично, последовательно фиксировать основные положения, выводы и формулировки; пометить важные мысли, выделять ключевые слова, термины.
Практические занятия	Работа с конспектом лекций, просмотр рекомендуемой литературы, работа с текстом (указать текст из источника и др.).
Самостоятельная работа	Знакомство с основной и дополнительной литературой, включая справочные издания, зарубежные источники, конспект основных положений, терминов, сведений, требующих для запоминания и

Виды учебных занятий и самостоятельная работа обучающихся	Организация деятельности обучающегося
	являющихся основополагающими по основным темам. При подготовке к экзамену необходимо проработать конспекты лекций, рекомендуемую литературу дисциплины. При выполнении курсовой работы ознакомиться с методическими рекомендациями.

10. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

10.1. Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

10.1.1. Показатели оценивания компетенций на этапах их формирования

Код компетенции (этап освоения)	Показатели оценивания компетенций	Наименование оценочного средства	Представление оценочного средства в фонде
ПК-4 (3)	<p>Характеризовать источники финансирования, институты и инструменты финансового рынка.</p> <p>Способен давать оценку операциям на рынке ценных бумаг.</p> <p>Демонстрирует навыки оценки и котировки акций и облигаций;</p>	<p>Устное собеседование</p> <p>Практическое задание</p>	<p>Перечень вопросов 47 вопросов</p> <p>Ситуационные задания, 5 заданий</p>
ПК-9 (3)	<p>Формулирует законодательную и нормативную базу, регламентирующую осуществление деятельности на финансовых рынках; характеризует инструменты и состав участников секторов финансовых рынков.</p> <p>Способен формировать обоснованное решение по выбору партнеров на финансовых рынках на основе анализа их деятельности.</p> <p>Демонстрирует методы анализа финансовых рынков и оценки риска в инвестировании.</p>	<p>Устное собеседование</p> <p>Практическое задание</p>	<p>Перечень вопросов к зачету, 47 вопросов</p> <p>Ситуационные задания, 5 заданий</p>

10.1.2. Описание шкал и критериев оценивания сформированности компетенций

Критерии оценивания сформированности компетенций

Оценка по традиционной шкале	Критерии оценивания форсированности компетенций		
	Устное собеседование	Практическое задание	Курсовая работа
отлично	<p>Полный исчерпывающий ответ, понимание поставленных вопросов, демонстрирует эрудицию в ответах на все вопросы</p>	<p>При решении задач сделаны грамотные выводы по результатам анализа экономических показателей. Работа выполнена без ошибок. Качество выполнения всех элементов работы полностью соответствуют предъявляемым требованиям.</p>	<p>В работе рассмотрены все поставленные вопросы. Сделаны полные выводы по полученным результатам анализа. Качество исполнения всех элементов работы соответствуют требованиям. Владение методикой статистического анализа экономических показателей Работа к</p>

			защите представлена в установленные сроки.
хорошо	Не достаточно полно раскрыты ответы на поставленные вопросы. Допускает незначительные ошибки при ответах на вопросы экзаменационного билета и дополнительные вопросы.	Обучающийся демонстрирует достаточное понимание условий задачи. Владеет навыками статистического анализа данных. Испытывает затруднения с интерпретацией полученных результатов.	Работа выполнена в необходимом объеме. Имеются незначительные замечания по ее оформлению и результатам проведенного анализа. Часть выводов недостаточно четко сформулированы. Работа представлена с некоторым опозданием.
удовлетворительно	Обучающийся показывает знания в минимальном объеме. Допускает ошибки при ответах на вопросы.	Обучающийся понимает план решения задачи, но не может в полной мере реализовать ее решение	Задание выполнено полностью, но в работе имеется много ошибок в расчетах и выводах. Отсутствует ряд аналитических таблиц. Нарушены сроки представления работы к защите. При защите в ответах на вопросы наблюдаются затруднения.
неудовлетворительно	Непонимание поставленного вопроса, неспособность ответить на вопрос без помощи преподавателя	Отсутствует несколько элементов работы. Имеется много ошибок. Выводы сформулированы неправильно.	В работе отсутствуют несколько обязательных к выполнению заданий. Имеются многочисленные ошибки в расчетах и анализе экономических показателей. Не может ответить на поставленные вопросы при защите. Представление чужой работы.

* **Существенные ошибки** – недостаточная глубина и осознанность ответа (например, студент не смог применить теоретические знания для объяснения явлений, для установления причинно-следственных связей, сравнения и классификации явлений и т.д.).

* **Несущественные ошибки** – неполнота ответа (например, упущение из вида какого-либо нехарактерного факта, дополнения при описании процесса, явления, закономерностей и т.д.); к ним могут быть отнесены оговорки, допущенные при невнимательности студента.

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

10.2.1. Перечень вопросов к экзамену, разработанный в соответствии с установленными этапами формирования компетенций

№ п/п	Формулировка вопросов	№ темы
1	Виды финансовых рынков, их назначение и взаимосвязь.	1
2	Финансовые рынки – сфера интеграции капитала.	1
3	Субъекты финансовой сферы, их классификация	1
4	Основные черты капитала, его формы и виды.	2
5	Взаимосвязь капитала и финансов в управлении денежными ресурсами.	2
6	Формы организации рынка ценных бумаг.	3

7	Признаки классификации ЦБ, их основные виды.	3
8	Показатели торговли ценными бумагами.	3
9	Модели оценки акций и облигаций.	3
10	Организация первичного рынка ЦБ, его участники.	3
11	Корпоративные мероприятия на вторичном рынке ЦБ.	3
12	Ссудный капитал, его виды и формы.	4
13	Роль банков в регулировании движения кредитных ресурсов.	4
14	Фондовые биржи, инвестиционные фонды и центры.	4
15	Оценки капитальных активов. Приведенная стоимость и дисконтирование.	4
16	Виды и формы кредитования. Источники кредитного капитала.	4
17	Диверсификация сделок с ценными бумагами в пользу безрисковых активов.	5
18	Процессы слияния и поглощения на фондовом рынке.	5
19	Развитие сегментов микрофинансирования и микрокредитования на кредитном рынке	5
20	Основы теории денег: природа и сущность денег, кругооборот денег и доходов, модели денежного обращения, его параметры.	6
21	Функции денег, их влияние на денежную массу. Зависимость денежной массы от состояния экономики и финансовой системы страны.	6
22	Предложение денег, спрос на деньги, формирование цены денег. Денежная масса и денежная база, связь их динамики с кредитным обращением.	6
23	Состояние рынка капиталов и уровень цены денег.	6
24	Виды и формы денег. Спрос на кредитные деньги, его природа и характеристики.	6
25	Предложение денег; его формализация и инструменты определения, эмиссионный результат.	6
26	Эмиссия как результат спроса и предложения денег.	6
27	Государственные займы.	6
28	Формы взаимосвязи рынка денег с рынками капиталов и ценных бумаг.	6
29	Биржевая спекуляция.	6
30	Основные принципы организации валютных рынков. Виды валют, их стоимостные характеристики.	7
31	Методы работы на валютных рынках.	7
32	Сущность и техника проведения наличных сделок: операции «форвард»; фьючерс; операции с опционом; операции «своп».	7
33	Виды валютных рисков, их характеристика. Методы страхования валютных рисков.	7
34	Восстановление абсолютной ликвидности золота.	8
35	Законодательная основа развития рынка драгметаллов и регулирования его государством.	8
36	Развитие финансовых инструментов на основе драгоценных металлов.	8
37	Условия и порядок кредитования развития рынка стандартного золота.	8
38	Политика Центробанка в регулировании рынка драгоценных металлов.	8
39	Структура международных рынков золота и драгоценных металлов и золота.	8
40	Сущность и значение производных ЦБ.	9
41	Финансовый инжиниринг по созданию новых финансовых продуктов и услуг.	9
42	Основные группы производных финансовых инструментов, их создание, применение, основные свойства.	9
43	Фьючерсные и форвардные контракты, модели их цены.	9
44	Сущность и назначение кредитных деривативов в управлении кредитным риском, их отличие от производных финансовых инструментов: преимущества и недостатки.	10
45	Основные виды страховых сделок: условия и характер выполнения.	10
46	Факторы развития рынка кредитных деривативов.	10
47	Хедж-фонды, их значение на финансовом рынке.	10

10.2.2. Вариант типовых заданий, разработанных в соответствии с установленными этапами формирования компетенций

1	«США, XVIII век. Правительство США выпускает облигационный заем на сумму \$500 000 для документарного оформления своего долга банкам Франции и Голландии. Количество облигаций – 500, срок обращения – 10 лет, периодичность выплаты процентов – 2 раза в год, величина купонного процента – 2%. Определить: 1. Номинал одной облигации; 2. На сколько должно раскошелиться правительство США, чтобы выплатить купонные проценты по всем облигациям за всё время их обращения?»	\$1 000, \$200 000
2	«Россия, XVIII век. Курьер из Петербурга везёт в Харьков переводной вексель на сумму 613 рублей. Это – годовое жалование офицерам Харьковского пехотного полка. В Харькове, в местном отделении Государственного Банка – 3415 рублей. Определите, сколько денег останется в Харьковском отделении Государственного Банка после того, как военные получат своё жалование?»	2802 руб.
3	«Инвестор купил на вторичном рынке 2 000 акций компании «Иркутскэнерго» по 2.7 руб., 3 000 акций по 2.71 руб. Затем он продал 2 500 акций по 2.69 руб. и 2 500 акций по 2.82 руб. Определить: 1. Доход или убыток получил инвестор от этой операции? 2. Размер совокупного дохода или убытка».	Доход, 245 руб.
4	«Инвестор продал 10 октября 2001 г. пакет билетов Казначейства США номиналом \$10 000 по \$10 020. До этого он дважды получил купонные выплаты в размере 2% от номинала. Определить, по какой цене инвестор 1 июня 2000 г. купил пакет билетов Казначейства США, если доходность операции составила 16% годовых?»	\$8 550,33
5	«Какой вариант инвестирования денежных средств более выгоден: 1. Купить 1 апреля 2000 г. пакет бескупонных облигаций с датой погашения 1 октября 2000 г. и доходностью 12% годовых, затем на вырученные деньги купить пакет бескупонных облигаций по 460 р., с датой погашения 1 апреля 2001 г. и номиналом 500 р.; 2. Купить 1 апреля 2000 г. пакет купонных облигаций по 1 010 р., датой погашения 1 апреля 2001 г., номиналом 1 000 р. и четырьмя купонными выплатами в размере 2%, 2%, 5% и 8% от номинала».	2 вариант

10.3. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, владений (навыков и (или) практического опыта деятельности), характеризующих этапы формирования компетенций

10.3.1. Условия допуска обучающегося к сдаче экзамена ,защиты курсовой работы и порядок ликвидации академической задолженности

Положение о проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся (принято на Ученом совете университета)

10.3.2. Форма проведения промежуточной аттестации по дисциплине

устная письменная компьютерное тестирование иная*

10.3.3. Особенности проведения экзамена и защиты курсовой работы.

Время, отводимое на подготовку ответа на экзамене, составляет не более 30 мин., в это время входит подготовка ответа на теоретический вопрос и решение практического задания. Для расчетов студенту необходимо иметь калькулятор, также ему предоставляется справочная информация.

При защите курсовой работы студент кратко излагает выводы по результатам статистических расчетов, проведенных в курсовой работе. Время защиты не более 15 мин.