

ГОУ ВПО «ДОНЕЦКИЙ НАЦИОНАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

УЧЕТНО-ФИНАНСОВЫЙ ФАКУЛЬТЕТ

Кафедра финансов и банковского дела



УТВЕРЖДАЮ:

проректор по научно-методической
и учебной работе

Е.И. Скафа

«22» апреля 2020 г.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ
«ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ И ФИНАНСОВО-КРЕДИТНЫЕ
ИНСТИТУТЫ»**

Направление подготовки:	38.04.08 Финансы и кредит
Магистерская программа:	Банковское дело
Образовательная программа:	академическая магистратура
Квалификация:	магистр
Форма обучения:	очная, заочная

Донецк 2020

УТВЕРЖДАЮ:

И.о. декана учетно-финансового факультета

 Н.В. Алексеенко

«17» апреля 2020 г.

МП



Программа учебной дисциплины **«Финансовые рынки и финансово-кредитные институты»** составлена на основании Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования (ФГОС ВО) направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит, утвержденного приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от «30» марта 2015 г. № 325 (с изменениями и дополнениями от «13» июля 2017 г.); Порядка организации учебного процесса в образовательных организациях высшего профессионального образования Донецкой Народной Республики, утвержденного приказом Министерства образования и науки ДНР № 1171 от «10» ноября 2017 г.; учебного плана и основной образовательной программы «Банковское дело» направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит, разработанных в ГОУ ВПО «Донецкий национальный университет».

Разработчик:

доцент кафедры финансов и
банковского дела, канд. экон. наук

 Е.Н. Демидова

Программа учебной дисциплины утверждена на заседании кафедры финансов и
банковского дела.

Протокол № 9 от «16» апреля 2020 г.

Заведующий кафедрой
финансов и банковского дела

 П.В. Егоров

Программа учебной дисциплины одобрена учебно-методической комиссией учетно-
финансового факультета.

Протокол № 8 от «16» апреля 2020 г.

Председатель учебно-методической
комиссии факультета

 А.А. Блажевич

1. ОБЛАСТЬ ПРИМЕНЕНИЯ И МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В УЧЕБНОМ ПРОЦЕССЕ

Учебная дисциплина «Финансовые рынки и финансово-кредитные институты» относится к обязательным дисциплинам вариативной части Блока 1 «Дисциплины (модули)» по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит. Для студентов направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (магистерская программа: Банковское дело) дисциплина реализуется кафедрой финансов и банковского дела.

Содержание дисциплины опирается на знания и навыки, приобретенные студентами в результате изучения дисциплин: «Финансы», «Специальные финансово-кредитные институты», «Финансовый анализ (продвинутый уровень)», «Математическое обеспечение финансовых решений», «Рынок ценных бумаг»

Является основой для прохождения производственной и преддипломной практик, практической научной деятельности, в том числе, работе над магистерской диссертацией.

2. СТРУКТУРА ДИСЦИПЛИНЫ

<i>Характеристика учебной дисциплины</i>		
Направление подготовки	38.04.08 Финансы и кредит	
Магистерская программа	Банковское дело	
Образовательная программа	академическая магистратура	
Квалификация	магистр	
Количество содержательных модулей	1	
Дисциплина базовой / вариативной части образовательной программы	Обязательная дисциплина вариативной части Блока 1 «Дисциплины (модули)»	
Формы контроля	1 модульный контроль, 1 экзамен	
Показатели	очная форма обучения	заочная форма обучения
Количество зачетных единиц (кредитов)	4	4
Год подготовки	2	2
Семестр	3	
Количество часов	144	144
- лекционных	16	4
- практических, семинарских	32	6
- лабораторных	-	-
- самостоятельной работы	96	134
в т.ч. индивидуальное задание	-	-
Недельное количество часов,	9	-
в т. ч. аудиторных	3	-

3. ОПИСАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Цели и задачи

Цель – подготовка магистров, обладающих общими знаниями в области функционирования современных финансовых рынков и финансово-кредитных институтов, а также специальными знаниями, направленными на формирование эффективных фондовых, кредитных, валютных и других продуктов, предлагаемых экономическим субъектам на финансовых рынках

Задачи:

выяснить экономическую сущность финансовых рынков, их место в финансовой

системе и влияние на ход экономических процессов;

исследовать структуру финансовых рынков, финансово-кредитных институтов и других участников (эмитентов, инвесторов), их взаимодействия при организации выпуска и обращения ценных бумаг, а также их операций с финансовыми инструментами;

выяснить экономическую сущность ценных бумаг и финансовых инструментов;

рассмотреть особенности конкретных видов ценных бумаг и финансовых инструментов, условий их выпуска и обращения, возможностей использования в хозяйственной практике экономических субъектов;

исследовать систему регулирования и саморегулирования финансовых рынков;

сформировать представление об инфраструктуре финансовых рынков.

Требования к результатам освоения дисциплины: Процесс изучения дисциплины «Финансовые рынки и финансово-кредитные институты» направлен на формирование элементов следующих компетенций в соответствии с ФГОС ВО РФ направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит и основной образовательной программы высшего профессионального образования направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (магистерская программа: Банковское дело):

а) общекультурных (ОК):

– способность к абстрактному мышлению, анализу, синтезу (ОК-1);

б) общепрофессиональных (ОПК):

– готовность к коммуникации в устной и письменной формах на русском и иностранном языках для решения задач профессиональной деятельности (ОПК-1);

в) профессиональных (ПК):

проектно-экономическая деятельность:

– способность предложить конкретные мероприятия по реализации разработанных проектов и программ (ПК-8);

– способность оценивать финансовую эффективность разработанных проектов с учетом оценки финансово-экономических рисков и фактора неопределенности (ПК-9);

организационно-управленческая деятельность:

– способность руководить разработкой краткосрочной и долгосрочной финансовой политики и стратегии развития организаций, в том числе финансово-кредитных и их отдельных подразделений на основе критериев финансово-экономической эффективности, а также финансовой политики публично-правовых образований (ПК-12);

– способность руководить финансовыми службами и подразделениями организаций различных организационно-правовых форм, в том числе финансово-кредитных, органов государственной власти и органов местного самоуправления, неправительственных и международных организаций, временными творческими коллективами, создаваемыми для разработки финансовых аспектов новых проектных решений (ПК-13);

научно-исследовательская деятельность:

– способность осуществлять разработку рабочих планов и программ проведения научных исследований и разработок, подготовку заданий для групп и отдельных исполнителей (ПК-17);

– способность осуществлять разработку инструментов проведения исследований в области финансов и кредита, анализ их результатов, подготовку данных для составления финансовых обзоров, отчетов и научных публикаций (ПК-18);

– способностью осуществлять сбор, обработку, анализ и систематизацию информации по теме исследования, выбор методов и средств решения задач исследования (ПК-19);

– способностью осуществлять разработку теоретических и новых эконометрических моделей исследуемых процессов, явлений и объектов, относящихся к сфере профессиональной финансовой деятельности в области финансов и кредита, давать оценку и интерпретировать полученные в ходе исследования результаты (ПК-20);

– способностью выявлять и проводить исследование актуальных научных проблем в области финансов и кредита (ПК-21).

В результате изучения учебной дисциплины студент должен

знать:

- структуру финансового рынка, его участников и владеть основами экономических отношений, возникающих при трансформации сбережений в инвестиции;
- анализировать информацию о рисках на фондовом и ссудном рынке; - прогнозировать на основе собранных данных поведение анализируемого объекта;
- подходы и методы, применяемые для исследования инновационного развития экономики;

уметь:

- собирать, обрабатывать, анализировать и систематизировать финансово-экономическую информацию по теме исследования;
- осуществлять выбор инструментальных средств для обработки экономических данных; - представлять результаты аналитической и исследовательской работы в виде выступления, доклада, информационного обзора, аналитического отчета, статьи;
- анализировать:
- информацию о рисках на фондовом и ссудном рынке; - прогнозировать на основе собранных данных поведение анализируемого объекта;
- во взаимосвязи экономические явления, процессы, протекающие и используемые на микро-, мезо- и макроуровне.

владеть:

- методиками и средствами решения аналитических задач;
- методологией экономического исследования ссудного рынка;
- навыками самостоятельной работы по сбору и обработке статистической информации;
- способностью осуществлять сбор, обработку, анализ и систематизацию информации в сфере финансового обеспечения инновационного развития на микро-, мезо- и макроуровне.

4. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ И ФОРМЫ ОРГАНИЗАЦИИ УЧЕБНОГО ПРОЦЕССА

Дисциплина «Финансовые рынки и финансово-кредитные институты» включает в себя следующие формы организации учебного процесса: лекции, практические занятия, самостоятельную работу студентов.

При проведении лекций и практических занятий применяются мультимедийные презентации, раздаточные материалы.

При изучении данной дисциплины широко используются интерактивные формы проведения занятий (разбор конкретных ситуаций, дискуссионный обзор, внеаудиторная самостоятельная работа, балльно-рейтинговая система оценки успеваемости, личностно-ориентированное обучение, проблемное обучение).

Самостоятельная работа студентов предусматривает подготовку к практическим занятиям, подготовку конспектов по отдельным вопросам изучаемых тем, изучение учебно-методической литературы, аннотаций статей, подготовку презентаций и докладов.

Порядковый номер и тема	Краткое содержание темы
Содержательный модуль 1	
Тема 1. Структура современного финансового рынка	Эволюция финансового рынка и его функций. Участники финансового рынка. Виды финансовых посредников. Регулирование финансового рынка и деятельности его участников

Порядковый номер и тема	Краткое содержание темы
Тема 2. Регулирование финансового рынка и деятельности его участников	<p>Сущность регулирования финансового рынка: принципы, направления, уровни и формы регулирования.</p> <p>Государственное регулирование финансового рынка Украины: сущность, сферы и рычаги регулирования.</p> <p>Внутреннее регулирование финансового рынка.</p> <p>Международные нормы банковского регулирования и надзора.</p> <p>Регулирование финансового рынка в странах с развитой рыночной экономикой.</p>
Тема 3. Основные финансовые инструменты валютного рынка и стратегии участников рынка	<p>Понятие валютного рынка и его структура.</p> <p>Основные участники валютного рынка и их операции.</p> <p>Валютные операции на национальном валютном рынке.</p> <p>Основные финансовые инструменты валютного рынка и стратегии участников рынка.</p> <p>Регулирование открытых валютных позиций банков Банком России.</p>
Тема 4. Кредитный рынок, его основные характеристики и классификация	<p>Кредит как особый финансовый инструмент.</p> <p>Кредитный рынок, его основные характеристики и классификация.</p> <p>Банковский кредитный рынок: его сегменты, участники, кредитные продукты и кредитные технологии.</p> <p>Перспективы развития банковского кредитного рынка.</p> <p>Рынок ипотечного кредитования.</p> <p>Рынок микрокредитования (микрофинансирования).</p>
Тема 5. Институциональная структура рынка ценных бумаг	<p>Понятие рынка ценных бумаг и его функции.</p> <p>Виды и классификация ценных бумаг.</p> <p>Ипотечные ценные бумаги.</p> <p>Институциональная структура рынка ценных бумаг.</p> <p>Регулирование рынка ценных бумаг.</p> <p>Современные тенденции развития рынка ценных бумаг в Российской Федерации.</p>
Тема 6. Рынок страховых услуг, его структура и функции	<p>Сущность страхования, его формы и виды.</p> <p>Рынок страховых услуг, его структура и функции.</p> <p>Участники страхового рынка.</p> <p>Страховые продукты и технологии работы страховых компаний.</p> <p>Государственное регулирование страховой деятельности в РФ.</p> <p>Современное состояние российского страхового рынка и перспективы его развития.</p>
Тема 7. Рынок золота как особый сегмент финансового рынка	<p>Рынок золота как особый сегмент финансового рынка.</p> <p>Участники рынка золота и его функции.</p> <p>Основные виды банковских операций с драгоценными металлами и технологии их проведения.</p>

Тематический план

Названия содержательных модулей и тем	Количество часов							
	Очная форма				Заочная форма			
	Всего	в том числе			Всего	в том числе		
		лекции	практические	самостоятельная работа		лекции	практические	самостоятельная работа
Содержательный модуль 1								
Тема 1. Структура современного финансового рынка	20	2	4	14	20	0,2	1	18,8
Тема 2. Регулирование финансового рынка и деятельности его участников	24	4	4	16	24	1	1	22
Тема 3. Основные финансовые инструменты валютного рынка и стратегии участников рынка	20	2	4	14	20	0,5	0,5	19
Тема 4. Кредитный рынок, его основные характеристики и классификация	20	2	4	14	20	0,5	1	18,5
Тема 5. Институциональная структура рынка ценных бумаг	20	2	8	10	20	1	1	18
Тема 6. Рынок страховых услуг, его структура и функции	20	2	4	14	20	0,4	0,5	19,1
Тема 7. Рынок золота как особый сегмент финансового рынка	20	2	4	14	20	0,4	1	18,6
Всего часов	144	16	32	96	144	4	6	134

5. МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ЛЕКЦИОННЫХ, ПРАКТИЧЕСКИХ И ЛАБОРАТОРНЫХ ЗАНЯТИЙ

Темы лекционных занятий

№	Название темы	Количество часов
1	Структура современного финансового рынка	2
2	Регулирование финансового рынка и деятельности его участников	2
3	Основные финансовые инструменты валютного рынка и стратегии участников рынка	2
4	Кредитный рынок, его основные характеристики и классификация	2
5	Институциональная структура рынка ценных бумаг	4
6	Рынок страховых услуг, его структура и функции	2
7	Рынок золота как особый сегмент финансового рынка	2
	ИТОГО	16

Темы практических занятий

№	Название темы	Количество часов
1	Структура современного финансового рынка	4
2	Регулирование финансового рынка и деятельности его участников	4
3	Основные финансовые инструменты валютного рынка и стратегии участников рынка	4
4	Кредитный рынок, его основные характеристики и классификация	4
5	Институциональная структура рынка ценных бумаг	8
6	Рынок страховых услуг, его структура и функции	4
7	Рынок золота как особый сегмент финансового рынка	4
	ИТОГО	32

6. МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ ПО ОРГАНИЗАЦИИ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ СТУДЕНТОВ

Самостоятельная работа по дисциплине «Финансовые рынки и финансово-кредитные институты» для студентов включает:

- изучение отечественных нормативно-правовых документов по банковскому делу, финансовому анализу, финансовому, бюджетному и налоговому менеджменту;
- осмысление теоретических основ прослушанного лекционного материала;
- изучение отдельных тем или вопросов, которые предусмотрены для самостоятельной работы;
- подготовку конспектов по отдельным темам или вопросам, которые предусмотрены для самостоятельной работы;
- подготовку к практическим занятиям;
- решение и письменное оформление индивидуальных заданий, в том числе анализ статистических показателей деятельности банков;
- подготовку к выступлению с докладом;
- систематику изученного материала перед тестированием и модульным контролем.

Организация самостоятельной работы студентов

№	Название темы	Количество часов
1	Структура современного финансового рынка	12
2	Регулирование финансового рынка и деятельности его участников	12
3	Основные финансовые инструменты валютного рынка и стратегии участников рынка	12
4	Кредитный рынок, его основные характеристики и классификация	12
5	Институциональная структура рынка ценных бумаг	24
6	Рынок страховых услуг, его структура и функции	12
7	Рынок золота как особый сегмент финансового рынка	12
	ИТОГО	96

Темы докладов, выступлений

1. Проблема международных стандартов в сфере финансового рынка.
2. Проблема ограниченности доступа на мировые рынки для частного инвестора в России.

3. Проблемы и противоречия в нормативно-правовой базе функционирования финансового рынка России
4. Проблемы повышения капитализации компаний реального сектора. Поиск перспектив для эффективных капиталовложений: взгляд инвестора.
5. Проблемы расширения классов активов для секьюритизации в России.
6. Проблемы страновой диверсификации на фоне институциональной глобализации.
7. Развития ипотечного кредитования в регионах: тенденции, основные участники, механизмы рефинансирования, перспективы выпуска ценных бумаг.
8. Региональные фонды жилищного строительства: роль в развитии ипотеки в России.
9. Регулирование финансового рынка в Российской Федерации и основные направления его совершенствования.
10. Роль саморегулируемых организаций на финансовом рынке.
11. Создание алгоритма по арбитражным операциям для МТС на российском фондовом рынке.
12. Технологии успеха ратейлового негосударственного пенсионного фонда.
13. Тенденции развития и особенности корпоративного управления в России.
14. Универсальный сервис на рынке ценных бумаг как основа деятельности инвестиционной компании.
15. Факторы развития отрасли коллективных инвестиций и их роль в достижении "идеальной" модели фондового рынка в России.
16. Финансирование организации на рынке акционерного капитала с использованием биржевых механизмов.
17. Финансирование организации на рынке долгового капитала с использованием биржевых механизмов.
18. Фонд хедж-фондов - оптимальный способ инвестирования в хедж-фонды.
19. Фонды фондов: особенности формирования и управления, риск-менеджмент, специализация.
20. Формирование и развитие рынка ценных бумаг в Российской Федерации.
21. Функциональный анализ современного состояния фондового рынка в России.
22. Эволюция института секьюритизации и проблемы его развития в России.

7. КОНТРОЛЬНЫЕ ВОПРОСЫ К ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

1. Роль и место ценных бумаг в экономике страны.
2. Поиск и размещение информации в программах интернет-трейдинга (*).
3. Основные функции рынка ценных бумаг.
4. Ценные бумаги с фиксированным доходом: понятие, отличительные особенности.
5. Формирование российского рынка долговых ценных бумаг.
6. Особенности рынка своповых контрактов.
7. Роль муниципальных займов в становлении экономики России.
8. Корпоративные облигации российских эмитентов.
9. Методы сглаживания ценовых графиков в техническом анализе (*).
10. Фондовый кризис и его влияние на взаимосвязь сегментов финансового рынка.
11. Производные инструменты на фондовом рынке России.
12. Рынок корпоративных ценных бумаг как механизм перераспределения собственности.
13. Методы стоимостной оценки опционов в моделях Блэка-Шоулза (Black&Sholes) и Кокса-Росса-Рубинштейна (Cox, Ross&Rubinstein) (*).
14. Муниципальные облигационные займы: опыт и тенденции.

15. Дилеры на рынке ценных бумаг: права и обязанности.
16. Практическое применение меры риска (Value-at-Risk) портфельных инвестиций в рамках теории Марковица (*).
17. Траст на рынке ценных бумаг.
18. Депозитарная деятельность: проблемы и тенденции.
19. Инфраструктура фондового рынка.
20. Рынок регистрационных услуг: воздействие кризиса.
21. Вторичная эмиссия: роль эмитента и инвестора.
22. Построение и использование индекса относительной силы – RSI (relative strength index).
23. Взаимодействие регулирующих и правоохранительных органов на рынке ценных бумаг.
24. Российский рынок ценных бумаг: современное состояние и перспективы развития.
25. Андеррайтинг: возможности на российском РЦБ.
26. Политический риск в России и фондовый рынок.
27. Фондовые индексы на РЦБ: российский опыт.
28. Торговые системы на основе осцилляторов (детекторов изменений движения цены) (*).
29. Государственное регулирование как основа деятельности РЦБ.
30. Сегментация российского фондового рынка.
31. Перспективы развития инфраструктуры РЦБ.
32. Что такое фьючерсы на отдельные акции (single stock futures, SSF).
33. Опционы как инструмент для частных инвестиций.
34. Российский рынок срочных контрактов: современное состояние и перспективы развития.
35. Вексель: российская практика применения.
36. Рынок государственных обязательств: причины кризиса и перспективы возрождения.
37. Спекуляции фьючерсами на срочном рынке FORTS.
38. Рынок государственных ценных бумаг: значение, пути развития.
39. Фундаментальный анализ инвестиционных свойств ценных бумаг.
40. Ценные бумаги и деятельность банков.
41. Роль ФСФР в регулировании рынка ценных бумаг.
42. Правовое регулирование рынка ценных бумаг.
43. Технический анализ РЦБ.
44. Линии и фигуры технического анализа.
45. Классы производных инструментов на основе контрактов.
46. Особенности рынков производных инструментов на основе контрактов.
47. Фундаментальные начала фьючерсной торговли.
48. Организация фьючерсной торговли.
49. Организации, обеспечивающие функционирование фьючерсного рынка.
50. Клиринг, расчеты и процедура поставки актива на фьючерсном рынке.
51. Ценообразование на фьючерсном рынке.
52. Фундаментальный анализ российского фондового рынка
53. Особенности спецификации товарных фьючерсных контрактов.
54. Анализ и прогноз цен на фондовом рынке .
55. Особенности поставки по товарным фьючерсным контрактам.
56. Фьючерсы на валюту и на депозиты.
57. Фьючерсные контракты на фондовые активы.
58. Модели хеджирования фьючерсными контрактами.
59. Хеджирование фьючерсными контрактами от возможного снижения цены

актива.

60. Торговые решения участников фондового рынка – главный фактор изменения котировок (психология фондового рынка).
61. Спекулятивная деятельность на фьючерсном рынке.
62. Виды биржевых опционов.
63. Модели цены биржевого опциона.
64. Особенности механизма фьючерсной торговли опционными контрактами.
65. Базисные стратегии торговли опционными контрактами.
66. Комбинированные стратегии при торговле биржевыми опционами.
67. Графическая интерпретация опционных стратегий.
68. Процентный своп.
69. Товарный своп.
70. Многопериодные опционы.
71. Хеджирование фьючерсными контрактами от возможного повышения цены актива.
72. IPO - как способ привлечения инвестиций и инструмент выхода Российских компаний на рынок капиталов
73. Анализ рынка по основным секторам: наиболее перспективные компании, точки роста, новые компании с высоким потенциалом
74. Банк как участник фондового рынка: оптимизация портфеля и сбалансированные стратегии
75. Будущее российского фондового рынка в свете глобализации мировых финансовых рынков
76. Бум на эндаумент-фонды в России? Преимущества для ВУЗов и участников фондового рынка. Технологии работы Фондов.
77. Взаимосвязь банков и страховых компаний: проблемы и перспективы
78. Взаимосвязь развития ипотеки и инфляции, темпов строительства, роста доходов населения, ставки рефинансирования, цен на жилье
79. Влияние динамики цен на нефть на стоимость российских сырьевых компаний
80. Влияние динамики цен на нефть на котировки фьючерсов сырьевых компаний
81. Влияние макроэкономических факторов на капитализацию компании
82. Возможности использования механизма ПИФов недвижимости при реализации задач структурирования и объединения активов, защиты и управления активами
83. Возможные сценарии трансформации национальной банковской системы
84. Вопросы налогового сопровождения сделок по секьюритизации
85. Выявление факторов движения к идеальной модели фондового рынка на основе анализа причин лидерства отдельных национальных рынков в мировой конкуренции
86. Дивидендная политика эмитентов на российском фондовом рынке
87. Доходность и риск - методика определения инвестиционных предпочтений инвестора
88. Доходность МТС - миф или реальность
89. Зависимость российского финансового рынка от западного капитала
90. Значимые макроэкономические факторы и их влияние на финансовый рынок
91. Идеальная модель фондового рынка России на среднесрочную перспективу (до 2015 года)
92. Изменение конъюнктуры мировых рынков (товарных, сырьевых, фондовых) и влияние внешних факторов на российский фондовый рынок
93. Инвестирование на рынке предметов искусства
94. Инвестиционные банки на российском фондовом рынке: специфика деятельности, характер операций, возможности, западный опыт
95. Инвестиционные структурные продукты на фондовом рынке
96. Индекс ММВБ как основной индикатор Российского фондового рынка

97. Индексные фонды: особенности формирования, риск-менеджмент, поддержание структуры
98. Институциональные изменения на фондовом рынке
99. Инструменты традиционной и квазисекьюритизации: возможности развития в России
100. Ипотечные ПИФы как инструмент рефинансирования: тенденции и прогнозы
101. Как сделать из управляющей компании компанию, входящую в топ 5
102. Классическая теория портфельного инвестирования по Марковица. Применимость на российском фондовом рынке
103. Клиринг внебиржевых сделок через систему ClearPort на бирже NYMEX. Принципы ценнообразования, инструменты, участники и перспективы развития
104. Количественные методы измерения операционных рисков финансовых организаций
105. Коммерциализация фондовой биржи как способ привлечения средств на развитие биржевых технологий
106. Конкурентоспособность ПИФов перед ОФБУ и хедж-фондами
107. Концепция "финансового супермаркета" как элемент маркетинговой политики фондовой биржи
108. Критерии выбора объекта для инвестиций на российском фондовом рынке среди акций второго и третьего эшелонов
109. Личный финансовый план - российская практика и мировой опыт
110. Математические методы прогнозирования результатов маркетинговых действий компаний
111. Методы измерения риска активов
112. Методы оценки стоимости компании
113. Мировая конкуренция на фондовом рынке и шансы России войти в число мировых финансовых центров
114. Модель САРМ. Сферы применения
115. Накопительные схемы приобретения жилья: развитие и законодательное обеспечение
116. Необходимые факторы ликвидности нового финансового инструмента на российском фондовом рынке
117. Неэмиссионные ценные бумаги: особенности выпуска и обращения
118. Оптимальная методика расчета капитализации негосударственного пенсионного фонда
119. Организация выпуска и обращения РДР на российских торговых площадках
120. Основные направления политики по формированию идеальной модели фондового рынка в России
121. Особенности ипотечных ценных бумаг, обеспеченных коммерческой недвижимостью
122. Особенности продвижения инвестиционных и банковских услуг в регионах России (на примере региона проживания).
123. ОФБУ и ПИФы на российском рынке. Сравнение с западными аналогами
124. Перемещение капитала: развитые и развивающиеся рынки
125. Переуступка закладной и проблемы налогообложения банков -первичных кредиторов
126. Перспективы развития рынка коллективных инвестиций
127. Перспективы развития рынка коллективных инвестиций. Конкуренция и рост числа инвестиционных инструментов
128. Повышение инвестиционной грамотности населения и проблема популяризации инвестиционных инструментов
129. Правовое обеспечение рынка коллективных инвестиций

130. Применение нано-технологий на фондовом рынке
 131. Принципы построения и работы механических торговых систем на фондовом рынке

8. ОБРАЗЕЦ МОДУЛЬНОГО КОНТРОЛЯ

ГОУ ВПО «ДОНЕЦКИЙ НАЦИОНАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

Учетно-финансовый факультет

Направление подготовки:	<u>38.04.08 Финансы и кредит</u>
Магистерская программа:	<u>Банковское дело</u>
Образовательная программа:	<u>академическая магистратура</u>
Семестр	<u>3</u>
Учебная дисциплина	<u>Финансовые рынки и финансово-кредитные институты</u>

МОДУЛЬНАЯ КОНТРОЛЬНАЯ РАБОТА

ВАРИАНТ №1

1. Дайте развернутые ответы на теоретические вопросы:

- 1.1. Организация выпуска и обращения РДР на российских торговых площадках
 1.2. Ипотечные ПИФы как инструмент рефинансирования: тенденции и прогнозы

2. Дайте ответы на тесты:

1. К функциям финансового рынка не относится:
 А) мобилизация (аккумуляция) временно свободных денежных средств из Б) различных источников
 В) распределительная функция
 Г) регулирующая функция
2. Финансовыми инструментами рынка ценных бумаг не являются:
 А) акции
 Б) облигации
 В) сберегательные сертификаты
 Г) чек
3. Инвесторы – это субъекты финансового рынка:
 А) предоставляющие ссуду во временное пользование за определенный процент
 Б) привлекающие необходимые финансовые ресурсы за счет эмиссии ценных бумаг
 В) вкладывающие свои денежные средства в различные виды ценных бумаг с целью получения дохода
 Г) осуществляющие эмиссию ценных бумаг
4. Основные участники финансового рынка — это: ...
 А) продавцы финансовых инструментов
 Б) страховщики финансовых инструментов
 В) покупатели финансовых инструментов
 Г) финансовые посредники
5. Кредитный рынок – это рынок, на котором объектом купли-продажи являются ... все виды ценных бумаг:
 А) иностранная валюта и финансовые инструменты, обслуживающие операции с ней
 Б) свободные кредитные ресурсы и обслуживающие их финансовые инструменты
 В) все финансовые инструменты и услуги
6. Прямые участники финансовых операций на рынке ценных бумаг:
 А) кредиторы
 Б) эмитенты

В) заемщики

Г) продавцы валюты

7). Институты, не входящие в инфраструктуру фондового рынка

А) биржа

Б) страховые компании

В) пенсионные фонды

Г) коммерческие банки

8. Финансовым инструментом кредитного рынка не являются ...

А) денежные активы

Б) чеки

В) аккредитивы

Г) облигации

9. Облигация – это: ...

А) ценная бумага, удостоверяющая право владельца на долю в собственных средствах акционерного общества

Б) ценная бумага, представляющая собой долговое обязательство, позволяющее юридическим лицам и государству занимать денежные ресурсы на фондовом рынке

В) денежный документ, содержащий поручение о выплате определенной суммы денег данному лицу в соответствии с условиями указанными в документе

Г) документ о залоге должником имущества.

Утверждено на заседании кафедры «Финансы и банковское дело»,
протокол № ____ от «____» _____ 20____ г.

Заведующий кафедрой

Преподаватель

Критерии оценивания модульного контроля

<i>Номер задания</i>	<i>Количество баллов за задание</i>
1. Теоретические вопросы	2 * 2 = 4 баллов
2. Тестовые задания	9 * 0,5 = 4,5 баллов
Всего	8,5 баллов

9. ОБРАЗЕЦ ЭКЗАМЕНАЦИОННОГО БИЛЕТА

ГОУ ВПО «ДОНЕЦКИЙ НАЦИОНАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

Учетно-финансовый факультет

Направление подготовки:

38.04.08 Финансы и кредит

Магистерская программа:

Банковское дело

Образовательная программа:

академическая магистратура

Семестр

3

Учебная дисциплина

Финансовые рынки и финансово-кредитные институты

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 1

1. Теоретические вопросы:

1. Методы измерения риска активов
2. Методы оценки стоимости компании

2. Тестовое задание

1. Валютный рынок – это:

- а) официальный финансовый центр, где сосредоточена купля-продажа валютных ценностей на основе спроса и предложения;
- б) сфера экономических отношений, связанных с осуществлением сделок купли-продажи валютных ценностей, а также инвестированием валютного капитала;
- в) инструмент согласования интересов продавца и покупателя валют-ных ценностей.

2. К валютным ценностям относится:

- а) иностранная валюта;
- б) акции и облигации;
- в) ценные бумаги, выраженные в иностранной валюте;
- г) драгоценные металлы;
- д) казначейские билеты.

3. Особенности валютного рынка заключаются в:

- а) он не имеет четких географических границ;
- б) он не имеет определенного места расположения;
- в) на нем могут действовать только юридические лица;
- г) он функционирует круглосуточно;
- д) на нем может действовать неограниченное число участников;
- е) он обладает высокой степенью ликвидности.

4. Валютный рынок выполняет следующие функции:

- а) обслуживание международного оборота капитала, товаров и услуг;
- б) формирование валютного курса;
- в) получение спекулятивной прибыли;
- г) осуществление взаимоотношений между участниками валютного рынка по поводу купли-продажи валюты;
- д) диверсификация валютных резервов банков, корпораций и госу-дарств;
- е) осуществление взаимосвязи валютных, кредитных и финансовых рынков;
- ж) страхование валютных и кредитных рисков;
- з) осуществление государственного регулирования собственной де-нежно-кредитной политики.

5. Участниками валютного рынка являются:

- а) брокерские фирмы;
- б) фирмы, осуществляющие внешнеторговые операции;
- в) дилерские компании;
- г) компании, осуществляющие зарубежные вложения активов;
- д) центральные и коммерческие банки;
- е) частные лица;
- ж) валютные биржи;
- з) страховые компании;
- и) ссудно-сберегательные ассоциации.

6. Структура валютного рынка включает следующие элементы:

- а) международный;
- б) внутренний;
- в) биржевой;
- г) внебиржевой;
- д) рыночный;
- е) организованный.

7. Важнейшими элементами валютной системы являются:

- а) валютный курс;
- б) валютный механизм;

- в) валюта;
- г) конвертируемость валюты;
- д) международный валютный рынок.

Утверждено на заседании кафедры «Финансы и банковское дело»,
протокол № ____ от « ____ » _____ 20 ____ г.

Заведующий кафедрой _____

Преподаватель _____

Критерии оценивания экзамена

<i>Номер задания</i>	<i>Количество баллов за задание</i>
1. Теоретические вопросы	26 баллов
2. Тестовые задания	14 баллов
Всего	40 баллов

10. КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ

Оценивание качества знаний студентов осуществляется путем текущего, модульного, семестрового контроля. Объектом оценивания знаний студентов является программный материал дисциплины различного характера и уровня сложности, усвоение которого соответственно проверяется при текущем и итоговом контроле по 100-балльной шкале.

Формами текущего контроля знаний являются:

- устный опрос, собеседование – для проверки усвоения лекционного материала;
- решение задач и проблемных ситуаций – для контроля практических навыков и творческих поисков;
- выполнение заданий по самостоятельной работе – для развития навыков исследовательской работы и суммирования самостоятельной работы студентов.

Формой модульного контроля являются контрольные работы по содержательному модулю. Формой семестрового контроля является экзамен.

Текущий контроль оценивается в соответствии с разработанной рейтинговой системой по дисциплине.

Критерии оценивания текущего контроля знаний

Контрольные мероприятия по дисциплине	Количество баллов	Разделы и темы дисциплины
1. Текущий контроль		
Посещение лекционных занятий	5	Тема 1-7
Активность на практических занятиях, в том числе устный опрос, тестирование	18	Тема 1-7
2. Модульный контроль		
Контрольная работа № 1	8,5	Тема 1-4
Контрольная работа № 2	8,5	Тема 5-7
3. Самостоятельная работа	20	
4. Экзамен	40	
Итого	100	

Критерии оценивания самостоятельной и индивидуальной работы студентов

Вид работы	Плановые сроки выполнения	Формы контроля и отчетности	Максимальное количество баллов
1. Выполнение и защита реферата в виде доклада и презентации	Два раза в течение семестра	Обсуждение проведенной работы в аудитории	10
2. Обзор научных публикаций по темам лекций	В течение семестра	Обсуждение проведенной работы во время практических занятий и консультации	5
3. Составление аналитической записки по темам лекции	В течение семестра		5
Итого по СРС			20

Студенты могут получить дополнительные баллы при выполнении по дисциплине индивидуальных заданий творческого уровня, участия во внеучебной научно-исследовательской деятельности, в работе конференций, научных семинаров, подготовке научных публикаций и т.д., которые войдут в итоговый контроль.

Шкала оценивания: государственная и ECTS

Оценка по 100-бальной шкале	Оценка по шкале ECTS	Оценка по государственной шкале (экзамен)
90-100	A	5 (отлично)
80-89	B	4 (хорошо)
75-79	C	4 (хорошо)
70-74	D	3 (удовлетворительно)
60-69	E	3 (удовлетворительно)
35-59	FX	2 (неудовлетворительно) с возможностью повторной сдачи
0-34	F	2 (неудовлетворительно) с возможностью повторной сдачи при условии обязательного набора дополнительных баллов

Оценки «отлично» заслуживает студент, обнаруживший всестороннее, систематическое и глубокое знание программного материала; умение свободно выполнять задания, предусмотренные программой; усвоивший основную и знакомый с дополнительной литературой, рекомендованной программой; усвоивший взаимосвязь основных понятий дисциплины в их значении для приобретаемой профессии; проявивший творческие способности в понимании, изложении и использовании учебного материала. Экзаменуемый показывает продвинутый уровень формирования профессионально необходимых компетенций.

Оценки «хорошо» заслуживает студент, обнаруживший полное знание программного материала; успешно выполнивший предусмотренные в программе задания, усвоивший основную литературу, рекомендованную в программе, показавший систематический характер знаний по дисциплине и способность к их самостоятельному пополнению и обновлению в ходе профессиональной деятельности. Экзаменуемый показывает базовый уровень формирования профессионально необходимых компетенций.

Оценки «удовлетворительно» заслуживает студент, обнаруживший знания основного учебно-программного материала в объеме, необходимом для дальнейшей учебы и

предстоящей работы по специальности; справляющийся с выполнением заданий, предусмотренных программой, знакомый с основной литературой, рекомендованной программой. Как правило, оценка «удовлетворительно» выставляется студентам, допустившим погрешности в ответе на экзамене и при выполнении экзаменационных заданий, но обладающим необходимыми знаниями для их устранения под руководством преподавателя. Экзаменуемый показывает минимальный уровень формирования профессионально необходимых компетенций.

Оценка «неудовлетворительно» выставляется студенту, обнаружившему пробелы в знаниях основного учебно-программного материала, допустившему принципиальные ошибки в выполнении предусмотренных программой заданий. Как правило, оценка «неудовлетворительно» ставится студентам, которые не могут продолжить обучение или приступить к профессиональной деятельности без дополнительных занятий по соответствующей дисциплине.

11. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОГО ПРОЦЕССА

Лекционные и практические занятия по дисциплине «Финансовые рынки и финансово-кредитные институты» проводятся в учебных аудиториях для проведения занятий лекционного типа, практических занятий, текущего контроля и промежуточной аттестации учебного корпуса № 8, расположенного по адресу г. Донецк, ул. Челюскинцев, д. 198а, оснащенных комплектом учебной мебели, комплектом рабочего места преподавателя, магнитно-маркерной доской, мультимедийным комплектом (ноутбук, проектор) с выходом в сеть Интернет.

Самостоятельная работа студентов проходит в следующих помещениях:

- библиотека университета, укомплектована учебной мебелью на 401 посадочное место, расположена по адресу г. Донецк, проспект Гурова д.6;
- читальный зал № 3 авторефератов и диссертаций, укомплектован учебной мебелью на 50 посадочных мест, оснащен 2 компьютерами, расположен по адресу г. Донецк, пр. Театральный, д. 13, ауд. 106;
- читальный зал № 4 периодической литературы, укомплектован учебной мебелью на 31 посадочное место, оснащен 1 компьютером, расположен по адресу г. Донецк, ул. Университетская, 24, ауд. 19;
- зал электронной информации, укомплектован учебной мебелью на 40 посадочных мест, оснащен 14 компьютерами, расположен по адресу г. Донецк, проспект Гурова д.6, ауд. 107а;
- абонемент научной и учебной литературы, укомплектованы учебной мебелью соответственно на 4 и 6 посадочных места, расположены по адресу г. Донецк, проспект Гурова д.6;
- методический кабинет учетно-финансового факультета, укомплектован учебной мебелью на 35 посадочных мест, оснащен 4 компьютерами с выходом в сеть Интернет, расположен по адресу г. Донецк, ул. Челюскинцев, д. 198а, ауд. 105.

Индивидуальные и групповые консультации студентам для проведения самостоятельной работы предоставляются в кабинете кафедры финансов и банковского дела, укомплектованном комплектом мебели на 12 посадочных мест, оснащенном компьютером в комплекте (3 шт.), принтером, сканером, расположенном по адресу г. Донецк, ул. Челюскинцев 198а, ауд. 408.

12. РЕКОМЕНДОВАННАЯ ЛИТЕРАТУРА

№ п/п	Наименование	Кол-во экземпляров в библиотеке ДонНУ	Наличие электронной версии в ЭБС
<i>Основная литература</i>			
1.	Финансовые рынки и финансово-кредитные институты [Электронный ресурс]: учебное пособие / Е.Н. Демидова – Донецк: ДонНУ, 2019. – 102 Электронные данные (1 файл).	-	+
2.	Финансовые рынки и институты : учеб. пособие / В.П. Чижик. — М. : ФОРУМ : ИНФРА-М, 2018. — 384 с.	-	+
<i>Дополнительная литература</i>			
3.	Каячев, Г. Ф. Финансовые рынки и институты [Электронный ресурс] : Учеб. пособие / Г. Ф. Каячев, Л. В. Каячева, С. В. Кропачев, М. Н. Черных. - Красноярск: Сибирский федеральный ун-т, 2011. - 240 с		-
4.	Лаутс, Е. Б. Правовые аспекты антикризисного регулирования рынка банковских услуг и институт банкротства кредитных организаций [Электронный ресурс] : монография / Е. Б. Лаутс. - М. : Юстицинформ, 2018. - 412 с.		+
5.	Колмыкова , Л. И. Фундаментальный анализ финансовых рынков / Л. И. Колмыкова ; [Междунар. акад. бирж. торговли "Форекс Клуб"]. - 2-е изд. - М. [и др.] : Питер, 2007. - 282 с.	2	
6.	Федоров А. В. Анализ финансовых рынков и торговля финансовыми активами : [учеб. пособие] / А. В. Федоров. - 3-е изд. - М. : Питер, 2007. - 234 с.	2	
7.	Шеремет, А. Д. Финансы предприятий: менеджмент и анализ : учеб. пособие для студентов вузов, обучающихся по экон. специальностям и направлениям, для претендентов на получение квалификационного аттестата аудитора / А.Д. Шеремет, А.Ф. Ионова. - Изд. 2-е. - М. : ИНФРА-М, 2007. - 478, [1] с.	50	

13. ИНФОРМАЦИОННЫЕ РЕСУРСЫ

1. Журнал «Инвестиции» в России [Электронный ресурс]. - Режим доступа: <http://library.donnu.ru/catalog/>
2. Журнал «Инновации и инвестиции» - [Электронный ресурс]. - Режим доступа: <http://library.donnu.ru/catalog/>
3. Журнал «Право и инвестиции» - <http://www.dpr.ru> [Электронный ресурс]. - Режим доступа: <http://library.donnu.ru/catalog/>
4. Официальный сайт Банка России - <http://www.cbr.ru/>
5. Электронно-библиотечная система book.ru – <http://www.book.ru>

6. Полные справочники по законодательству Российской Федерации [Электронный ресурс]. - Режим доступа: Консультант плюс - <http://www.consultant.ru>
7. Министерство финансов ДНР <http://minfindnr.ru/>
8. Министерство доходов и сборов ДНР <http://mdsdnr.ru/>
9. Министерство экономического развития ДНР <http://mer.govdnr.ru/>
10. Правительство ДНР <http://dnr-online.ru/>
11. Министерство финансов Российской Федерации <http://minfin.ru/ru/>
12. Федеральное казначейство <http://roskazna.ru/>
13. Вестник Московского университета. Серия 6. Экономика. - М.: Изд-во Московского гос. ун-та [Электронный ресурс]. - Режим доступа: <http://library.donnu.ru/catalog/>
14. Финансы: Научно-практический журнал. - Москва: Общество с ограниченной ответственностью «КНИЖНАЯ РЕДАКЦИЯ «ФИНАНСЫ» [Электронный ресурс]. - Режим доступа: <http://library.donnu.ru/catalog/>
15. Финансы и кредит. - М.: ООО «Издательский дом ФИНАНСЫ и КРЕДИТ» [Электронный ресурс]. - Режим доступа: <http://library.donnu.ru/catalog/>
16. Вестник Донецкого национального университета [Текст] : научный журнал. Серия В. Экономика и право [Электронный ресурс]. - Режим доступа: <http://donnu.ru/science/journals>
17. Финансы. Учет. Банки [Электронный ресурс]. - Режим доступа: <http://donnu.ru/science/journals>
18. Методический кабинет факультета.
19. Научная библиотека ДонНУ. – Режим доступа: <http://library.donnu.ru>.

14. ПРОГРАММНОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ

1. Windows 7 PRO (корпоративная лицензия ДОННУ № 46484614).
2. Microsoft Office (корпоративная лицензия ДОННУ лицензия № 46472919).
3. Microsoft Visual Studio (лицензия программы DreamSpark для высших учебных заведений).
4. Adobe Acrobat Reader, xPDF, R Studio, Scilab (лицензии GPL, Apache, BSD для свободного программного обеспечения).

Рабочая программа рассмотрена и переутверждена на заседании кафедры финансов и банковского дела с изменениями (без изменений) на 20__ год.

Протокол № __ от «__» _____ 20__ г.

Заведующий кафедрой

П.В. Егоров

Рабочая программа рассмотрена и переутверждена на заседании кафедры финансов и банковского дела с изменениями (без изменений) на 20__ год.

Протокол № __ от «__» _____ 20__ г.

Заведующий кафедрой

П.В. Егоров