**УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ**
**«УНИВЕРСИТЕТ УПРАВЛЕНИЯ «ТИСБИ»**

Кафедра «Финансы и кредит»




# Рабочая программа дисциплины

Наименование дисциплины Финансовые рынки и финансовые институты

Направление подготовки 38.04.08 Финансы и кредит

Профиль Финансовый инжиниринг и финансовые технологии в цифровой экономике

Год набора 2026

Составитель:
канд. экон. наук, доц.
Базаров Р.Т.

Казань

# СОДЕРЖАНИЕ

1. Цели и задачи учебной дисциплины
2. Место дисциплины в структуре ОПОП
3. Требования к результатам освоения дисциплины
4. Структура и содержание дисциплины
4.1 Модульно-тематический план и пояснительная записка с указанием этапов формирования компетенций
4.2 Содержание дисциплины по темам (разделам)
4.3 Планы практических и семинарских занятий
5. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов
6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины
7. Материально-техническое обеспечение дисциплины
8. Оценка сформированности компетенций по изучаемой дисциплине

Приложение 1. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины
Приложение 2. Фонд оценочных средств для проведения текущей и промежуточной аттестации по дисциплине

## 1. Цели и задачи учебной дисциплины

**Целями освоения дисциплины являются:**

- получение студентами совокупности знаний о структуре существующего финансового рынка и об основных типах финансово-кредитных институтов;
- подробное и доступное рассмотрение целей и инструментов финансирования, изучение всех типов ценных бумаг и фондовых рынков, практики их функционирования, а также рассмотрение методов управления инвестициями на конкретных примерах.

**Задачи дисциплины**:

- Выявление содержания понятия финансового рынка, рассмотрение его основных целей, определение заинтересованных лиц;
- Изучение основных видов финансово-кредитных институтов;
- Представление о практике создания различных финансовых инструментов для решения задач инвестирования и привлечения средств на финансовых рынках.

**После освоения данной дисциплины студент должен:**

**Знать**:

- основные индикаторы финансового рынка и подходы к использованию фундаментальных данных на мировых финансовых рынках
- сегменты финансовых рынков, основные типы финансово- кредитных институтов как экономических агентов
- организацию финансовых рынков, роль информационно-аналитических, финансово-кредитных, депозитных и недепозитных институтов

**Уметь**

- выделять основные типы финансово-кредитных институтов
- проводить анализ состояния и развития основных сегментов финансовых рынков
- проводить анализ сущности, основных задач и понятия финансовой системы и финансовых рынков

**Владеть**

- навыками обоснования стратегии поведения экономических субъектов финансового рынка
- навыками обоснования стратегии поведения экономических субъектов финансового рынка
- навыками экспертной оценки посткризисного состояния и тенденций развития финансово-кредитных систем стран мира

**Место дисциплины в структуре ОПОП**

Дисциплина «Финансовые рынки и финансовые институты» относится к обязательной части блока 1 учебного плана и находится во взаимосвязи с дисциплинами согласно схеме:

Обеспечивающие учебные дисциплины

1. Экономическая теория (бакалавриат)
2. Рынок ценных бумаг (бакалавриат)
3. Инвестиции (бакалавриат)
4. Деньги, кредит, банки (бакалавриат)

| Финансовые рынки и финансовые институты |
|---|

Обеспечиваемые учебные дисциплины

1. Методика финансового консультирования
2. Учебная практика: (ознакомительная практика)
3. Производственная практика: (научно-исследовательская работа)

## 2. Требования к результатам освоения дисциплины

В соответствии с ФГОС ВО процесс изучения дисциплины предполагает, что выпускник должен обладать частью следующих профессиональных компетенций (ПК):

**ПК-6.** способен осуществлять разработку инструментов проведения исследований в области финансов и кредита, анализ их результатов, подготовку данных для составления финансовых обзоров, отчетов и научных публикации, выступать в качестве эксперта в процессе принятия важных финансовых решений

**Декомпозиция компетенций**

| **Индикаторы компетенции** | **Результаты обучения по дисциплине** |
|---|---|
| **Компетенция ПК-6** | |
| ПК-6.ПК-6. 1 Осуществляет сбор, обработку, анализ и систематизацию информации по теме исследования с применением современных цифровых технологий | ПК-6.ПК-6. 1 З.3 Знает основные индикаторы финансового рынка и подходы к использованию фундаментальных данных на мировых финансовых рынках<br>ПК-6.ПК-6. 1 У.3 Умеет выделять основные типы финансово-кредитных институтов<br>ПК-6.ПК-6. 1 В.3 владеет навыками обоснования стратегии поведения экономических субъектов финансового рынка |
| ПК-6.ПК-6. 2 Проводит выбор методов и средств решения задач исследования в области финансов и кредита | ПК-6.ПК-6. 2 З.6 Знает сегменты финансовых рынков, основные типы финансово- кредитных институтов как экономических агентов<br>ПК-6.ПК-6. 2 У.8 Умеет проводить анализ состояния и развития основных сегментов финансовых рынков<br>ПК-6.ПК-6. 2 В.8 владеет навыками обоснования стратегии поведения экономических субъектов финансового рынка |
| ПК-6.ПК-6. 3 Осуществляет экспертную оценку эффективности принятия финансовых решений в сфере своей профессиональной деятельности с применением современных цифровых технологий | ПК-6.ПК-6. 3 З.9 знает организацию финансовых рынков, роль информационно-аналитических, финансово-кредитных, депозитных и недепозитных институтов<br>ПК-6.ПК-6. 3 У.13 умеет проводить анализ сущности, основных задач и понятия финансовой системы и финансовых рынков с применением современных цифровых технологий<br>ПК-6.ПК-6. 3 В.13 владеет навыками экспертной оценки посткризисного состояния и тенденций развития финансово-кредитных систем стран мира |

## 4. Структура и содержание дисциплины.

### 4.1. Модульно-тематический план и пояснительная записка с указанием этапов формирования компетенций

Общая трудоемкость дисциплины очной формы обучения составляет 5 зачетных единиц (180 академических часа)

| Модульная разбивка учебной дисциплины | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| Направление Финансы и кредит<br>Дисциплина: «Финансовые рынки и финансовые институты» | | | | | |
| Наименование модулей | Количество ауд. часов | | Самостоят. работа | Всего часов | индикаторы компетенции |
| | Лекц. | Прак. | | | |
| **Модуль 1** | | | | | |
| **Тема 1**: «Сущность финансового рынка. Анализ состояния и развития финансового рынка России» | 4 | 4 | 6 | 14 | ПК-6.1 ПК-6.2 ПК-6.3 (З-3,З-6,З-9,У-3,У-8,У-13,В-3,В-8,В-13); |
| **Тема 2**: Основные типы финансово-кредитных институтов. | 4 | 6 | 6 | 16 | |
| **Тема 3**: Анализ мировых финансовых рынков | 4 | 4 | 6 | 14 | |
| **Модуль 2** | | | | | |
| **Тема 4**: Валютный рынок | 4 | 4 | 8 | 16 | ПК-6.1 ПК-6.2 ПК-6.3 (З-3,З-6,З-9,У-3,У-8,У-13,В-3,В-8,В-13); |
| **Тема 5**: Рынок ценных бумаг | 4 | 4 | 8 | 16 | |
| **Модуль 3** | | | | | |
| **Тема 6**: Значение финансовых рынков для предприятия | 4 | 4 | 6 | 14 | ПК-6.1 ПК-6.2 ПК-6.3 (З-3,З-6,З-9,У-3,У-8,У-13,В-3,В-8,В-13); |
| **Тема 7**: Основные индикаторы финансового рынка | 6 | 4 | 8 | 18 | |
| **Модуль4: «Курсовая работа»** | | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| Экзамен | | | 36 | 36 | |
| Курсовая работа | | | 36 | 36 | |
| ИТОГО | 30 | 30 | 120 | 180 | 4 |

Модульно – тематический план для заочной формы обучения

| Модульная разбивка учебной дисциплины | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| Направление Финансы и кредит<br>Дисциплина: «Финансовые рынки и финансовые институты» | | | | | |
| Наименование модулей | Количество ауд. часов | | Самостоят. работа | Всего часов | индикаторы компетенции |
| | Лекц. | Прак. | | | |
| **Модуль 1** | | | | | |
| **Тема 1**: «Сущность финансового рынка. Анализ состояния и развития финансового рынка России» | 1 | 2 | 11 | 14 | ПК-6.1 ПК-6.2 ПК-6.3 (З-3, З-6,З-9,У-3,У-8,У-13,В-3,В-8,В-13); |
| **Тема 2**: Основные типы финансово-кредитных институтов. | 1 | | 11 | 12 | |
| **Тема 3**: Анализ мировых финансовых рынков | | 2 | 10 | 12 | |
| **Модуль 2** | | | | | |
| **Тема 4**: Валютный рынок | 2 | 2 | 10 | 14 | ПК-6.1 ПК-6.2 ПК-6.3 (З-3,З-6,З-9,У-3,У-8,У-13,В-3,В-8,В-13); |
| **Тема 5**: Рынок ценных бумаг | 2 | 2 | 16 | 20 | |
| **Модуль 3** | | | | | |
| **Тема 6**: Значение финансовых рынков для предприятия | | 2 | 14 | 16 | ПК-6.1 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **Тема 7**: Основные индикаторы финансового рынка | 2 | - | 18 | 20 | ПК-6.2 ПК-6.3 (З-3,З-6,З-9,У-3,У-8,У-13,В-3,В-8,В-13); |
| **Модуль4: «Курсовая работа»** | | | | | |
| Экзамен | | | 36 | 36 | |
| Курсовая работа | | | 36 | 36 | |
| ИТОГО | 8 | 10 | 162 | 180 | 4 |

## Пояснительная записка

Данный модульный курс состоит из 4 модулей.

**Модуль 1** включает в себя три учебные темы.

В результате сдачи модуля студент

ПК-6.ПК-6. 1 З.3 Знает основные индикаторы финансового рынка и подходы к использованию фундаментальных данных на мировых финансовых рынках

ПК-6.ПК-6. 1 У.3 Умеет выделять основные типы финансово-кредитных институтов

ПК-6.ПК-6. 1 В.3 владеет навыками обоснования стратегии поведения экономических субъектов финансового рынка

ПК-6.ПК-6. 2 З.6 Знает сегменты финансовых рынков, основные типы финансово- кредитных институтов как экономических агентов

ПК-6.ПК-6. 2 У.8 Умеет проводить анализ состояния и развития основных сегментов финансовых рынков

ПК-6.ПК-6. 2 В.8 владеет навыками обоснования стратегии поведения экономических субъектов финансового рынка

ПК-6.ПК-6. 3 З.9 знает организацию финансовых рынков, роль информационно-аналитических, финансово-кредитных, депозитных и недепозитных институтов

ПК-6.ПК-6. 3 У.13 умеет проводить анализ сущности, основных задач и понятия финансовой системы и финансовых рынков

опыту разных стран и новым вызовам глобальной системы

ПК-6.ПК-6. 3 В.13 владеет навыками экспертной оценки посткризисного состояния и тенденций развития финансово-кредитных систем стран мира

По результатам освоения модуля проводится устный и тестовый опрос.

**Модуль 2** включает в себя три учебные темы.

В результате сдачи модуля студент

ПК-6.ПК-6. 1 З.3 Знает основные индикаторы финансового рынка и подходы к использованию фундаментальных данных на мировых финансовых рынках

ПК-6.ПК-6. 1 У.3 Умеет выделять основные типы финансово-кредитных ин-ститутов

ПК-6.ПК-6. 1 В.3 владеет навыками обоснования стратегии поведения эконо-мических субъектов финансового рынка

ПК-6.ПК-6. 2 З.6 Знает сегменты финансовых рынков, основные типы финан-сово- кредитных институтов как экономических агентов

ПК-6.ПК-6. 2 У.8 Умеет проводить анализ состояния и развития основных сегментов финансовых рынков

ПК-6.ПК-6. 2 В.8 владеет навыками обоснования стратегии поведения эконо-мических субъектов финансового рынка

ПК-6.ПК-6. 3 З.9 знает организацию финансовых рынков, роль информаци-онно-аналитических, финансово-кредитных, депозитных и недепозитных ин-ститутов

ПК-6.ПК-6. 3 У.13 умеет проводить анализ сущности, основных задач и поня-тия финансовой системы и финансовых рынков

опыту разных стран и новым вызовам глобальной системы

ПК-6.ПК-6. 3 В.13 владеет навыками экспертной оценки посткризисного со-стояния и тенденций развития финансово-кредитных систем стран мира.

По результатам освоения модуля проводится устный и тестовый опрос.

**Модуль 3** включает в себя три учебные темы.

В результате сдачи модуля студент

ПК-6.ПК-6. 1 З.3 Знает основные индикаторы финансового рынка и подходы к использованию фундаментальных данных на мировых финансовых рынках

ПК-6.ПК-6. 1 У.3 Умеет выделять основные типы финансово-кредитных институтов

ПК-6.ПК-6. 1 В.3 владеет навыками обоснования стратегии поведения экономических субъектов финансового рынка

ПК-6.ПК-6. 2 З.6 Знает сегменты финансовых рынков, основные типы финансово- кредитных институтов как экономических агентов

ПК-6.ПК-6. 2 У.8 Умеет проводить анализ состояния и развития основных сегментов финансовых рынков

ПК-6.ПК-6. 2 В.8 владеет навыками обоснования стратегии поведения экономических субъектов финансового рынка

ПК-6.ПК-6. 3 З.9 знает организацию финансовых рынков, роль информационно-аналитических, финансово-кредитных, депозитных и недепозитных институтов

ПК-6.ПК-6. 3 У.13 умеет проводить анализ сущности, основных задач и понятия финансовой системы и финансовых рынков

опыту разных стран и новым вызовам глобальной системы

ПК-6.ПК-6. 3 В.13 владеет навыками экспертной оценки посткризисного со-стояния и тенденций развития финансово-кредитных систем стран мира.

По результатам освоения модуля проводится устный и тестовый опрос.

**Модуль 4 «Курсовая работа»**

Планируемые образовательные результаты по модулю:

В результате сдачи модуля студент сможет подтвердить, что усвоил достаточное количество знаний по дисциплине, способен их практически реализовать, выработал умение исследовать избранную тему курсовой работы с обоснованной аргументацией своих действий.

Оценка курсовых работ осуществляется по совокупности реализованных в работе требований, определяемых как задачи, которые необходимо решить при написании курсовой работы.

## 4.2. Содержание дисциплины по темам (разделам)

### Тема 1. Сущность финансового рынка. Анализ состояния и развития финансового рынка России

Предпосылки возникновения финансового рынка. Понятие финансового рынка, его основные цели, структура. Основные участники финансового рынка. Основные факторы развития финансового инжиниринга.. Основные направления развития финансового рынка России

### Тема 2. Основные типы финансово-кредитных институтов

Государственные и частные, коммерческие организации, уполномоченные осуществлять финансовые операций по кредитованию, депонированию вкладов, ведению расчетных счетов, купле и продаже валюты и ценных бумаг, оказанию финансовых услуг и др. Банки, финансовые компании, инвестиционные фонды, сберегательные кассы, пенсионные фонды, взаимные фонды, страховые компании.

### Тема 3. Анализ мировых финансовых рынков

Регуляторы мировых финансовых рынков, инструменты валютной политики центральных банков и характер их влияния на валютные курсы. Подходы к использованию фундаментальных данных на мировых финансовых рынках.

### Тема 4. Валютный рынок

Предпосылки для развития и становления современного валютного рынка. Виды валютных операций, их эволюция. Основные характеристики современных мировых валютных рынков. Инструменты валютного рынка. Участники валютного рынка Связь валютного рынка с другими мировыми рынками

### Тема 5. Рынок ценных бумаг

Предпосылки для развития и становления современного рынка ценных бумаг. Виды рынка ценных бумаг, их взаимосвязь. Основные характеристики современных мировых рынков ценных бумаг. Инструменты рынка ценных бумаг. Участники рынка ценных бумаг. Связь рынка ценных бумаг с другими мировыми рынками

## Тема 6. Значение финансовых рынков для предприятия

Схема взаимодействия предприятия с финансовым рынком. Эффективность финансового рынка. Деятельность предприятий на финансовых рынках

## Тема 7. Основные индикаторы финансового рынка

Основные индикаторы экономической статистики, публикуемые мировыми информационными агентствами. Биржевые индексы, кредитные рейтинги.

Понятие и необходимость использования индикаторов фондового рынка, их и методы расчета. Особенности процесса глобализации. Основные тенденции изменения индикаторов финансового рынка.

## 4.3. Планы семинарских и практических занятий

### Тема 1. Сущность финансового рынка. Анализ состояния и развития финансового рынка России

***Вопросы для обсуждения***

1. Раскройте предпосылки создания финансового рынка
2. На что направлен финансовый рынок?
3. Дайте определение финансового инжиниринга с точки зрения различных авторов.
4. Раскройте ключевые понятия финансового рынка.
5. Опишите основные сегменты финансового рынка.

### Тема 2. Основные типы финансово-кредитных институтов

***Вопросы для обсуждения***

1. Основные типы финансово-кредитных институтов?
2. Опишите финансовые компании, инвестиционные фонды, сберегательные кассы, пенсионные фонды, взаимные фонды, страховые компании.
3. Перечислите основные функции коммерческого банка в российских экономических условиях;
4. В чём отличие специализированных финансово-кредитных институтов в России.

***Задание***

Выполните задания (тесты) множественного выбора.

*Инструкция.* Обведите кружком символ (ы), соответствующий правильному ответу.

1. К функциям финансового рынка не относится …
А) мобилизация (аккумуляция) свободных денежных средств
Б) эмиссия финансовых инструментов
В) распределение свободных финансовых ресурсов
Г) перераспределение финансовых ценностей

2. К важнейшим особенностям функционирования современного финансового рынка не относится …
А) превращение финансового рынка в главное звено рыночных отношений отдельных стран и всего мира
Б) в отличие от других рынков объектом финансового рынка становится финансовая самостоятельность территорий, регионов и государств
В) происходит сокращение валютного рынка
Г) главным смыслом финансового рынка становится перераспределение финансовых ресурсов участников экономических отношений

3. Финансовый рынок не классифицируется по …
А) объектам
Б) субъектам
В) форме функционирования
Г) размерам

4. Финансовый рынок представляет собой …
А) систему купли-продажи денежных (финансовых) инструментов
Б) механизм денежного обращения
В) систему экономических отношений
Г) механизм рыночного обращения

5. В реальной экономике финансовый рынок выступает в качестве …
А) экономического явления
Б) экономической категории
В) стоимостного инструмента
Г) институциональной игры

6. Сумма финансовых сделок может возрастать при уменьшении объема производства материальных благ
А) может
Б)не может
В) только теоретически
Г) вопрос поставлен некорректно

7. Финансовый рынок не включает …
А) рынка кредитов
Б) рынка золота
В) рынка ценных бумаг
Г) страхового рынка

8. Коммерческий банк является:
А) Проводником денежно-кредитной политики государства.
В) Казначеем государства.
С) Кредитором юридических и физических лиц.

9. Одним из принципов деятельности коммерческого банка является:
A) Работа в пределах реально имеющихся ресурсов.
B) Стихийное регулирование деятельности.
C) Децентрализация системы расчётов.
D) Дифференцированный подход при кредитовании.

10. По характеру выполняемых операций коммерческие банки подразделяются на:
S) Бесфилиальные и многофилиальные.
J) Кооперативные и акционерные.
*C)* Малые и средние.
*D)* Универсальные и специализированные.

## Тема 3. Анализ мировых финансовых рынков

***Вопросы для обсуждения***

1. Функции мирового финансового рынка
2. Типы мирового финансового рынка
3. Структура мирового финансового рынка
4. Классификация мирового финансового рынка
5. Субъекты и институциональная структура мирового финансового рынка

***Задание***

Выполните задания (тесты) множественного выбора.

*Инструкция.* Обведите кружком символ (ы), соответствующий правильному ответу.

1. Какие из следующих новостей не могут существенно повлиять на мировые финансовые рынки?
А) Объем розничных продаж в Великобритании существенно упал по сравнению с предыдущим месяцем.
Б) Министр финансов Японии объявляет о намерении не допустить дальнейшего укрепления JPY.
В) Ранен президент США.
Г) Во Вьетнаме произошло извержение вулкана.

2.. Целью валютной интервенции, проводимой ЦБ Японии обычно является:
A) Удешевление JPY против CHF.

Б) Удорожание USD против JPY.
В) Удешевление USD против JPY.
Г) Удорожание JPY против EUR.

3. Выберете из ниже перечисленных государств государство с ярко выраженной экспортной экономикой.
А) США
Б) Испания
В) Великобритания
Г) Швейцария

4. Наиболее распространенные сделки на финансовом рынке
А) инвестиционные
Б) спекулятивные
В) операции по переводу денег
Г) страховые

5. Наиболее существенная сторона международного финансового взаимодействия
А) позитивное сотрудничество
Б) распределение и перераспределение денежных потоков
В) опосредование международного товарооборота
Г) содержание межгосударственных общественных организаций

6. К важнейшим особенностям современных международных финансовых систем не относится …
А) повсеместное усиление конкуренции экономического развития субъектов мирового сообщества
Б) интенсификация развития и усиление спекулятивного характера международного финансового рынка
В)развитие нанотехнологий

Г) глобализация мировой экономики и финансов
7. Что не свойственно рыночным международным финансово-кредитным отношениям?
А) финансовая помощь
Б)товарно-денежный оборот
В) перераспределение денежных потоков
Г) действие закона спроса и предложения

8. Наиболее результативной сферой международных финансовых отношений является …
А) рынок ценных бумаг
Б) кредитно-страховой рынок
В) валютный рынок
Г) международный товарооборот

9.Главная тенденция современной структуры финансовой системы общества.
А ) рост мирового ВВП
Б) повышение роли финансов граждан
В) усиление роли международных финансов
Г) интенсификация финансов организаций

10. Финансовая система общества — это …
А) совокупность сфер, выражающих взаимосвязи субъектов по поводу изменения денежного объекта
Б) совокупность денежных средств всех субъектов
В) конкретная форма реализации государственного бюджета
Г) совокупность бюджетов страны

## Тема 4. Валютный рынок

***Вопросы для обсуждения***

1. Экономическая сущность валютного рынка.
2. Функции валютного рынка.
3. Участники валютного рынка

***Задание***

Выполните задания (тесты) множественного выбора.

*Инструкция.* Обведите кружком символ (ы), соответствующий правильному ответу.

1. Специфическая черта валютного рынка
А) обусловленность международной экономической деятельностью
Б) платность валютных сделок
В) срочность сделок
Г) наличие теневой сферы рынка

2. Наиболее значительная в количественном отношении сфера финансового рынка …
А) рынок кредитов
Б) рынок ценных бумаг
В) страховой рынок
Г) валютный рынок

3. Какое из следующих утверждений является правильным?
А) Валютные сделки совершаются на биржах большинства финансовых центров мира.

Б) Валютный рынок является централизованным.
В) Валютой торгуют только в Лондоне, Нью-Йорке и Токио.
Г) Операции с иностранной валютой осуществляются на внебиржевом рынке.

4. Главный смысл современного мирового валютного рынка состоит в …
А)перераспределении стоимости между экономическими субъектами
Б) обеспечении мирового товарооборота
В) обеспечении международного туризма
Г) накоплении мирового капитала

5. Наиболее результативной сферой международных финансовых отношений является …
А) рынок ценных бумаг
Б) кредитно-страховой рынок
В) валютный рынок
Г) международный товарооборот

6. Наибольшим по объему суточных сделок является …
А) рынок акций
Б) рынок облигаций
В) валютный рынок
Г) рынок векселей и сертификатов.

7Валюты, отнесенные к свободно используемым валютам в современной мировой валютной системе
А)Фунт стерлингов
Б) Евро
В) Российский рубль
Г) Японская иена
Д) Доллар США
Е) Швейцарский франк

8. Виды предоставляемых кредитов международными финансовыми организациями по целям:
А) стабилизационные
Б) покрытие дефицита платежного баланса
В) инвестиции в акционерный капитал предприятий, банков
Г) структурные

9.Валюта платежа в международных расчетах:
А) золотые слитки
Б) национальная
В) иностранная
Г) международная валютная единица (СДР и др.)

10. Виды предоставляемых кредитов международными финансовыми организациями по срокам:
А) краткосрочные
Б) долгосрочные
В) бессрочные
Г) среднесрочные

## Тема 5. Рынок ценных бумаг

***Вопросы для обсуждения***

1. Сущность рынка ценных бумаг и его место в финансовой системе
2. Основные участники рынка ценных бумаг
3. Основные виды рынка ценных бумаг

***Задание***

Выполните задания (тесты) множественного выбора.
*Инструкция.* Обведите кружком символ (ы), соответствующий правильному ответу.
1. Рынок ценных бумаг является частью рынка
А) финансового
Б) денежного
В) капиталов
Г) реальных активов

2. Фьючерсные контракты обращаются
А) только на бирже
Б) только на внебиржевом рынке
В) как на биржевом, так и на внебиржевом рынке

3.Уступка прав требования по именным депозитам осуществляется посредством
А) бланкового индоссамента
Б) простого вручения
В) цессией
Г) записью в реестре владельцев именных ценных бумаг

4. В Российской Федерации обязываться векселем могут
А) только юридические лица
Б) только физические лица
В) юридические и физические лица

5. По российскому законодательству на предъявителя могут быть выписаны
А) вексель
Б) чек
В) простое складское свидетельство
Г) двойное складское свидетельство

6. Инвестиционный пай предоставляет инвесторам право
А) получать дивиденды
Б) получать проценты
В) требовать выкупа пая у управляющей компании
Г) участвовать у управлении инвестиционным фондом

7. Главным и последним плательщиком по простому векселю является
А) векселедатель
Б) акцептант
В) авалист
4) последний индоссант

8. Конвертируемые облигации – это облигации, которые
А) могут быть обменены на акции
Б) обеспечивают получение дохода в свободно конвертируемой валюте
В) обеспечивают индексацию номинала в соответствии с изменениями курса национальной валюты к свободно конвертируемой валюте

9. На российских фондовых биржах сделки заключать могут
А) любые продавцы и покупатели ценных бумаг, включенных в число обращающихся на данной бирже
Б) любые профессиональные участники рынка ценных бумаг
В) только банки – профессиональные участники рынка ценных бумаг
Г) только брокеры, дилеры и управляющие

10. Отдельные выпуски эмиссионных ценных бумаг от процедуры государственной регистрации освобождаться
А) могут
Б) не могут
В) могут, если они размещаются по закрытой подписки
Г) могут, если не требуется регистрация проспекта эмиссии

## Тема 6. Значение финансовых рынков для предприятия

***Вопросы для обсуждения***

1. Основные области приложения финансовых рынков.
2. Схема взаимодействия предприятия с финансовым рынком.
3. Критерии эффективности работы предприятия на финансовом рынке

***Задание***

Выполните задания (тесты) множественного выбора.

*Инструкция.* Обведите кружком символ (ы), соответствующий правильному ответу.

1. Невозможность предприятия вызвать коммерческий или иной интерес у реального инвестора, включая неспособность самого субъекта «принять инвестиции» и умело ими распорядиться – это:
А) неграмотность менеджмента;
Б) низкая инвестиционная привлекательность;
В) отсутствие необходимости у предприятия.

2. Укажите основную цель функционирования предприятия в рыночных условиях:
А) получение прибыли и ее максимизация
Б) повышение заработной платы работников
В) выход на мировой рынок
Г) максимальное удовлетворение общественных потребностей
Д) совершенствование производственной структуры предприятия
Е) внедрение новой техники и технологии

3. Предприятия по формам собственности классифицируются на:
А) индивидуальные
Б) частные
В) малые
Г) государственные
Д) коллективные
Е) муниципальные

4. Задачи предприятия определяются:
А) интересами владельца
Б) размером капитала
В) ситуацией внутри предприятия
Г) высшим руководством
Д) коллективом предприятия
Е) внешней средой

5.Выделите четыре признака классификации рынков по характеру товарообмена:
А) рынок товаров и услуг, рынок денег (капитала), рынок технологий, рынок информации
Б) рынок товаров и услуг, рынок средств производства, рынок интеллектуальной продукции, рынок труда
В) рынок труда, рынок ценных бумаг, финансовый рынок и рынок интеллектуальной собственности
Г) рынок труда, рынок интеллектуальной продукции, финансовый рынок, рынок товаров и услуг

6. В дочерней компании материнская компания имеет долю в уставном капитале более:
А). 15%
Б). 20%
В). 35%
Г). 45%
Д). 50%

7.Собственными финансовыми ресурсами предприятия являются:
А) целевое финансирование, средства, привлеченные путем размещения акций на бирже, добавочный капитал
Б)уставный капитал, страховое возмещение по наступившим рискам, средства, полученные от партнера для осуществления совместной деятельности (по договору простого товарищества)
В)прибыль от реализации основных средств и других активов, амортизационные отчисления, нераспределенная прибыль прошлых лет
Г)все перечисленное

8. Основополагающее звено финансовой системы — это:
А) мировые финансы
Б) государственный бюджет
В) финансы предприятий

9. Под финансами следует понимать:
А) денежные средства, находящиеся в распоряжении государства, компаний, учреждений, организаций и населения
Б) денежные отношения, связанные с формированием, распределением и использованием денежных фондов
В) фонды денежных средств

10.Финансовое состояние предприятия характеризуется:
А)совокупностью показателей, отражающих процесс форми¬рования и использования его финансовых средств
Б) потребностью в кредите в случаях несоответствия денежных поступлений и обязательств по размерам и срокам
В) совокупностью показателей, отражающих объем продаж, долю рынка и другие показатели, отражающие конкурентоспособность предприятия

## Тема 7: Основные индикаторы финансового рынка

***Вопросы для обсуждения***

1. Основные типы индикаторов финансового рынка?
2. Основные тенденции изменения индикаторов фондового рынка в условиях финансового кризиса

3. Тенденции изменения индикаторов фондового рынка в условиях посткризисной экономики

***Задание***

Выполните задания (тесты) множественного выбора.

*Инструкция.* Обведите кружком символ (ы), соответствующий правильному ответу.

1. Раздел общего анализа, посвященный изучению внутренних и внешних факторов экономического состояния эмитента с целью получения прогноза изменения стоимости его ценных бумаг:
А) статистический анализ;
Б) финансовый анализ;
В) фундаментальный анализ;
Г) технический анализ.

2. Какой вид анализа эффективно работает на долгосрочную перспективу?
А) фундаментальный анализ;
Б) технический анализ.

3. Самым старым и распространенным фондовым индексом является:
А) S&P 100;
Б) Nikkey-225;
В) Dow Jones;
Г) CAC-40.

4. Соотношение, показывающее какую цену должен заплатить инвестор за единицу прибыли:
А) Дивиденд на одну акцию / Рыночная цена акции;
Б) EPS;
В) P/E;
Г) D/E.

5. Первый биржевой индекс предложил:
А) Уильям Шарп;
Б) Чарльз Доу;
В) Гарри Марковиц;
Г) Уоррен Баффит.

6. Выберите не существующую календарную аномалию:
А) эффект января;
Б) эффект понедельника;
В) эффект четверга;

Г) эффект праздничного дня.

7. Анализ, исследующий динамику рынка посредством графиков, с целью прогнозирования будущего направления движения цен:
А) статистический анализ;
Б) финансовый анализ;
В) фундаментальный анализ;
Г) технический анализ.

8. Тренд (тенденция) называется бычьей при:
А) движении цены вверх;
Б) движении цены вниз;
В) отсутствии определенности.

9. Линии, соединяющие важные максимумы (вершины) рынка, возникающие, когда покупатели больше либо не могут, либо не хотят покупать данный товар по более высоким ценам, называются:
А) линии поддержки;
Б) линии сопротивления.

10. Линии, соединяющие важные минимумы (низы) рынка и возникают, когда продавцы больше либо не могут, либо не хотят продавать данный товар по более низким ценам, называются:
А) линии поддержки;
Б) линии сопротивления.

## 5. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающихся

Целью самостоятельной работы студентов является овладение фундаментальными знаниями, профессиональными умениями и навыками, опытом творческой, исследовательской деятельности.

Самостоятельная работа (далее СРС) выступает формой, методом, средством и условием развития познавательной активности будущего выпускника. Ее содержательная сторона осуществляется через планируемую учебную, учебно-исследовательскую, научно-исследовательскую деятельность студентов, выполняемую во внеаудиторное время по заданию и при методическом руководстве преподавателя, однако без его непосредственного участия.

Содержание и объем самостоятельной работы студента определяется требованиями Федерального Государственного образовательного стандарта, учебными планами направления подготовки и программами конкретных дисциплин.

Методологическими принципами самостоятельной работы являются: целенаправленность, системность; систематичность; логичность; эффективность; полезность и безопасность.

Логика процесса обучения определяет задачи самостоятельной работы студента.

Основными задачами самостоятельной работы студента, являются:

- усвоение новых знаний, углубление и повторение ранее приобретенных знаний с целью их обобщения и систематизации;
- формирование необходимых компетенций, профессиональных умений и навыков по направлению подготовки.
- применение полученных компетенций, знаний, умений, навыков на практике.

Формы самостоятельной работы представлены в заданиях для самостоятельной работы студентов. Для усвоения новых знаний, углубления и повторения, ранее приобретенных знаний их обобщения и систематизации предусмотрены следующие формы:

- восприятие учебной информации из различных источников;
- подготовка текстуального конспекта;
- репродуктивное воспроизведение знаний;
- подготовка свободного конспекта, являющегося результатом осмысления студентом изученного материала;
- составление плана прочитанной книги (статьи);
- накопление научной информации в виде выписок и цитат;
- составление библиографического списка;
- графическое представление учебного материала в форме таблиц, классификационных, технологических и других схем, диаграмм и т.п.;
- подготовка устных и письменных ответов на предложенные преподавателем вопросы;

- составление вопросов по изученному материалу;
- подготовка тематического словаря;
- решение и составление кроссвордов, требующих знаний учебного материала;
- рецензирование и оценка письменных работ сокурсников.
- подготовка рефератов, обзоров, справок, тезисов, докладов, рекламных проспектов и т.д.;
- рецензирование научной и учебной литературы;
- установление факторов, влияющих на то или иное явление, процесс, событие;
- анализ полноты, достоверности, доступности, системности, доказательности материала в различных источниках;
- сбор и анализ информации для проведения курсового и дипломного (квалификационного) исследования.

Контроль над ходом и результатами самостоятельной работы студентов может осуществляться в сплошной, индивидуальной, выборочной формах.

В процессе самостоятельного изучения студент обязан проработать перечисленные ниже вопросы и темы, для углубления теоретических знаний и практических навыков, на основании методических рекомендаций по самостоятельной работе.

В процессе самостоятельного изучения студент обязан проработать перечисленные ниже темы, для углубления теоретических знаний и практических навыков.

**Темы для самостоятельного изучения**

1. Проведение сравнительного анализа определений финансового рынка.
2. Изучение направлений влияния отдельных факторов на финансовый рынок.
3. Практические примеры проявления отдельных факторов и их комбинаций при изучении финансовых индикаторов.
4. Классификация рынка ценных бумаг: международная практика.
5. Защищенные от падения облигации. Незащищенные от падения облигации. Частично защищенные облигации.
6. Выпуск обеспеченных ценных бумаг.
7. Мировой валютный рынок: история развития
8. Мировой валютный рынок: тенденции развития
9. Международные финансово-кредитные институты
10. Специализированные финансово-кредитные институты: российская практика
11. Специализированные финансово-кредитные институты: зарубежный опыт.
12. Управление деятельностью предприятия на финансовом рынке.
13. Развитие программ российских эмитентов: проблемы и перспективы.

14. Оценка возможности и целесообразности выпуска эмиссионных ценных бумаг в России.
15. Структурированные акции в российской практике: анализ развития рынка и оценка перспектив

## Примерная тематика курсовых работ

1. Роль финансового рынка в мобилизации и распределении финансовых ресурсов
2. Инвестиционная политика банков на рынке ценных бумаг России
3. Определение ценных бумаг в законодательстве и экономических теориях разных стран
4. Эмиссия акций как средство финансирования фирмы
5. Развитие кредитной системы в условиях современного рынка ценных бумаг
6. Факторы конкурентной способности инвестиционных компаний на финансовом рынке
7. Государственное регулирование финансового рынка в РФ.
8. Реструктуризация акционерного общества
9. Лицензирование профессиональных участников рынка ценных бумаг.
10. Мировой валютный рынок: история развития
11. Мировой валютный рынок: тенденции развития
12. Международные финансово-кредитные институты
13. Специализированные финансово-кредитные институты: российская практика
14. Специализированные финансово-кредитные институты: зарубежный опыт.
15. Структурированные акции в российской практике: анализ развития рынка и оценка перспектив
16. Экономическая природа рынка ценных бумаг и проблемы его формирования в российской экономике.
17. Развитие рынка ценных бумаг в условиях глобализации
18. Индикаторы финансового рынка
19. Субъекты и институциональная структура мирового финансового рынка
20. Финансовые риски на фондовом рынке
21. Рынок ценных бумаг и защита рядовых инвесторов
22. Финансовые технологии паевых инвестиционных фондов
23. Валютный рынок и валютные операции в России
24. Мировой валютный рынок Forex

Экзаменационные вопросы

1. Понятие мировой финансовой системы
2. Международные финансовые центры
3. История возникновения финансового рынка.
4. Предпосылки возникновения финансового рынка.
5. Понятие финансового рынка, его основные цели, структура.
6. Основные участники финансового рынка.
7. Основные факторы развития финансового инжиниринга.
8. Основные направления развития финансового рынка России
9. Государственные и частные, коммерческие организации, уполномоченные осуществлять финансовые операций по кредитованию, депонированию вкладов, ведению расчетных счетов, купле и продаже валюты и ценных бумаг, оказанию финансовых услуг и др.
10. Банки и банковская система
11. Финансовые компании
12. Фонды коллективного инвестирования
13. Инвестиционный потенциал государственных и негосударственных пенсионных фондов
14. Взаимные фонды: сущность, понятие, тенденции развития
15. Страховые компании.
16. Специализированные финансово-кредитные институты: российская практика
17. Специализированные финансово-кредитные институты: зарубежный опыт.
18. Регуляторы мировых финансовых рынков
19. Инструменты валютной политики центральных банков
20. Характер влияния инструментов валютной политики на валютные курсы.
21. Подходы к использованию фундаментальных данных на мировых финансовых рынках.
22. Предпосылки для развития и становления современного валютного рынка.
23. Виды валютных операций, их эволюция.
24. Основные характеристики современных мировых валютных рынков.
25. Инструменты валютного рынка.
26. Участники валютного рынка
27. Связь валютного рынка с другими мировыми рынками
28. Финансовый инжиниринг: сущность, понятие, виды, основные инструменты
29. Виды рынка ценных бумаг, их взаимосвязь.
30. Государственное регулирование рынка ценных бумаг в РФ
31. Основные характеристики современных мировых рынков ценных бумаг.

32. Инструменты рынка ценных бумаг.
33. Участники рынка ценных бумаг.
34. Связь рынка ценных бумаг с другими мировыми рынками
35. Схема взаимодействия предприятия с финансовым рынком.
36. Эффективность финансового рынка.
37. Деятельность предприятий на финансовых рынках
38. Основные индикаторы экономической статистики, публикуемые мировыми информационными агентствами.
39. Биржевые индексы
40. Кредитные рейтинги.
41. Понятие и необходимость использования индикаторов фондового рынка, их методы расчета.
42. Основные тенденции изменения индикаторов финансового рынка.

## 6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

**Основная:**

1. Алешина А.В. Финансовые рынки. Ч.1 : учебно-методическое пособие и практикум для изучения курса «Финансовые рынки»: базовый уровень / Алешина А.В., Булгаков А.Л., Крикунов А.С.. — Москва : Научный консультант, 2024. — 192 c. — ISBN 978-5-6040844-0-3. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/140412.html — Режим доступа: для авторизир. Пользователей
**2.** *Гусева, И. А.* Финансовые рынки и институты : учебник и практикум для вузов / И. А. Гусева. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2026. — 344 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16872-3. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/583631 (дата обращения: 20.04.2026).
**3.** Международные валютно-кредитные и финансовые отношения : учебник для вузов / Л. Н. Красавина [и др.] ; ответственный редактор Л. Н. Красавина. — 5-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 534 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-08791-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://www.urait.ru/bcode/510756

**Литература дополнительная:**

1.Гусева, И. А. Финансовые рынки и институты : учебник и практикум для вузов / И. А. Гусева. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 347 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00339-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://www.urait.ru/bcode/511698
2.Международный финансовый рынок : учебник и практикум для вузов / М. А. Эскиндаров [и др.] ; под общей редакцией М. А. Эскиндарова, Е. А. Звоновой. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 453 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-8904-5. — Текст : электронный //

Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://www.urait.ru/bcode/512093

**Интернет-ресурсы:**

7. Электронно-библиотечная система «IPRbooks» (http://www.iprbookshop.ru)
8. Образовательная платформа «ЮРАЙТ» (https://urait.ru)
9. http://www.bloomberg.com/ Глобальный вендор финансовой информации
10. http://www.world-exchanges.org/statistics/monthly-reports, Ежемесячные отчеты по финансовым рынкам [Электронный ресурс] : Всемирная федерация фондовых бирж.
11. http://www.msci.com/ Официальный сайт MorganStanleyCapitalInternational
12. https://europeanequities.nyx.com/ Официальный сайт NYSE Euronext
13. Официальный сайт компании Standard&Poor'shttp://www.standardandpoors.com/
14. http://rts.micex.ru/ Официальный сайт Московской биржи
15. http://finance.yahoo.com/ Финансовый информационный портал

## 7.Материально-техническое обеспечение дисциплины

Учебная аудитория, кабинет для самостоятельной работы студентов, видеопроекционное оборудование, компьютер, оснащенный типовым пакетом системного и офисного ПО, в соответствии с Реестром материально-технического обеспечения аудиторного фонда Университета управления "ТИСБИ".

## 8.Оценка компетенций по изучаемой дисциплине

Для оценки компетентности рекомендуется использовать рейтинговую оценку знаний, умений и навыков студента по окончанию изучения каждого Модуля в соответствии с Положением о модульно-рейтинговой системе организации образовательного процесс. Итоговая оценка (в баллах) складывается из баллов, набранных по каждому Модулю (семестровая оценка) и баллов, набранных, непосредственно на экзамене (зачете).

Расчет набранных баллов по дисциплине осуществляется в следующей последовательности:

$C = \frac{M_1 + M_2 + ..M_n}{n} \times 0{,}6$, где М – количество баллов по модулю; n – количество модулей

$З = K \times 0{,}4$, где К - количество баллов на экзамене (зачете);

$И = C + З + П$, где П – поощрительные баллы (от 1 до 5).

| Уровень освоения компетенций | Количество баллов |
|---|---|
| компетенции не сформированы | до 59 баллов |
| компетенции сформированы | от 60 до 100 баллов |

Уровень сформированности компетенций и их основные признаки оцениваются по следующим таблицам:

## Оценка уровня сформированности компетенции ПК-6

| п/п | Уровни сформированности компетенции | Основные признаки уровня | Инструменты оценки сформированности уровня |
|---|---|---|---|
| | **Пороговый уровень (как минимально допустимый)** (обязательный для всех студентов-выпускников вуза по завершении освоения ОПОП ВО) (от 60 до 70 баллов) | ПК-6.ПК-6. 1 З.3 Знает основные индикаторы финансового рынка и подходы к использованию фундаментальных данных на мировых финансовых рынках<br>ПК-6.ПК-6. 2 З.6 Знает сегменты финансовых рынков, основные типы финансово- кредитных институтов как экономических агентов<br>ПК-6.ПК-6. 3 З.9 знает организацию финансовых рынков, роль информационно-аналитических, финансово-кредитных, депозитных и недепозитных институтов | Выступление на семинаре<br>Тестовый опрос<br>Курсовая работа<br>экзамен |
| | **Базовый уровень (относительно порогового уровня)** **(**От 71 до 85 баллов**)** | *Обладает признаками порогового уровня*<br>ПК-6.ПК-6. 1 З.3 Знает основные индикаторы финансового рынка и подходы к использованию фундаментальных данных на мировых финансовых рынках<br>ПК-6.ПК-6. 2 З.6 Знает сегменты финансовых рынков, основные типы финансово- кредитных институтов как экономических агентов<br>ПК-6.ПК-6. 3 З.9 знает организацию финансовых рынков, роль информационно-аналитических, финансово-кредитных, депозитных и недепозитных институтов<br>ПК-6.ПК-6. 1 У.3 Умеет выделять основные типы финансово-кредитных институтов<br>ПК-6.ПК-6. 2 У.8 Умеет проводить анализ состояния и развития основных сегментов финансовых рынков<br>"ПК-6.ПК-6. 3 У.13 умеет проводить анализ сущности, основных задач и понятия финансовой системы и финансовых рынков<br>опыту разных стран и новым вызовам глобальной системы<br>" | Выступление на семинаре<br>Тестовый опрос<br>Реферат<br>Курсовая работа<br>экзамен |
| | **Повышенный уровень (относительно порогового уровня)** (От 86 до 100 баллов) | *Обладает признаками базового уровня*<br>ПК-6.ПК-6. 1 З.3 Знает основные индикаторы финансового рынка и подходы к использованию фундаментальных данных на мировых финансовых рынках<br>ПК-6.ПК-6. 2 З.6 Знает сегменты финансовых рынков, основные типы фи- | Выступление на семинаре<br>Тестовый опрос<br>курсовая работы<br>экзамен |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | нансово- кредитных институтов как экономических агентов<br>ПК-6.ПК-6. 3 З.9 знает организацию финансовых рынков, роль информационно-аналитических, финансово-кредитных, депозитных и недепозитных институтов<br>ПК-6.ПК-6. 1 У.3 Умеет выделять основные типы финансово-кредитных институтов<br>ПК-6.ПК-6. 2 У.8 Умеет проводить анализ состояния и развития основных сегментов финансовых рынков<br>"ПК-6.ПК-6. 3 У.13 умеет проводить анализ сущности, основных задач и понятия финансовой системы и финансовых рынков<br>опыту разных стран и новым вызовам глобальной системы<br>ПК-6.ПК-6. 1 В.3 владеет навыками обоснования стратегии поведения экономических субъектов финансового рынка<br>ПК-6.ПК-6. 2 В.8 владеет навыками обоснования стратегии поведения экономических субъектов финансового рынка<br>ПК-6.ПК-6. 3 В.13 владеет навыками экспертной оценки посткризисного состояния и тенденций развития финансово-кредитных систем стран мира | |

Приложение 1

## Методические рекомендации для обучающихся по освоению дисциплины

Студентам на первом занятии необходимо ознакомиться с Рабочей программой дисциплины, где прописаны цели, задачи и трудоемкость дисциплины. Перед началом изучения дисциплины необходимо повторить учебный материал обеспечивающих учебных дисциплин предшествующих курсов, которые дают основу для изучения дисциплины.

Затем необходимо ознакомиться с порядком изучения дисциплины, т.е. модульно-тематическим планом и пояснительной запиской с указанием этапов формирования компонентов компетенций **ПК-6.**

И, наконец, ознакомиться с порядком оценивания результатов обучения, для чего необходимо изучить следующие документы: Положение о модульно-рейтинговой системе оценивания и Принципы оценки уровня знаний, умений и навыков (характеристика ответа).

Студент должен внимательно изучить перечень основной (дополнительной) литературы и взять необходимые учебники в библиотеке.

При сдаче модулей упор делается на умение собирать исходные данные и анализировать экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов, анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д., и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений, выполнять необходимые для составления экономических разделов планов расчеты, и обосновывать их.

При подготовке к семинарскому занятию необходимо уточнить план проведения занятий, подготовить необходимую документацию. Практические занятия проводятся после лекционного изучения темы. Решение разноуровневых заданий и задач, приведенных в рабочей программе дисциплины обязательно.

При изучении данного курса преподавателем используются интерактивные методы обучения, что помогает эффективнее сформировать заявленные компетенции. При проведении занятий с помощью интерактивных технологий академическая группа разбивается на несколько малых групп (МГ). Каждая МГ обеспечивается необходимой документацией и заданиями. Занятие проводится в постоянном сравнении расчетов и выступлении участников МГ.

В результате каждая из команд выносит на всеобщее обсуждение свои результаты и может быть оценена как со стороны преподавателя, так и со стороны студентов другой команды.

Интерактивные формы обучения обеспечивают высокую мотивацию, прочность знаний, творчество, коммуникабельность, командный дух, ценность индивидуальности, свободу самовыражения, акцент на деятельность, взаимоуважение и демократичность.

Промежуточный контроль знаний и умений студентов осуществляется по основным разделам учебной программы в рамках модульно – рейтинговой системы оценки знаний студентов в форме аудиторных контрольных работ, семинаров и коллоквиумов, тестового контроля, выполнения домашних заданий.

Формы контроля самостоятельной работы студентов очного обучения: реферат, дайджест, контрольная работа, домашнее задание, коллоквиум, решение кейсов и ситуаций, работа на семинарах, выполнение индивидуального задания, учитывается также посещение занятий. Эта работа осуществляется в рамках модульно-рейтинговой оценки знаний студентов.

Приложение 2

**УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ**
**«УНИВЕРСИТЕТ УПРАВЛЕНИЯ «ТИСБИ»**

Кафедра Финансы и кредит

# Фонд оценочных средств
# для проведения текущей и промежуточной аттестации
# по дисциплине
# «Финансовые рынки и финансовые институты»

направление подготовки: 38.04.08 «Финансы и кредит»
Профиль Финансовый инжиниринг и финансовые технологии в цифровой экономике

Содержание

1. Паспорт фонда оценочных средств
2. Наполнение фонда оценочных средств по формам контроля
   2.1 Фонд оценочных средств и шкала оценивания для текущего контроля.
      2.1.1 Выступление на семинаре
      2.1.2 Тестирование
      2.1.3 реферат
   2.2Фонд оценочных средств и шкала оценивания для промежуточного контроля.
      2.2.1 Фонд оценочных средств для проверки знаний и умений (вопросы к экзамену)
      2.2.2 Фонд оценочных средств для проверки сформированности навыков (задачи к экзамену)
      2.2.3 Примерная тематика и критерии оценки курсовой работы.

# 1. ПАСПОРТ ФОНДА ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

| Формы контроля / Формируемые компетенции | ПК-6 | | |
|---|---|---|---|
| | **ПК-6.1** | **ПК-6.2** | **ПК-6.3** |
| **Формы текущего контроля** | | | |
| выступление на семинаре | З-3 | З-6 | З-9 |
| тестирование письменное | З-3 | З-6 | З-9 |
| реферат | З-3, У-3, | З-6, У-8, | З-9, У-13 |
| **Формы промежуточного контроля** | | | |
| курсовая работа | З-3, У-3, В-3, | З-6, У-8, В-8, | З-9, У-13, В-13 |
| экзамен | З-3, У-3, В-3 | З-6, У-8, В-8 | З-9, У-13, В-13 |

## 2. Наполнение фонда оценочных средств по формам контроля

### 2.1. Фонд оценочных средств и шкала оценивания для текущего контроля

2.1.1. *Выступление на семинаре* **ПК 6 (***З-3,З-6,З-9)*

Выступление на семинаре является формой контроля для оценки уровня освоения компетенций, применяемой на семинарских занятиях. Выступление на семинаре может проводиться с использованием форм устного опроса, обсуждения докладов, эссе, выполненных индивидуальных заданий и проблемных вопросов. Выступление на семинаре, таким образом, включает обязательную для всех студентов оценку текущего контроля знаний в виде устного опроса, а также выступление студентов по проблемным вопросам финансовых отношений хозяйствующих субъектов.

**Примерные вопросы к семинарским занятиям**

1) Раскройте предпосылки создания финансового рынка
2) На что направлен финансовый рынок?
3) Дайте определение финансового инжиниринга с точки зрения различных авторов.
4) Раскройте ключевые понятия финансового рынка.
5) Опишите основные сегменты финансового рынка.
6) Основные типы финансово-кредитных институтов?

7) Опишите финансовые компании, инвестиционные фонды, сберегательные кассы, пенсионные фонды, взаимные фонды, страховые компании.
8) Перечислите основные функции коммерческого банка в российских экономических условиях;
9) В чём отличие специализированных финансово-кредитных институтов в России.
10) Функции мирового финансового рынка
11) Типы мирового финансового рынка
12) Структура мирового финансового рынка
13) Классификация мирового финансового рынка
14) Субъекты и институциональная структура мирового финансового рынка
15) Экономическая сущность валютного рынка.
16) Функции валютного рынка.
17) Участники валютного рынка
18) Сущность рынка ценных бумаг и его место в финансовой системе
19) Основные участники рынка ценных бумаг
20) Основные виды рынка ценных бумаг
21) Основные области приложения финансовых рынков.
22) Схема взаимодействия предприятия с финансовым рынком.
23) Критерии эффективности работы предприятия на финансовом рынке
24) Основные типы индикаторов финансового рынка?
25) Основные тенденции изменения индикаторов фондового рынка в условиях финансового кризиса
**26)** Тенденции изменения индикаторов фондового рынка в условиях посткризисной экономики

**Критерии оценивания выступления на семинаре**

| Результат | Балл |
|---|---|
| Демонстрирует полное понимание поставленного вопроса, логично и последовательно отвечает на вопрос. Дает развернутый ответ с практическими примерами | 100-90 |
| Дает полный и логически правильный ответ на вопрос, но сформулировать примеры по рассматриваемому вопросу не может | 80-89 |
| Демонстрирует частичное понимание сути вопроса, способен охарактеризовать суть финансового явления. | 70-79 |
| Способен сформулировать определения терминов, привести классификацию, перечислить формы, методы и т.п., но не может дать их характеристику | 60-69 |
| Демонстрирует непонимание вопроса, отвечает с наличием грубых ошибок в ответе либо не отвечает на вопросы | Менее 60 |

### *2.1.2. Тестирование*

Тестирование используется для текущего контроля умений и навыков студентов. В целях освоения компетенции. Чтобы правильно ответить на тесты, студенты изучают необходимый теоретический материал по теме. Каждому студенту выдается индивидуальный вариант.

**Примерные тесты по темам лекций**

Тема 1. **Сущность финансового рынка. Анализ состояния и развития финансового рынка России**

1. К функциям финансового рынка не относится …
А) мобилизация (аккумуляция) свободных денежных средств
Б) эмиссия финансовых инструментов
В) распределение свободных финансовых ресурсов
Г) перераспределение финансовых ценностей

2. К важнейшим особенностям функционирования современного финансового рынка не относится …
А) превращение финансового рынка в главное звено рыночных отношений отдельных стран и всего мира
Б) в отличие от других рынков объектом финансового рынка становится финансовая самостоятельность территорий, регионов и государств
В) происходит сокращение валютного рынка
Г) главным смыслом финансового рынка становится перераспределение финансовых ресурсов участников экономических отношений

3. Финансовый рынок не классифицируется по …
А) объектам
Б) субъектам
В) форме функционирования
Г) размерам

4. Финансовый рынок представляет собой …
А) систему купли-продажи денежных (финансовых) инструментов
Б) механизм денежного обращения
В) систему экономических отношений
Г) механизм рыночного обращения

10. В реальной экономике финансовый рынок выступает в качестве …
А) экономического явления
Б) экономической категории
В) стоимостного инструмента
Г) институциональной игры

## Тема 2. Основные типы финансово-кредитных институтов

6.Слияния и поглощения в мировой практике являются высокоэффективными инструментами ……. рыночной стоимости бизнеса
А) повышения;
Б) понижения

7 . Инновационные финансовые продукты изначально создаются крупнейшими специализированными финансовыми институтами для удовлетворения потребностей
А) крупных эмитентов и инвесторов;
Б) мелких эмитентов и инвесторов

8. основными признаками того, что рынок встретит будущее слияние либо поглощение оптимистично, являются:
А) более существенный общий прирост стоимости;
Б) более высокая ценовая премия;
В) покупатель отличается низкой эффективностью.

11. Сумма финансовых сделок может возрастать при уменьшении объема производства материальных благ
А) может
Б)не может
В) только теоретически
Г) вопрос поставлен некорректно

12. Финансовый рынок не включает …
А) рынка кредитов

Б) рынка золота
В) рынка ценных бумаг
Г) страхового рынка

8. Коммерческий банк является:
A) Проводником денежно-кредитной политики государства.
B) Казначеем государства.
C) Кредитором юридических и физических лиц.

9. Одним из принципов деятельности коммерческого банка является:
A) Работа в пределах реально имеющихся ресурсов.
B) Стихийное регулирование деятельности.
C) Децентрализация системы расчётов.
D) Дифференцированный подход при кредитовании.

10. По характеру выполняемых операций коммерческие банки подразделяются на:
S) Бесфилиальные и многофилиальные.
J) Кооперативные и акционерные.
*C)* Малые и средние.
*D)* Универсальные и специализированные.

## Тема 3. Анализ мировых финансовых рынков

1. Какие из следующих новостей не могут существенно повлиять на мировые финансовые рынки?
А) Объем розничных продаж в Великобритании существенно упал по сравнению с предыдущим месяцем.
Б) Министр финансов Японии объявляет о намерении не допустить дальнейшего укрепления JPY.
В) Ранен президент США.
Г) Во Вьетнаме произошло извержение вулкана.

2.. Целью валютной интервенции, проводимой ЦБ Японии обычно является:
А) Удешевление JPY против CHF.
Б) Удорожание USD против JPY.
В) Удешевление USD против JPY.
Г) Удорожание JPY против EUR.

3. Выберете из ниже перечисленных государств государство с ярко выраженной экспортной экономикой.
А) США
Б) Испания
В) Великобритания
Г) Швейцария

4. Наиболее распространенные сделки на финансовом рынке
А) инвестиционные
Б) спекулятивные
В) операции по переводу денег
Г) страховые

5. Наиболее существенная сторона международного финансового взаимодействия
А) позитивное сотрудничество
Б) распределение и перераспределение денежных потоков
В) опосредование международного товарооборота
Г) содержание межгосударственных общественных организаций

6. К важнейшим особенностям современных международных финансовых систем не относится …
А) повсеместное усиление конкуренции экономического развития субъектов мирового сообщества
Б) интенсификация развития и усиление спекулятивного характера международного финансового рынка
В)развитие нанотехнологий

Г) глобализация мировой экономики и финансов
7. Что не свойственно рыночным международным финансово-кредитным отношениям?
А) финансовая помощь
Б)товарно-денежный оборот
В) перераспределение денежных потоков
Г) действие закона спроса и предложения

8. Наиболее результативной сферой международных финансовых отношений является …
А) рынок ценных бумаг
Б) кредитно-страховой рынок
В) валютный рынок
Г) международный товарооборот

9.Главная тенденция современной структуры финансовой системы общества.
А ) рост мирового ВВП
Б) повышение роли финансов граждан
В) усиление роли международных финансов
Г) интенсификация финансов организаций

10. Финансовая система общества — это …
А) совокупность сфер, выражающих взаимосвязи субъектов по поводу изменения денежного объекта
Б) совокупность денежных средств всех субъектов

В) конкретная форма реализации государственного бюджета
Г) совокупность бюджетов страны

## Тема 4. Валютный рынок

1. Специфическая черта валютного рынка
А) обусловленность международной экономической деятельностью
Б) платность валютных сделок
В) срочность сделок
Г) наличие теневой сферы рынка

2. Наиболее значительная в количественном отношении сфера финансового рынка …
А) рынок кредитов
Б) рынок ценных бумаг
В) страховой рынок
Г) валютный рынок

3. Какое из следующих утверждений является правильным?
А) Валютные сделки совершаются на биржах большинства финансовых центров мира.
Б) Валютный рынок является централизованным.
В) Валютой торгуют только в Лондоне, Нью-Йорке и Токио.
Г) Операции с иностранной валютой осуществляются на внебиржевом рынке.

4. Главный смысл современного мирового валютного рынка состоит в …
А)перераспределении стоимости между экономическими субъектами
Б) обеспечении мирового товарооборота
В) обеспечении международного туризма
Г) накоплении мирового капитала

5. Наиболее результативной сферой международных финансовых отношений является …
А) рынок ценных бумаг
Б) кредитно-страховой рынок
В) валютный рынок
Г) международный товарооборот

6. Наибольшим по объему суточных сделок является …
А) рынок акций
Б) рынок облигаций
В) валютный рынок
Г) рынок векселей и сертификатов.

7Валюты, отнесенные к свободно используемым валютам в современной мировой валютной системе

А)Фунт стерлингов
Б) Евро
В) Российский рубль
Г) Японская иена
Д) Доллар США
Е) Швейцарский франк

8. Виды предоставляемых кредитов международными финансовыми организациями по целям:
А) стабилизационные
Б) покрытие дефицита платежного баланса
В) инвестиции в акционерный капитал предприятий, банков
Г) структурные

9.Валюта платежа в международных расчетах:
А) золотые слитки
Б) национальная
В) иностранная
Г) международная валютная единица (СДР и др.)

10. Виды предоставляемых кредитов международными финансовыми организациями по срокам:
А) краткосрочные
Б) долгосрочные
В) бессрочные
Г) среднесрочные

## Тема 5. Рынок ценных бумаг

1. 1. Рынок ценных бумаг является частью рынка
А) финансового
Б) денежного
В) капиталов
Г) реальных активов

2. Фьючерсные контракты обращаются
А) только на бирже
Б) только на внебиржевом рынке
В) как на биржевом, так и на внебиржевом рынке

3.Уступка прав требования по именным депозитам осуществляется посредством
А) бланкового индоссамента
Б) простого вручения
В) цессией
Г) записью в реестре владельцев именных ценных бумаг

4. В Российской Федерации обязываться векселем могут
А) только юридические лица
Б) только физические лица
В) юридические и физические лица

5. По российскому законодательству на предъявителя могут быть выписаны
А) вексель
Б) чек
В) простое складское свидетельство
Г) двойное складское свидетельство

6. Инвестиционный пай предоставляет инвесторам право
А) получать дивиденды
Б) получать проценты
В) требовать выкупа пая у управляющей компании
Г) участвовать у управлении инвестиционным фондом

7. Главным и последним плательщиком по простому векселю является
А) векселедатель
Б) акцептант
В) авалист
4) последний индоссант

8. Конвертируемые облигации – это облигации, которые
А) могут быть обменены на акции
Б) обеспечивают получение дохода в свободно конвертируемой валюте
В) обеспечивают индексацию номинала в соответствии с изменениями курса национальной валюты к свободно конвертируемой валюте

9. На российских фондовых биржах сделки заключать могут
А) любые продавцы и покупатели ценных бумаг, включенных в число обращающихся на данной бирже
Б) любые профессиональные участники рынка ценных бумаг
В) только банки – профессиональные участники рынка ценных бумаг
Г) только брокеры, дилеры и управляющие

10. Отдельные выпуски эмиссионных ценных бумаг от процедуры государственной регистрации освобождаться
А) могут
Б) не могут
В) могут, если они размещаются по закрытой подписки
Г) могут, если не требуется регистрация проспекта эмиссии

## Тема 6 Значение финансовых рынков для предприятия

2. 1 Невозможность предприятия вызвать коммерческий или иной интерес у реального инвестора, включая неспособность самого субъекта «принять инвестиции» и умело ими распорядиться – это:
А) неграмотность менеджмента;
Б) низкая инвестиционная привлекательность;
В) отсутствие необходимости у предприятия.

2. Укажите основную цель функционирования предприятия в рыночных условиях:
А) получение прибыли и ее максимизация
Б) повышение заработной платы работников
В) выход на мировой рынок
Г) максимальное удовлетворение общественных потребностей
Д) совершенствование производственной структуры предприятия
Е) внедрение новой техники и технологии

3. Предприятия по формам собственности классифицируются на:
А) индивидуальные
Б) частные
В) малые
Г) государственные
Д) коллективные
Е) муниципальные

4. Задачи предприятия определяются:
А) интересами владельца
Б) размером капитала
В) ситуацией внутри предприятия
Г) высшим руководством
Д) коллективом предприятия
Е) внешней средой

5.Выделите четыре признака классификации рынков по характеру товарообмена:
А) рынок товаров и услуг, рынок денег (капитала), рынок технологий, рынок информации
Б) рынок товаров и услуг, рынок средств производства, рынок интеллектуальной продукции, рынок труда
В) рынок труда, рынок ценных бумаг, финансовый рынок и рынок интеллектуальной собственности
Г) рынок труда, рынок интеллектуальной продукции, финансовый рынок, рынок товаров и услуг

6. В дочерней компании материнская компания имеет долю в уставном капитале более:
А). 15%
Б). 20%
В). 35%
Г). 45%
Д). 50%

7.Собственными финансовыми ресурсами предприятия являются:
А) целевое финансирование, средства, привлеченные путем размещения акций на бирже, добавочный капитал
Б)уставный капитал, страховое возмещение по наступившим рискам, средства, полученные от партнера для осуществления совместной деятельности (по договору простого товарищества)
В)прибыль от реализации основных средств и других активов, амортизационные отчисления, нераспределенная прибыль прошлых лет
Г)все перечисленное

13. Основополагающее звено финансовой системы — это:
А) мировые финансы
Б) государственный бюджет
В) финансы предприятий

14. Под финансами следует понимать:
А) денежные средства, находящиеся в распоряжении государства, компаний, учреждений, организаций и населения
Б) денежные отношения, связанные с формированием, распределением и использованием денежных фондов
В) фонды денежных средств

10.Финансовое состояние предприятия характеризуется:
А)совокупностью показателей, отражающих процесс форми¬рования и использования его финансовых средств
Б) потребностью в кредите в случаях несоответствия денежных поступлений и обязательств по размерам и срокам
В) совокупностью показателей, отражающих объем продаж, долю рынка и другие показатели, отражающие конкурентоспособность предприятия

## Тема 7. Доходы организаций (предприятий)

1. Раздел общего анализа, посвященный изучению внутренних и внешних факторов экономического состояния эмитента с целью получения прогноза изменения стоимости его ценных бумаг:
А) статистический анализ;
Б) финансовый анализ;
В) фундаментальный анализ;

Г) технический анализ.

2. Какой вид анализа эффективно работает на долгосрочную перспективу?
А) фундаментальный анализ;
Б) технический анализ.

3. Самым старым и распространенным фондовым индексом является:
А) S&P 100;
Б) Nikkey-225;
В) Dow Jones;
Г) CAC-40.

4. Соотношение, показывающее какую цену должен заплатить инвестор за единицу прибыли:
А) Дивиденд на одну акцию / Рыночная цена акции;
Б) EPS;
В) P/E;
Г) D/E.

5. Первый биржевой индекс предложил:
А) Уильям Шарп;
Б) Чарльз Доу;
В) Гарри Марковиц;
Г) Уоррен Баффит.

6. Выберите не существующую календарную аномалию:
А) эффект января;
Б) эффект понедельника;
В) эффект четверга;
Г) эффект праздничного дня.

7. Анализ, исследующий динамику рынка посредством графиков, с целью прогнозирования будущего направления движения цен:
А) статистический анализ;
Б) финансовый анализ;
В) фундаментальный анализ;
Г) технический анализ.

8. Тренд (тенденция) называется бычьей при:
А) движении цены вверх;
Б) движении цены вниз;
В) отсутствии определенности.

9. Линии, соединяющие важные максимумы (вершины) рынка, возникающие, когда покупатели больше либо не могут, либо не хотят покупать данный товар по более высоким ценам, называются:

мощнейших кризисов. Из них два российских, три глобальных, на них повлиять не
— Насколько ваш экономический прогноз отличается от прогноза главы Минэкономразвития Алексея Улюкаева?
А)
Б)
— Прогноз Улюкаева — это не прогноз, а лжемакроэкономическая «дурилка». Он
пытаются людям вложить в голову определенную кассету — якобы в мире все буд
старому.
10
гд
пс
Улюкаев не приводит ни одного макроэкономического, макрофинансового, геополитического обоснования. Найдите хотя бы одно его заявление, которое бы с
горизонте в течение полгода. Ни одного — я лично смотрел. Ни в 92-м, ни в 98-м,
м, ни в 2014—2015 годах ни одно заявление по курсу рубля, темпу экономики, цен
нефть и инфляции не подтвердилось.
А)
Б)




Владислав Жуковский — экономист, инвестиционный консультант, управляющий финансовой группы «Риком»
Фото: Антон Белицкий

### *2.1.3. Реферат* ПК 6 (*З-3,З-6,З-9,У-3,У-8,У-13)*

Реферат используются для текущего контроля знаний студентов. В целях освоения компетенции для подготовки реферата и эссе студенты изучают необходимый теоретический материал по теме. Студент может выбрать самостоятельно тему эссе или реферата.

**Примерная тематика рефератов**

1. Экономическое содержание финансов предприятия.
2. Организационно-правовые формы предприятий
3. Корпоративное предпринимательство: российская и зарубежная практика
4. Исторический аспект связи риска и предпринимательства
5. Связь риска, предпринимательства и доходности
6. Инвестиционно-кредитные отношения предпринимательской деятельности
7. Заемный капитал: арендные отношения в системе «арендодатель – арендатор»
8. Прогнозирование рисковой ситуации
9. Предпринимательский риск и стратегии предпринимателя
10. Особенности поддержки малого предпринимательства в России
11. Государственное регулирование инвестиционно-заемной системы предпринимательства

12. Формы государственной финансово-кредитной поддержки малого предпринимательства.

**Критерии оценивания рефератов**

| Результат | Балл |
|---|---|
| Содержание реферата или эссе показывают полное понимание избранной темы. В работе логично и последовательно раскрывается тема. Студент достаточно полно освещает тему и приводит практические примеры | 100-90 |
| Содержание реферата или эссе показывают достаточное понимание избранной темы. В работе последовательно раскрывается тема. Студент достаточно полно освещает тему. | 80-89 |
| Содержание реферата или эссе показывают достаточное понимание избранной темы. В работе не вполне последовательно раскрывается тема. | 70-79 |
| Содержание реферата или эссе показывают недостаточное понимание избранной темы. В работе не вполне последовательно раскрывается тема. | 60-69 |
| Содержание реферата или эссе недостаточно раскрывают тему. | Менее 60 |

## 2.2. Фонд оценочных средств и шкала оценивания для промежуточного контроля

### 2.2.1. Фонд оценочных средств для проверки знаний/умений

**Вопросы к экзамену ПК-6 (З-3,З-6,З-9,У-3,У-8,У-13,В-3,В-8,В-13)**

1. Понятие мировой финансовой системы
2. Международные финансовые центры
3. История возникновения финансового рынка.
4. Предпосылки возникновения финансового рынка.
5. Понятие финансового рынка, его основные цели, структура.
6. Основные участники финансового рынка.
7. Основные факторы развития финансового инжиниринга.
8. Основные направления развития финансового рынка России
9. Государственные и частные, коммерческие организации, уполномоченные осуществлять финансовые операций по кредитованию, депонированию вкладов, ведению расчетных счетов, купле и продаже валюты и ценных бумаг, оказанию финансовых услуг и др.
10. Банки и банковская система
11. Финансовые компании
12. Фонды коллективного инвестирования

13. Инвестиционный потенциал государственных и негосударственных пенсионных фондов
14. Взаимные фонды: сущность, понятие, тенденции развития
15. Страховые компании.
16. Специализированные финансово-кредитные институты: российская практика
17. Специализированные финансово-кредитные институты: зарубежный опыт.
18. Регуляторы мировых финансовых рынков
19. Инструменты валютной политики центральных банков
20. Характер влияния инструментов валютной политики на валютные курсы.
21. Подходы к использованию фундаментальных данных на мировых финансовых рынках.
22. Предпосылки для развития и становления современного валютного рынка.
23. Виды валютных операций, их эволюция.
24. Основные характеристики современных мировых валютных рынков.
25. Инструменты валютного рынка.
26. Участники валютного рынка
27. Связь валютного рынка с другими мировыми рынками
28. Финансовый инжиниринг: сущность, понятие, виды, основные инструменты
29. Виды рынка ценных бумаг, их взаимосвязь.
30. Государственное регулирование рынка ценных бумаг в РФ
31. Основные характеристики современных мировых рынков ценных бумаг.
32. Инструменты рынка ценных бумаг.
33. Участники рынка ценных бумаг.
34. Связь рынка ценных бумаг с другими мировыми рынками
35. Схема взаимодействия предприятия с финансовым рынком.
36. Эффективность финансового рынка.
37. Деятельность предприятий на финансовых рынках
38. Основные индикаторы экономической статистики, публикуемые мировыми информационными агентствами.
39. Биржевые индексы
40. Кредитные рейтинги.
41. Понятие и необходимость использования индикаторов фондового рынка, их методы расчета.
42. Основные тенденции изменения индикаторов финансового рынка.

### 3.2.2 Фонд оценочных средств для проверки сформированности навыков (задачи к экзамену) ПК-6 (З-3,З-6,З-9,У-3,У-8,У-13,В-3,В-8,В-13)

Задача 1.

Торговец А купил у торговца Б на бирже 3 опциона-колл на газойль со страйком 165$/т по 0,5$/т и 2 опциона-пут на нефть со страйком 85$/баррель по 1,3$/баррель. А у торговца С – 10 опционов-пут на нефть со страйком 87$/баррель по 1,5$/баррель. В одном опционном контракте на нефть 1000 баррелей, на газойль – 100 т.

У торговца А перед началом операции на счете в биржевом банке было 200000$, у торговца Б – 400000$ и у торговца С – 350000$.

Все опционы были исполнены.

Определите:

1. сколько тонн газойля купит торговец А при поставке?

2. сколько денег будет на счете в биржевом банке у торговцев А, Б и С?

3. Предположим, что временная зависимость форвардных ставок в текущий момент будет возрастающей. Какая из облигаций будет иметь меньшую доходность к погашению(номиналы одинаковы)? Выберите в каждом из предложенных вариантов:

1 вариант

А) 15-летняя бескупонная облигация

Б) 10-летняя бескупонная облигация?

2 вариант

для 12-летней облигации:

А) с 5% купоном

Б) с 6%

купоном

4. Активы инвестиционного фонда «Рекса-Люкс» оценены в 8 млрд.долларов. Ожидаемая (планируемая) доходность портфеля активов фонда составляет 10%, волатильность доходности оценена в 20% (предполагается нормальное распределение доходности).

Укажите при заданной вероятности (5%) величину потерь фонда в млн. долларов, считая, что вероятности 95% соответствует 1,65 стандартных отклонений.

А) 0,33 млрд. дол.

Б) 0,8 млрд. долл

В) 1,84 млрд. долл

Г) 3,44 млрд. долл

## Критерии оценки уровня усвоения знаний, умений и навыков по результатам экзамена

| Характеристика ответа | Европейская оценка | Рубежные баллы | Оценка | Уровень сформированности компетенций |
|---|---|---|---|---|
| Дан полный, развернутый ответ на поставленный теоретический вопрос экзаменационного билета, показана совокупность осознанных знаний об объекте, проявляющаяся в свободном ориентировании понятиями, умении выделить существенные и несущественные его признаки, причинно-следственные связи. Знание об объекте демонстрируется на фоне понимания его в системе данной науки и междисциплинарных связей. Ответ формулируется в терминах науки, изложен литературным языком, логичен, доказателен, демонстрирует авторскую позицию студента. При ответе на экзаменационный билет студент демонстрирует применение знаний к реальным профессиональным ситуациям, объясняет решение задачи на уровне анализа, синтеза и дает свою оценку решения проблемы. Причем студент не затрудняется с ответом при видоизменении задания и правильно обосновывает принятое решение, владеет разносторонними навыками и приемами выполнения практических задач. | **A** | **100-96** | **5+** | **Повышенный уровень сформированности компетенций** |
| Дан полный, развернутый ответ на поставленный теоретический вопрос, показана совокупность осознанных знаний об объекте, доказательно раскрыты основные положения темы; в ответе прослеживается четкая структура, логическая последовательность, отражающая сущность раскрываемых понятий, теорий, явлений. Знание об объекте демонстрируется на фоне понимания его в системе данной науки и междисциплинарных связей. Умеет тесно увязывать теорию с практикой. Задача решена правильно и с обоснованием принятого решения. Ответ изложен литературным языком в терминах науки. Могут быть допущены недочеты в определении понятий, исправленные студентом самостоятельно в процессе ответа. | **A** | **95-91** | **5** | |
| Дан полный, развернутый ответ на поставленный вопрос, доказательно раскрыты основные положения темы; в ответе прослеживается четкая структура, логическая последовательность, отражающая сущность раскрываемых понятий и явлений. Задача решена верно, правильно обосновывает принятую методику решения задачи. Ответ изложен литературным языком в терминах науки. В ответе допущены недочеты, исправленные студентом с помощью преподавателя. | **A** | **90-86** | **5-** | |
| Дан полный, развернутый ответ на поставленный вопрос, показано умение выделить существенные и несущественные признаки, причинно-следственные связи. Ответ четко структурирован, логичен, изложен литературным языком в терминах науки. Студент владеет разносторонними навыками и приемами выполнения практических задач. Могут быть допущены недочеты или незначительные ошибки, ис- | **B** | **85-81** | **4+** | **Базовый уровень сформированности компетенций** |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| правленные студентом с помощью преподавателя. | | | | |
| Дан полный, развернутый ответ на поставленный вопрос, показано умение выделить существенные и несущественные признаки, причинно-следственные связи. Ответ четко структурирован, логичен, изложен в терминах науки. Студент владеет разносторонними навыками и приемами выполнения практических задач. Ответы на дополнительные вопросы логичны, изложены в терминах науки, однако допущены незначительные ошибки или недочеты, исправленные студентом с помощью "наводящих" вопросов преподавателя. | **C** | **80-76** | **4** | |
| Студент демонстрирует достаточные теоретические и практические знания. Дан полный, но недостаточно последовательный ответ на поставленный вопрос, но при этом показано умение выделить существенные и несущественные признаки и причинно-следственные связи. Ответ логичен и изложен в терминах науки. Могут быть допущены 1-2 ошибки в определении основных понятий или решении практической задачи, которые студент затрудняется исправить самостоятельно. | **C** | **75-71** | **4-** | |
| Дан недостаточно полный и развернутый ответ. Логика и последовательность изложения имеют нарушения. Допущены ошибки в раскрытии понятий, употреблении терминов. Студент не способен самостоятельно выделить существенные и несущественные признаки и причинно-следственные связи. Студент может конкретизировать обобщенные знания, доказав на примерах их основные положения только с помощью преподавателя. Речевое оформление требует поправок, коррекции. Студент испытывает затруднения при выполнении практической задачи и не может связать теорию с практикой. | **D** | **70-66** | **3+** | **Пороговый уровень сформированности компетенций** |
| Дан неполный ответ, логика и последовательность изложения имеют существенные нарушения. Допущены грубые ошибки при определении сущности раскрываемых понятий, теорий, явлений, вследствие непонимания студентом их существенных и несущественных признаков и связей. В ответе отсутствуют выводы. Умение раскрыть конкретные проявления обобщенных знаний не показано. Испытывает затруднения при выполнении практических задач. Речевое оформление требует поправок, коррекции. | **E** | **65-61** | **3** | |
| Дан неполный ответ. Присутствует нелогичность изложения. Студент затрудняется с доказательностью. Масса существенных ошибок в определениях терминов, понятий, характеристике фактов, явлений. В ответе отсутствуют выводы. Речь неграмотна. При ответе на дополнительные вопросы студент начинает понимать связь между знаниями только после подсказки преподавателя | **E** | **60** | **3-** | |
| Студент испытывает значительные трудности в ответе на экзаменационные вопросы. Присутствует масса существенных ошибок в определениях терминов, понятий, характеристике фактов, явлений экономической теории. Речь неграмотна. На дополнительные вопросы студент не отвечает. Задача не решена | **F** | **Менее 60** | **2** | **Компетенция не сформирована** |

**2.2.3 Примерная тематика и критерии оценивания курсовой работы**.

**Примерная тематика курсовых работ ПК-6 (З-3,З-6,З-9,У-3,У-8,У-13,В-3,В-8,В-13)**

25.Роль финансового рынка в мобилизации и распределении финансовых ресурсов

26. Инвестиционная политика банков на рынке ценных бумаг России

27. Определение ценных бумаг в законодательстве и экономических теориях разных стран

28. Эмиссия акций как средство финансирования фирмы

29. Развитие кредитной системы в условиях современного рынка ценных бумаг

30. Факторы конкурентной способности инвестиционных компаний на финансовом рынке

31. Государственное регулирование финансового рынка в РФ.

32. Реструктуризация акционерного общества

33. Лицензирование профессиональных участников рынка ценных бумаг.

34. Мировой валютный рынок: история развития

35. Мировой валютный рынок: тенденции развития

36. Международные финансово-кредитные институты

37. Специализированные финансово-кредитные институты: российская практика

38. Специализированные финансово-кредитные институты: зарубежный опыт.

39.Структурированные акции в российской практике: анализ развития рынка и оценка перспектив

40. Экономическая природа рынка ценных бумаг и проблемы его формирования в российской экономике.

41. Развитие рынка ценных бумаг в условиях глобализации

42. Индикаторы финансового рынка

43. Субъекты и институциональная структура мирового финансового рынка

44. Финансовые риски на фондовом рынке

45. Рынок ценных бумаг и защита рядовых инвесторов

46. Финансовые технологии павеых инвестиционных фондов

47. Валютный рынок и валютные операции в России

48. Мировой валютный рынок Forex

## Критерии оценки уровня усвоения знаний, умений и навыков по результатам написания курсовой работы

| Характеристика ответа | Европейская оценка | Рубежные баллы | Оценка | Уровень сформированности компетенций |
|---|---|---|---|---|
| Демонстрирует глубокие знания теоретической части. Умеет применять полученные знания при практическом анализе конкретного предприятия. Умеет выявлять, в результате проведенного анализа, резервы повышения экономической эффективной работы предприятия и рассчитать экономической эффект от предложенных мероприятий. Студент творчески подошел к написанию курсовой работы и представил свои предложения по улучшению работы предприятия. Курсовая работа оформлена в соответствии с методическими указаниями по курсовой работе. | **A** | **100-96** | **5+** | **Повышенный уровень сформированности компетенций** |
| Демонстрирует глубокие знания теоретической и практической частей курсовой работы. Умеет тесно увязывать теорию с практикой. Свободно владеет необходимыми навыками и приемами экономического анализа при объяснении практической части курсовой работы и расчетах экономического эффекта. Курсовая работа оформлена в соответствии с требованиям. | **A** | **95-91** | **5** | |
| Демонстрирует глубокие знания теоретической и практической частей курсовой работы. Умеет тесно увязывать теорию с практикой. Свободно владеет необходимыми навыками и приемами экономического анализа при объяснении практической части курсовой работы и расчетах экономического эффекта. В ответах на дополнительные вопросы допущены недочеты, исправленные студентом с помощью наводящих вопросов преподавателя. Курсовая работа оформлена в соответствии с требованиям. | **A** | **90-86** | **5-** | |
| Демонстрирует знания теоретической и практической частей курсовой работы. Правильно применяет и использует приемы и методы экономического анализа, могут быть допущены отдельные неточности или незначительные ошибки | **B** | **85-81** | **4+** | **Базовый уровень сформированности** |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| в анализе и при расчетах экономического эффекта. Курсовая работа оформлена в соответствии с требованиям. | | | | |
| Демонстрирует достаточные теоретические и практические знания. Работа выполнена без существенных ошибок в расчетах. Ответы на дополнительные вопросы логичны, изложены в терминах науки, однако в них допущены неточности. Курсовая работа оформлена в соответствии с требованиям. | **C** | **80-76** | **4** | |
| Демонстрирует достаточные теоретические и практические знания. Работа выполнена без существенных ошибок. Ответы на дополнительные вопросы логичны, изложены в терминах науки. Однако в них допущены незначительные ошибки. В работе встречаются отдельные незначительные ошибки. | **C** | **75-71** | **4-** | |
| Демонстрирует определенные знания, но не усвоил детали, допускает неточности, логическую последовательность, ошибки в курсовой работе. Допущены неточности в оформлении курсовой работы | **D** | **70-66** | **3+** | **Пороговый уровень сформированности компетенций** |
| Даны неполные ответы на вопросы по курсовой работе. Встречаются незначительные ошибки по тексту, в расчетах. Допущены неточности в оформлении курсовой работы Допущены неточности в оформлении курсовой работы | **E** | **65-61** | **3** | |
| Даны неполные ответы на вопросы по курсовой работе. Присутствует нелогичность изложения. Речь неграмотна. При ответе на дополнительные вопросы студент начинает понимать связь между знаниями только после подсказки преподавателя. | **E** | **60** | **3-** | |
| Не знает значительную часть теоретического и практического материала, допускает существенные ошибки в расчетах или ответах на вопросы. Дополнительные и уточняющие вопросы преподавателя не приводят к коррекции ответа студента. Курсовая работа оформлена не в соответствии с требованиями локальных документов | **F** | **Менее 60** | **2** | **Компетенция не сформирована** |