

Документ подписан лицом, имеющим право подписи  
Информация о владельце:  
ФИО: Вишневский Дмитрий Александрович  
Должность: Ректор  
Дата подписания: 30.04.2025  
Уникальный программный код:  
03474917c4d012283e5ad996a48a5e70bf8da057

И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ  
(МИНОБРНАУКИ РОССИИ)  
НОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ  
НОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
УДАРСТВЕННЫЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ»  
(ФГБОУ ВО «ДонГТУ»)

**Факультет экономики, управления и лингвистического сопровождения**  
**Кафедра финансов и бухгалтерского учета**



## **РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

## Финансовые рынки (наименование дисциплины)

## **38.03.01 Экономика**

## Финансы и кредит (профиль подготовки)

Квалификация	бакалавр (бакалавр/специалист/магистр)
Форма обучения	очная, очно-заочная (очная, очно-заочная, заочная)

## **1 Цели и задачи изучения дисциплины**

*Цели дисциплины:* формирование у студентов целостного представления о финансовом рынке и его сегментах, о финансовых инструментах (ценных бумагах и производных финансовых инструментах) и их практическом применении, о видах финансовых институтов и их роли, и функциях на финансовых рынках.

*Задачи изучения дисциплины:*

- освоение теории финансовых рынков;
- рассмотрение места финансовых рынков в финансовой системе и их влияния на ход экономических процессов;
- изучение структуры участников финансовых рынков (финансовые посредники, эмитенты, инвесторы), их взаимодействия;
- получение знаний об экономической сущности ценных бумаг и производных финансовых инструментов;
- ознакомление с основными положениями законодательства в области функционирования финансовых рынков;
- формирование системы знаний об особенностях конкретных видов финансовых инструментов, возможностях их использования в хозяйственной практике экономических субъектов;
- приобретение навыков использования ценных бумаг и производных финансовых инструментов;
- овладение основами операций с финансовыми инструментами.

*Дисциплина направлена на формирование профессиональных (ПК-1) компетенций выпускника.*

## **2 Место дисциплины в структуре ОПОП ВО**

Логико-структурный анализ дисциплины – курс входит в обязательную часть Блока 1, по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика», профиль «Финансы и кредит».

Дисциплина реализуется кафедрой финансов и бухгалтерского учета.

Основывается на базе дисциплин: «Введение в теорию финансов», «Финансы», «Валютно-кредитные и финансовые отношения», «Деньги, кредит, банки», «Статистика», «Финансовые расчеты».

Является основой для изучения следующих дисциплин: «Банковское дело», «Управление финансами», «Финансовая диагностика».

Общая трудоемкость освоения дисциплины составляет 4 з. ед., 144 ак. ч. Программой дисциплины предусмотрены: лекционные занятия (36 ак. ч.); практические занятия (54 ак. ч.), курсовая работа и самостоятельная работа студента (54 ак. ч.).

Для студентов очно-заочной формы обучения общая трудоемкость освоения дисциплины составляет 4 з. ед., 144 ак. ч. Программой дисциплины предусмотрены: лекционные занятия (12 ак. ч.); практические занятия (12 ак. ч.), самостоятельная работа студента (120 ак. ч.).

Для очной формы обучения дисциплина изучается на 3 курсе в 6 семестре. Студентами очно-заочной формы обучения дисциплина изучается на 4 курсе в 7 семестре. Форма промежуточной аттестации – экзамен.

### **3 Перечень результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения ОПОП ВО**

Процесс изучения дисциплины «Финансовые рынки» направлен на формирование компетенций, представленных в таблице 1.

*Таблица 1 – Компетенции, обязательные к освоению*

Содержание компетенции	Код компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции
Способен осуществлять мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков с помощью современных информационных технологий и программных средств	ПК-1	ПК-1.1. Проводит исследования финансового рынка и изучает предложения финансовых услуг ПК-1.2. Формирует данные и осуществляет ведение базы по клиентам с помощью современных информационных технологий и программных средств

#### **4 Объём и виды занятий по дисциплине**

Общая трудоёмкость учебной дисциплины составляет 4 з. ед., 144 ак. ч.

Самостоятельная работа студента (СРС) включает проработку материалов лекций, подготовку к практическим занятиям, текущему контролю, выполнение курсовой работы, выполнение индивидуального задания, самостоятельное изучение материала и подготовку к экзамену.

При организации внеаудиторной самостоятельной работы по данной дисциплине используются формы и распределение бюджета времени на СРС для очной формы обучения в соответствии с таблицей 2.

Таблица 2 – Распределение бюджета времени на СРС

Вид учебной работы	Всего ак.ч.	Ак.ч. по семестрам	
		6	
Аудиторная работа, в том числе:			
Лекции (Л)	90	90	
Практические занятия (ПЗ)	36	36	
Лабораторные работы (ЛР)	54	54	
Курсовая работа/курсовый проект	-	-	-
Самостоятельная работа студентов (СРС), в том числе:	54	54	
Подготовка к лекциям	4	4	-
Подготовка к лабораторным работам	-	-	-
Подготовка к практическим занятиям / семинарам	8	8	-
Выполнение курсовой работы / проекта	20	20	-
Расчетно-графическая работа (РГР)	-	-	-
Реферат (индивидуальное задание)	5	5	-
Домашнее задание	6	6	-
Подготовка к контрольной работе	-	-	-
Подготовка к коллоквиуму	-	-	-
Аналитический информационный поиск	-	-	-
Работа в библиотеке	6	6	-
Подготовка к экзамену	5	5	-
Промежуточная аттестация	Э, Д/З	Э, Д/З	-
Общая трудоемкость дисциплины			
ак.ч.	144	144	-
з.е.	4	4	-

## **5 Содержание дисциплины**

С целью освоения компетенций, приведенных в п.3 дисциплина разбита на 11 тем:

семестр 6

- тема 1 Сущность финансового рынка;
- тема 2 Понятие и классификация финансового посредничества;
- тема 3 Роль финансового рынка в экономике;
- тема 4 Денежный рынок;
- тема 5 Валютный рынок;
- тема 6 Рынок капиталов;
- тема 7 Фондовый рынок;

семестр 7

- тема 8 Рынок золота;
- тема 9 Рынок производных финансовых инструментов (деривативов);
- тема 10 Мировой финансовый рынок;
- тема 11 Фондовые индексы и их роль в экономике;

Виды занятий по дисциплине и распределение аудиторных часов для очной и очно-заочной формы приведены в таблицах 3 и 4.

Таблица 3 – Виды занятий по дисциплине и распределение аудиторных часов (очная форма обучения)

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Содержание лекционных занятий	Трудоемкость в ак.ч.	Темы практических занятий	Трудоемкость в ак.ч.	Тема лабораторных занятий	Трудоемкость в ак.ч.
1	Сущность финансового рынка	Место финансового рынка в финансовой системе. Структура финансового рынка. Субъекты отношений – участники финансового рынка.	2	Функции финансового рынка.	4	–	–
2	Понятие и классификация финансового посредничества	Понятие финансовых посредников. Роль коммерческих банков как посредников. Депозитные небанковские институты. Страховые компании. Инвестиционные компании и фонды.	2	Пенсионные фонды и перспективы их развития в стране.	4	–	–
3	Роль финансового рынка в экономике	Роль денег в развитии производства и повышения его эффективности. Особенности проявления роли денег при разных моделях экономики. Роль денег в рыночной экономике. Роль денег в процессах формирования, распределения и перераспределения национального дохода. Роль денег во внешнеэкономических отношениях.	4	Основные тенденции и особенности развития финансовых рынков на современном этапе. Современные тенденции развития мирового финансового рынка. Финансовые инновации. Роль финансовых инноваций в изменении функций рынка ценных бумаг. Финансовый инжиниринг. Факторы развития финансового инжиниринга.	4	–	–

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Содержание лекционных занятий	Трудоемкость в ак.ч.	Темы практических занятий	Трудоемкость в ак.ч.	Тема лабораторных занятий	Трудоемкость в ак.ч.
4	Денежный рынок	Структура и сущность денежного рынка. Объекты и субъекты рынка. Особенность денежного рынка как рынка высоколиквидных финансовых активов, краткосрочных ценных бумаг. Инструменты денежного рынка. Характеристика учетного рынка и его особенности.	4	Характеристика межбанковского рынка. Операции на межбанковском рынке.	6	—	—
5	Валютный рынок	Понятие и структура валютного рынка. Валютный рынок страны. Виды операций с валютой.	4	Осуществление операций на межбанковском валютном рынке. Валютное регулирование и курсовая политика Центрального банка страны.	6	—	—
6	Рынок капиталов	Понятие кредитного рынка и его структура. Функции кредитного рынка. Кредит как финансовый инструмент рынка. Банки – основные участники рынка капиталов. Понятие финансового риска. Классификация рисков.	4	Методы оценки и управления финансовыми рисками, их классификация. Развитие теории риска. Причины появления и развития теорий риска. Теории эффективности рынка Ю. Фамы, Г. Марковица и В. Шарпа.	6	—	—
7	Фондовый рынок	Фондовый рынок как часть финансового рынка. Значение развития фондового рынка для процесса накопления капитала. Особенность фондового рынка, его субъекты. Функции фондового рынка. Рынок облигаций как составляющая рынка капиталов.	6	Облигация - долговая ценная бумага. Классификация облигаций. Рынок акций. Классификация акций. Способы размещения. Выплата дивидендов.	6	—	—

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Содержание лекционных занятий	Трудоемкость в ак.ч.	Темы практических занятий	Трудоемкость в ак.ч.	Тема лабораторных занятий	Трудоемкость в ак.ч.
8	Рынок золота	Золото как объект купли-продажи. Сущность, структура и функции современного рынка золота. Классификация факторов, влияющих на развитие рынка золота.	2	Операции с золотом (биржевые и банковские). Методы регулирования рынка золота.	4	–	–
9	Рынок производственных финансовых инструментов (деривативов)	Причины появления и развития рынка производных финансовых инструментов. Хеджирование. Виды производных финансовых инструментов, их особенности. Определение и виды форвардных контрактов и их отличие от фьючерсных контрактов. Определение и виды фьючерсных контрактов и их отличие от форвардных контрактов.	4	Определение и виды опционов. Соглашения «кэп», «флор», «колар» и «варранты». Сущность и виды свопов – процентный и валютный свопы, своп активов.	6	–	–
10	Мировой финансовый рынок	Общая характеристика и сущность мирового финансового рынка. Субъекты мирового рынка. Общая структура мирового финансового рынка. Географическая структура мирового финансового рынка: международные финансовые потоки и мировые финансовые центры.	2	Современные тенденции развития мирового финансового рынка.	6	–	–
11	Фондовые индексы и их роль в экономике	Понятие фондовых индексов и методы их определения. Виды фондовых индексов и их место на финансовом рынке.	2	Характеристика основных мировых фондовых индексов.	2	–	–
Всего аудиторных часов			36		54	–	

Таблицы 4 – Виды занятий по дисциплине и распределение аудиторных часов (очно-заочная форма обучения)

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание лекционных занятий	Трудоемкость в ак.ч.	Темы практических занятий	Трудоемкость в ак.ч.	Тема лабораторных занятий	Трудоемкость в ак.ч.
1	Денежный рынок	Структура и сущность денежного рынка. Объекты и субъекты рынка. Особенность денежного рынка как рынка высоколиквидных финансовых активов, краткосрочных ценных бумаг. Инструменты денежного рынка. Характеристика учетного рынка и его особенности.	2	Характеристика межбанковского рынка. Операции на межбанковском рынке.	2	–	–
2	Валютный рынок	Понятие и структура валютного рынка. Валютный рынок страны. Виды операций с валютой.	2	Осуществление операций на межбанковском валютном рынке. Валютное регулирование и курсовая политика Центрального банка страны.	2	–	–
3	Фондовый рынок	Фондовый рынок как часть финансового рынка. Значение развития фондового рынка для процесса накопления капитала. Особенность фондового рынка, его субъекты. Функции фондового рынка. Рынок облигаций как составляющая рынка капиталов.	2	Облигация - долговая ценная бумага. Классификация облигаций. Рынок акций. Классификация акций. Способы размещения. Выплата дивидендов.	2	–	–

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание лекционных занятий	Трудоемкость в ак.ч.	Темы практических занятий	Трудоемкость в ак.ч.	Тема лабораторных занятий	Трудоемкость в ак.ч.
4	Рынок золота	Золото как объект купли-продажи. Сущность, структура и функции современного рынка золота. Классификация факторов, влияющих на развитие рынка золота.	2	Операции с золотом (биржевые и банковские). Методы регулирования рынка золота.	2	—	—
5	Рынок производственных финансовых инструментов (деривативов)	Причины появления и развития рынка производных финансовых инструментов. Хеджирование. Виды производных финансовых инструментов, их особенности. Определение и виды форвардных контрактов и их отличие от фьючерсных контрактов. Определение и виды фьючерсных контрактов и их отличие от форвардных контрактов.	4	Определение и виды опционов. Соглашения «кэп», «флор», «колар» и «варранты». Сущность и виды свопов — процентный и валютный свопы, своп активов.	4	—	—
Всего аудиторных часов			12		12	—	

## **6 Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины**

### **6.1 Критерии оценивания**

В соответствии с Положением о кредитно-модульной системе организации образовательного процесса ФГБОУ ВО «ДонГТУ» ([https://www.dstu.education/images/structure/license\\_certificate/polog\\_kred\\_modul.pdf](https://www.dstu.education/images/structure/license_certificate/polog_kred_modul.pdf)) при оценивании сформированности компетенций по дисциплине используется 100-балльная шкала.

Перечень компетенций по дисциплине и способы оценивания знаний приведены в таблице 5.

**Таблица 5 – Перечень компетенций по дисциплине и способы оценивания знаний**

Код и наименование компетенции	Способ оценивания	Оценочное средство
ПК-1	Экзамен, дифференцированный зачет	Комплект контролирующих материалов для экзамена

Всего по текущей работе в семестре студент может набрать 100 баллов, в том числе:

- тестовый контроль или устный опрос на практических занятиях или лекциях (2 работы) – всего 40 баллов;
- практические работы – всего 40 баллов;
- за выполнение реферата (индивидуального задания) – всего 20 баллов.

Экзамен проставляется автоматически, если студент набрал в течении семестра не менее 60 баллов и отчитался за каждую контрольную точку. Минимальное количество баллов по каждому из видов текущей работы составляет 60% от максимального. Экзамен по дисциплине «Финансовые рынки» проводится по результатам работы в семестре. В случае, если полученная в семестре сумма баллов не устраивает студента, во время зачетной недели студент имеет право повысить итоговую оценку либо в форме устного собеседования по приведенным ниже вопросам (п.п. 6.4), либо в результате тестирования.

Шкала оценивания знаний при проведении промежуточной аттестации приведена в таблице 6.

Таблица 6 – Шкала оценивания знаний

Сумма баллов за все виды учебной деятельности	Оценка по национальной шкале экзамен
0-59	неудовлетворительно
60-73	удовлетворительно
74-89	хорошо
90-100	отлично

## 6.2 Домашнее задание

Задача 1. Номинальная стоимость акции – 5 тыс.руб., уровень дивиденда – 60%; ссудный процент – 20%. Необходимо рассчитать: а) курс акции; б) рыночную стоимость акции.

Задача 2. Рассчитайте курс акции и рыночную стоимость, если номинал акции – 4 тыс.руб., уровень дивиденда – 65%, ссудный процент – 25%.

Задача 3. Прибыль АО, предназначенная на выплату дивидендов, составила 300 тыс.руб. Общее количество акций – 600 ед., номинальная стоимость акции – 2 500 руб. Необходимо рассчитать уровень дивидендов по всем акциям.

Задача 4. Прибыль АО, предназначенная для выплаты дивидендов, составила 950 тыс.руб. Общее количество акций – 1 500 ед., номинал акции – 3 тыс.руб. Необходимо рассчитать уровень дивидендов по всем акциям.

Задача 5. Номинальная стоимость акции – 1000 руб., уровень дивиденда по акциям – 50%, ссудный процент – 25%. Необходимо рассчитать: а) курс акции; б) рыночную стоимость акции; в) дивидендную доходность акции.

Задача 6. Номинальная стоимость акции составила 5 тыс.руб., уровень дивиденда по акциям - 60%; ссудный процент – 55%. Необходимо рассчитать: а) курс акции; б) рыночную стоимость акции; в) дивидендную доходность акции.

Задача 7. Номинал акции – 5 тыс.руб., уровень дивиденда – 65%; норма ссудного процента – 40%. Необходимо определить: а) курс акции; б) рыночную стоимость акции; в) дивидендную доходность акции.

Задача 8. Прибыль АО, предназначенная для выплаты дивидендов, составила 400 тыс.руб. Общая сумма акций - 800 тыс.руб., в т.ч. привилегированных – 100 тыс.руб., голосующих – 700 тыс.руб., тыс.руб. На привилегированные акции установлен фиксированный уровень дивиденда – 40% к номиналу. Необходимо определить: а) годовую сумму дивидендов по привилегированным акциям;

б) уровень дивидендов по голосующим акциям; в) средний уровень дивидендов по всем акциям.

Задача 9. Прибыль АО, предназначенная для выплаты дивидендов, составила 600 тыс.руб. Общая сумма акций – 1 200 тыс.руб., в т.ч. привилегированных – 150 тыс.руб., голосующих – 1050 тыс.руб. На привилегированные акции установлен фиксированный уровень дивиденда – 60% к номиналу. Определите: а) годовую сумму дивидендов по

привилегированным акциям; б) уровень дивидендов по голосующим акциям; в) средний уровень дивидендов по всем акциям.

Задача 10. Чистая прибыль АО составила 450 млн. руб., коэффициент выплаты дивидендов – 0,2. Количество акций в обращении – 100 тыс. ед., из них привилегированных – 45%. Номинальная цена акции – 2 тыс. руб.

Уровень дивиденда по привилегированным акциям составил 75%.

Рассчитайте сумму дивидендов, приходящихся на 1 акцию по привилегированным и голосующим акциям.

Задача 11. Чистая прибыль АО – 400 млн. руб., коэффициент выплаты дивидендов – 0,2; количество акций в обращении – 80 т. ед., из них привилегированных – 40%. Номинальная цена акции – 1000 руб. Уровень дивидендов по привилегированным акциям составил 75%. Необходимо рассчитать сумму дивидендов, приходящихся на 1 акцию по привилегированным и голосующим акциям.

Задача 12. Прибыль АО, направленная на выплату дивидендов, составила 100 млн. руб. Количество акций в обращении – 100 тыс. ед., из них привилегированных – 30%. Объявленный уровень дивидендов по привилегированным акциям – 80% к их номинальной стоимости, равной 2000 руб., ссудный процент – 60%. Необходимо определить: а) годовую сумму дивидендов по привилегированным акциям; б) рыночную стоимость привилегированных акций; в) прибыль, направленную на выплату дивидендов по голосующим акциям.

Задача 13. Рассчитайте балансовую стоимость акции АОЗТ, если сумма активов АОЗТ – 800 тыс. руб., а сумма долгов – 300 тыс. руб. Количество оплаченных акций составило 3000 ед.

Задача 14. Сумма чистых активов АО – 6000 млн. руб. Количество оплаченных акций – 3 млн. ед. Необходимо рассчитать балансовую стоимость акции.

Задача 15. Рассчитайте балансовую стоимость акции, если: сумма активов АО – 5 млн. руб.; заемные средства – 230 тыс. руб., доходы будущих периодов – 570 тыс. руб., количество оплаченных акций – 10 тыс. ед.

### **6.3 Темы для рефератов (индивидуальное задание)**

Обязательным условием для сдачи экзамена по дисциплине «Финансовые рынки» является выполнение индивидуального задания, которое представляет собой написание и защиту реферата на одну из ниже приведенных тем.

- 1) Роль финансового рынка в экономике.
- 2) Государственное регулирование финансового рынка в стране.
- 3) Современное состояние финансовой системы страны.
- 4) Особенности межбанковского рынка страны.
- 5) Проблемы функционирования и развития финансового посредничества в стране.
- 6) Деятельность инвестиционных посредников на финансовых рынках.
- 7) Место рынка ценных бумаг на финансовом рынке страны.
- 8) Качественные и количественные характеристики состояния рынка

ценных бумаг.

- 9) Формирование и развитие рынка корпоративных облигаций.
- 10) Эмиссия облигаций – инструмент привлечения средств для развития предприятий.
- 11) Рынок государственных ценных бумаг.
- 12) Валютная политика страны на современном этапе.
- 13) Девальвация и ревальвация национальной денежной единицы: положительные и отрицательные последствия.
- 14) Становление и развитие валютного рынка страны.
- 15) Валютное регулирование и деятельность Центрального банка страны на валютном рынке.
- 16) Практика деятельности небанковских финансовых учреждений на валютном рынке страны.
- 17) Влияние мирового валютного рынка на внутренний валютный рынок страны.
- 18) Влияние международных санкций на состояние финансового рынка страны.
- 19) Проблемы защиты интересов вкладчиков банков.
- 20) Современная практика и особенности предоставления расчетных услуг банковскими учреждениями страны.
- 21) Роль золота в мировой валютно-финансовой системе.
- 22) Государственные методы регулирования рынка золота.
- 23) Виды депозитарной деятельности на фондовом рынке страны.
- 24) Место фондовых индексов в экономике страны.
- 25) Характеристика основных мировых фондовых индексов.

#### **6.4 Оценочные средства для самостоятельной работы и текущего контроля успеваемости**

*Тема 1 Сущность финансового рынка.*

- 1) Охарактеризуйте место финансового рынка в финансовой системе.
- 2) Какова структура финансового рынка?
- 3) Что такое субъекты финансового рынка?
- 4) Какие функции финансового рынка?
- 5) Раскройте рынок ценных бумаг как сегмент финансового рынка.

*Тема 2 Понятие и классификация финансового посредничества.*

- 1) В чем сущность понятия «финансовые посредники»?
- 2) Как определяется роль коммерческих банков как посредников?
- 3) Что такое депозитные небанковские институты.
- 4) Охарактеризуйте страховые компании.
- 5) Что такое инвестиционные компании и фонды?

*3. Роль финансового рынка в экономике.*

- 1) Перечислите основные тенденции и особенности развития финансовых рынков на современном этапе.
- 2) Каковы современные тенденции развития мирового финансового рынка?

3) Что такое финансовые инновации?

4) В чем выражается роль финансовых инноваций в изменении функций рынка ценных бумаг?

5) Что такое финансовый инжиниринг?

6) Укажите факторы развития финансового инжиниринга.

*Тема 4 Денежный рынок.*

1) Каковы структура и сущность денежного рынка?

2) Что такое объекты и субъекты рынка?

3) В чем особенность денежного рынка как рынка высоколиквидных финансовых активов, краткосрочных ценных бумаг?

4) Укажите инструменты денежного рынка.

5) Дайте характеристику учетного рынка.

*Тема 5 Валютный рынок.*

1) Чем отличается понятие и структура валютного рынка?

2) Что такое валютный рынок страны?

3) Какие есть виды операций с валютой?

4) Раскройте осуществление операций на межбанковском валютном рынке?

5) Как осуществляется валютное регулирование и курсовая политика Центрального банка страны?

*Тема 6 Рынок капиталов.*

1) В чем сущность понятия кредитного рынка?

2) Каковы функции кредитного рынка?

3) Чем отличается кредит как финансовый инструмент рынка?

4) Почему банки – основные участники рынка капиталов?

5) Раскройте понятие финансового риска.

6) Как классифицируются риски?

*Тема 7 Фондовый рынок.*

1) Какие функции рынка ценных бумаг?

2) Что такое модели фондового рынка?

3) Почему необходимо регулирование рынка ценных бумаг?

4) Как определяются участники рынка ценных бумаг и их виды?

5) В чем особенность непрофессиональных участников рынка ценных бумаг?

6) Кем устанавливаются виды лицензий профессиональных участников рынка ценных бумаг?

*Тема 8 Рынок золота.*

1) В чем состоит сущность золота как объекта купли-продажи?

2) Какова структура и функции современного рынка золота?

3) Как классифицируются факторы, влияющие на развитие рынка золота?

4) Какие операции с золотом действуют в настоящее время?

5) Перечислите методы регулирования рынка золота.

*Тема 9 Рынок производственных финансовых инструментов (деривативов).*

- 1) В чем причины появления и развития рынка производных финансовых инструментов?
- 2) Что такое хеджирование?
- 3) Перечислите виды производных финансовых инструментов, их особенности.

- 4) Чем отличаются форвардные контракты от фьючерсных?
- 5) Что такое брокерская деятельность на рынке ценных бумаг?
- 6) Какие задачи депозитарной и расчетно-клиринговой деятельности?
- 7) Для чего создаются клиринговые организации?

*Тема 10 Мировой финансовый рынок*

- 1) Укажите общую характеристику и сущность мирового финансового рынка?
- 2) Кто такие субъекты мирового рынка?
- 3) Какова общая структура мирового финансового рынка?
- 4) Что такая географическая структура мирового финансового рынка?
- 5) Охарактеризуйте международные финансовые потоки и мировые финансовые центры..

*Тема 11 Фондовые индексы и их роль в экономике*

- 1) В чем сущность фондовых индексов?
- 2) Каковы методы определения фондовых индексов?
- 3) Перечислите виды фондовых индексов?
- 4) Какие задачи выполняют фондовые индексы на финансовом рынке?
- 5) Дайте характеристику основных мировых фондовых индексов.

**6.4 Вопросы для подготовки к экзамену**

- 1) Какова сущность понятия «финансовый рынок»?
- 2) Перечислите основные факторы, оказывающие воздействие на финансовые рынки.
- 3) Раскройте тенденции финансовой глобализации и формы ее проявления.
- 4) В чем выражается сходство и различия финансовых систем?
- 5) Почему возникают информационные асимметрии на финансовом рынке?
- 6) В чем проблема информационных асимметрий на финансовом рынке и пути ее решения?
- 7) Что такая классификация рисков на финансовом рынке, причина их возникновения?
- 8) Причина секьюритизации финансовых активов?
- 9) Охарактеризуйте современное состояние мирового финансового рынка.
- 10) Как развивается структура и тенденции развития мирового финансового рынка?
  - 11) Что такое акции и их виды?
  - 12) Укажите виды цены акций.
  - 13) Покажите современное состояние и перспективы развития рынка акций России

- 14) Охарактеризуйте производные инструменты, связанные с акциями: классификация, область и масштабы применения.
- 15) Что такое облигации и их виды?
- 16) В чем сущность понятия рынок корпоративных облигаций
- 17) Для чего выпускаются ипотечные облигации?
- 18) Дайте характеристику рынка государственных и муниципальных ценных бумаг в России
- 19) Как характеризуются операции на рынке евробумаг?
- 20) Для чего выпускается вексель: этапы развития и технологии использования на современном финансовом рынке?
- 21) Охарактеризуйте понятие, функции и различия депозитных и сберегательных сертификатов коммерческих банков.
- 22) Что такое товарораспорядительные ценные бумаги?
- 23) Какие Российские ценные бумаги котируются на международных финансовых рынках?
- 24) В чем заключаются особенные свойства, характеристики, функции производных финансовых инструментов?
- 25) Какова система принципов ценообразования для всех производных рыночных инструментов?
- 26) Как формировалась история становления срочного рынка в России. Перспектива этого рынка в мире и РФ?
- 27) Укажите инновационные процессы на финансовых рынках производных финансовых продуктов (инструментов).
- 28) В чем особенности организации и ведения биржевой торговли производными финансовыми и товарными продуктами- инструментами?
- 29) Что такое форвардный контракт и его роль на финансовом рынке?
- 30) Каковы понятие и принципы определения форвардной цены и цены форвардного контракта?
- 31) Раскройте понятие форвардных валютных курсов и особенности их определения.
- 32) В чем особенности определения форвардной цены товара?
- 33) Дайте определение фьючерса как биржевого продукта-инструмента на финансовом и товарном рынках.
- 34) Перечислите правила ценообразования на фьючерсы.
- 35) Дайте определение опциона как производного продукта-инструмента.
- 36) Какие есть виды опционов?
- 37) Как происходит ценообразование опционов?
- 38) Что такое опционные стратегии?
- 39) Опишите организацию биржевой торговли опционами.
- 40) Каковы свойства и характеристики свопов?
- 41) Что понимается под экзотическими свопами?
- 42) Дайте общую характеристику экзотических опционов.
- 43) Что такое «погодные» производные: общая характеристика, структура, особенности ценообразования?

- 44) Какова сфера применения и основные проблемы использования кредитных деривативов?
- 45) Опишите инструменты рынка кредитных деривативов.
- 46) Как определяется профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг?
- 47) Кто является профессиональными участниками рынка ценных бумаг?
- 48) Что относится к операциям коммерческих банков с ценными бумагами?
- 49) Охарактеризуйте понятие и структуру инвестиционного банка.
- 50) Каковы требования к деятельности инвестиционного банка?
- 6.6 Примерная тематика курсовых работ**
- 1) Финансовые инвестиции и их классификация.
  - 2) Особенности и формы финансовых инвестиций.
  - 3) Сущность и этапы процесса финансового инвестирования
  - 4) Ценные бумаги, сущность и функции
  - 5) Финансовый рынок как экономическое пространство, на котором формируются отношения купли-продажи финансовых фондов.
  - 6) Место финансового рынка в финансовой системе страны.
  - 7) Структура финансового рынка Российской Федерации.
  - 8) Субъекты отношений – участники финансового рынка.
  - 9) Функции финансового рынка.
  - 10) Финансовые инструменты рынка – ценные бумаги, их экономическая и правовая природа.
  - 11) Финансовые институты как посредники между субъектами финансового рынка, значение посредничества.
  - 12) Виды финансовых посредников финансового рынка.
  - 13) Роль коммерческих банков как посредников финансового рынка.
  - 14) Депозитные небанковские институты.
  - 15) Страховые компании.
  - 16) Инвестиционные компании и фонды.
  - 17) Пенсионные фонды и перспективы их развития в Российской Федерации.
  - 18) Структура и сущность денежного рынка.
  - 19) Объекты и субъекты денежного рынка.
  - 20) Классификация ценных бумаг.
  - 21) Характеристика межбанковского рынка. Операции на межбанковском рынке.
  - 22) Понятие и структура валютного рынка.
  - 23) Валютные операции, связанные с движением иностранной валюты и операции, связанные с движением капитала.
  - 24) Осуществление операций на межбанковском валютном рынке.
  - 25) Валютное регулирование и курсовая политика Центрального банка Российской Федерации

- 26) Инструменты денежного рынка.
- 27) Характеристика учетного рынка и его особенности б.
- 28) Сущность, виды и классификация акций
- 29) Основные виды операций с ценными бумагами
- 30) Управление операциями с ценными бумагами
- 35) Базовые теории управления операциями с ценными бумагами
- 36) Концепция взаимосвязи риска и доходности.
- 37) Модели оценки акций и облигаций на основе их доходности.
- 38) Понятие и цели формирования инвестиционного портфеля.
- 39) Типы инвестиционных портфелей.
- 40) Оценка доходности и риска портфеля ценных бумаг
- 41) Неопределенность и риск. Классификация рисков инвестиционной деятельности

## **7 Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины**

### **7.1 Рекомендуемая литература**

#### ***Основная литература***

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://urait.ru/bcode/511698> (дата обращения: 19.08.2024).

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://urait.ru/bcode/512093> (дата обращения: 19.08.2024).

#### ***Дополнительная литература***

1. Чалдаева, Л. А. Рынок ценных бумаг : учебник для вузов . — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 381 с. — ISBN 978-5-534-08142-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/510541> (дата обращения: 19.08.2024).

2. 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://urait.ru/bcode/510756> (дата обращения: 19.08.2024).

#### ***Учебно-методическое обеспечение***

1. Учебная программа по курсу «Финансовые рынки» : (для студентов направления подготовки 38.03.01 «Экономика» всех форм обучения) / сост. Е.В. Карпенко; Каф. Финансов – Алчевск : ФГБОУ ВО ДонГТУ, 2020. – 21 с. URL: <https://moodle.dstu.education/course/view.php?id=3642>. — Режим доступа: для авториз. пользователей. — Текст : электронный.

### **7.2 Базы данных, электронно-библиотечные системы, информационно-справочные и поисковые системы**

1. Научная библиотека ДонГТУ : официальный сайт. – Алчевск. – URL: [library.dstu.education](http://library.dstu.education). – Текст : электронный.

2. Научно-техническая библиотека БГТУ им. Шухова : официальный сайт. – Белгород. – URL: <http://ntb.bstu.ru/jirbis2/>. – Текст : электронный.

3. Консультант студента : электронно-библиотечная система. — Москва. — URL: <http://www.studentlibrary.ru/cgi-bin/mb4x>. – Текст : электронный.

4. Университетская библиотека онлайн : электронно-библиотечная система. – URL: [http://biblioclub.ru/index.php?page=main\\_ub\\_red](http://biblioclub.ru/index.php?page=main_ub_red). – Текст : электронный.

## **8 Материально-техническое обеспечение дисциплины**

Материально-техническая база обеспечивает проведение всех видов деятельности в процессе обучения, соответствует требованиям ФГОС ВО.

Материально-техническое обеспечение представлено в таблице 7.

Таблица 7 – Материально-техническое обеспечение

Наименование оборудованных учебных кабинетов	Адрес (местоположение) учебных кабинетов
<p>Специальные помещения:</p> <p><i>учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, текущего контроля и промежуточной аттестации, представления результатов самостоятельного исследования ВКР и др., оборудованная специализированной (учебной) мебелью; набором демонстрационного оборудования для представления информации: мультимедиа-проектор, компьютер компьютерный класс (учебная аудитория) для групповых и индивидуальных консультаций, для проведения курсового проектирования (выполнения курсовых работ), организации самостоятельной работы, в том числе, научно-исследовательской, оборудованная учебной мебелью, компьютерами с неограниченным доступом к сети Интернет, включая доступ к ЭБС</i></p>	<p>ауд. <u>206</u> корп. <u>2</u></p> <p>ауд. <u>412</u> корп. <u>2</u></p>

## Лист согласования РПД

Разработал  
доцент кафедры финансов и  
бухгалтерского учета

В.А. Татаренко  
(подпись)

В.А. Татаренко  
(Ф.И.О.)

и.о. заведующего кафедрой финансов  
и бухгалтерского учета

Э.А. Эккерт  
(подпись)

Э.А. Эккерт  
(Ф.И.О.)

Протокол № 15 заседания кафедры  
финансов от 01.07.24г.

и.о. декана факультета экономики управления  
и лингвистического сопровождения

Э.Р. Самкова  
(подпись)

Э.Р. Самкова  
(Ф.И.О.)

Согласовано

Председатель методической  
комиссии по направлению подготовки  
38.03.01 Экономика  
(Образовательная программа  
«Финансы и кредит»)

Э.А. Эккерт  
(подпись)

Э.А. Эккерт  
(Ф.И.О.)

Начальник учебно-методического центра

О.А. Коваленко  
(подпись)

О.А. Коваленко  
(Ф.И.О.)

### Лист изменений и дополнений

Номер изменения, дата внесения изменения, номер страницы для внесения изменений	
ДО ВНЕСЕНИЯ ИЗМЕНЕНИЙ:	ПОСЛЕ ВНЕСЕНИЯ ИЗМЕНЕНИЙ:
Основание:	
Подпись лица, ответственного за внесение изменений	