

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(МИНОБРНАУКИ РОССИИ)

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ
ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«ДОНБАССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ»
(ФГБОУ ВО «ДонГТУ»)

Факультет экономики, управления и лингвистического
сопровождения

Кафедра финансов и бухгалтерского учета



УТВЕРЖДАЮ
И.о. проректора
по учебной работе
Д.В. Мулов

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Финансовые рынки
(наименование дисциплины)

38.03.01 Экономика
(код, наименование направления)

Финансы и бухгалтерский учет
(профиль подготовки)

Квалификация

бакалавр

(бакалавр/специалист/магистр)

Форма обучения

очная, очно-заочная

(очная, очно-заочная, заочная)

Алчевск, 2024

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-5) компетенций выпускника.

2 Место дисциплины в структуре ОПОП ВО

Логико-структурный анализ дисциплины – курс входит в часть Блока 1, формируемую участниками образовательных отношений по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика», профиль «Финансы и бухгалтерский учет».

Дисциплина реализуется кафедрой финансов и бухгалтерского учета.

Основывается на базе дисциплин: «Финансы», «Деньги, кредит, банки», «Статистика».

Является основой для изучения следующих дисциплин: «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 (36 ак. ч.), курсовая работа и самостоятельная работа студента (72 ак. ч.).

Для студентов очно-заочной формы обучения общая трудоемкость освоения дисциплины составляет 4 з. ед., 144 ак. ч. Программой дисциплины предусмотрены: лекционные занятия (20 ак. ч.); практические занятия (10 ак. ч.), курсовая работа и самостоятельная работа студента (114 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 8 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 |
|---|-----------------|---|
| ПК-5. Способен осуществлять мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков и предоставлять консультационные услуги (в том числе с использованием современных информационных технологий и программных средств) | ПК-5 | <p>ПК-5.1. Проводит исследования финансового рынка, рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, валютного рынка, товарно-сырьевых рынков и изучает предложения финансовых услуг (в том числе с использованием современных информационных технологий и программных средств).</p> <p>ПК-5.2. Исследует и анализирует документы, участвующие в финансовых операциях, предоставляемую клиентами документацию, регулярную аналитическую отчетность клиентов.</p> |

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: | 72 | 72 | |
| Лекции (Л) | 36 | 36 | |
| Практические занятия (ПЗ) | 36 | 36 | |
| Лабораторные работы (ЛР) | - | - | - |
| Курсовая работа/курсовой проект | - | - | - |
| Самостоятельная работа студентов (СРС), в том числе: | 72 | 72 | |
| Подготовка к лекциям | 4 | 4 | - |
| Подготовка к лабораторным работам | - | - | - |
| Подготовка к практическим занятиям / семинарам | 10 | 10 | - |
| Выполнение курсовой работы / проекта | 20 | 20 | - |
| Расчетно-графическая работа (РГР) | - | - | - |
| Реферат (индивидуальное задание) | 10 | 10 | - |
| Домашнее задание | 6 | 6 | - |
| Подготовка к контрольной работе | - | - | - |
| Подготовка к коллоквиуму | - | - | - |
| Аналитический информационный поиск | - | - | - |
| Работа в библиотеке | 6 | 6 | - |
| Подготовка к экзамену | 16 | 16 | - |
| Промежуточная аттестация | Э, Д/З | Э, Д/З | - |
| Общая трудоёмкость 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. | 2 | – | – |
| 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. | 2 | – | – |
| 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. | 4 | – | – |
| 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. | 4 | – | – |
| 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. | 4 | – | – |
| 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. | 2 | – | – |
| 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. | 4 | – | – |
| 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. | 2 | – | – |
| 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 | | 36 | – | |

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. | 4 | Характеристика межбанковского рынка. Операции на межбанковском рынке. | 2 | – | – |
| 2 | 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. | 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. | 4 | 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. | 4 | 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. | 2 | — | — |
| Всего аудиторных часов | | | 20 | | 10 | — | |

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) 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-5 | 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 такое 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 такое 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. – 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. – 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: <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
(должность)


(подпись)

В.А. Татаренко
(Ф.И.О.)

и.о. заведующего кафедрой финансов
и бухгалтерского учета


(подпись)

Е.А. Эккерт
(Ф.И.О.)

Протокол №_15_ заседания кафедры
финансов от 01.07.24г.

и.о. декана факультета экономики управления
и лингвистического сопровождения


(подпись) Э.Р.Самкова
(Ф.И.О.)

Согласовано

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


(подпись) Е.А. Эккерт
(Ф.И.О.)

Начальник учебно-методического центра


(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 | |