

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Новомосковский институт (филиал)
федерального государственного бюджетного образовательного учреждения высшего
образования «Российский химико-технологический университет имени Д.И. Менделеева»



УТВЕРЖДАЮ
Директор Новомосковского института
РХТУ им. Д.И. Менделеева
Первухин В.Л.

«30» 06 2022 г.

Рабочая программа дисциплины

Современные инструменты финансовых рынков

Направление подготовки 43.03.01 «Сервис»

Направленность (профиль) подготовки «Сервис в сфере финансовой и коммерческой деятельности»

Квалификация выпускника Бакалавр

(бакалавр, магистр, дипломированный специалист)

Форма обучения заочная

(очная, очно-заочная и др.)

г. Новомосковск – 2022г.

Разработчик:

Доцент кафедры «Экономика, финансы и бухгалтерский учет»
Новомосковского института РХТУ им. Д.И. Менделеева,
к.э.н., доцент

(Седова И.Н.)

Эксперт:

Заместитель Вице-президента-Управляющего
Филиалом ГПБ АО «Среднерусский»

(Тюрина И.С.)

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры «Экономика, финансы и бухгалтерский учет»

Протокол № 10 от 24.06.2022 г.

Зав. кафедрой: к.э.н., доцент

(Саяпина Е.Д.)

Рабочая программа согласована с деканом «Заочного и очно-заочного обучения»

Декан факультета: к.т.н., доцент

(Стекольников А.Ю.)

«24» июня 2022 г

Рабочая программа согласована с руководителем учебно-методического управления
Новомосковского института РХТУ им. Д.И. Менделеева

Руководитель, д.х.н., профессор

(Кизим Н.Ф.)

«24» июня 2022 г

Аннотация рабочей программы приведена в приложении 1.

1 ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Нормативные документы, используемые при разработке рабочей программы дисциплины

Нормативную правовую базу разработки рабочей программы дисциплины составляют:

- Федеральный закон от 29.12.2012 № 273-ФЗ «Об образовании в Российской Федерации»;
- Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования – бакалавриат по направлению подготовки 43.03.01 Сервис», утвержденный приказом Министерства науки и высшего образования Российской Федерации от 08.06.2017 г. № 514;
- Профессиональный стандарт «Специалист по организации постпродажного обслуживания и сервиса», утвержденный приказом Министерства труда и социальной защиты Российской Федерации от 31.10.2014 г. № 864н;
- Профессиональный стандарт «Специалист по финансовому консультированию», утвержденный приказом Министерства труда и социальной защиты Российской Федерации от 19.03.2015 г. № 167н;
- Приказ Минобрнауки России от 06.04.2021 N 245 «Об утверждении Порядка организации и осуществления образовательной деятельности по образовательным программам высшего образования - программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры»;
- Приказ Министерства образования и науки РФ от 23.08.2017 № 816 «Об утверждении Порядка применения организациями, осуществляющими образовательную деятельность, электронного обучения, дистанционных образовательных технологий при реализации образовательных программ»;
- Приказ Министерства науки и высшего образования Российской Федерации, Министерства просвещения Российской Федерации от 05.08.2020 № 885/390 «О практической подготовке обучающихся»;
- Локальные нормативные акты Новомосковского института (филиала) РХТУ им. Д.И. Менделеева.

Рабочая программа дисциплины (далее – Программа, РПД) составлена в соответствии с требованиями Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования (уровень бакалавриата) по направлению подготовки 43.03.01 Сервис, утвержденного приказом Министерства науки и высшего образования Российской Федерации от 08.06.2017 г. № 514, рекомендациями Учебно-методической комиссии НИ РХТУ им. Д.И. Менделеева и накопленным опытом преподавания дисциплины кафедрой «Экономика, финансы и бухгалтерский учет» НИ РХТУ им. Д.И. Менделеева (далее – Институт).

Контроль успеваемости студентов ведется по принятой в Институте системе.

Рабочая программа дисциплины может быть реализована с применением электронного обучения и дистанционных образовательных технологий полностью или частично.

2 ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Целью освоения дисциплины «Современные инструменты финансовых рынков» является формирование у студентов глубоких и качественных профессиональных знаний в области теоретических основ и практических аспектов функционирования системы финансовых рынков и рынка производных финансовых инструментов, представляющих собой составные компоненты финансового рынка.

Задачи преподавания дисциплины:

- исследование системы действующих на рынке финансовых инструментов;
- приобретения практических навыков по оценке инвестиционной привлекательности вложения средств;
- использовать полученные знания для консультирования клиента по выбору вида финансовой услуги и поставщика финансовой услуги;
- формирование умений и навыков составления аналитической отчетности об оказании финансовых услуг;
- использование системы знаний о принципах и особенностях применения различных инструментов управления финансовыми рисками;
- определение круга методических проблем управления рисками в рамках индивидуального финансового планирования.

3 МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП

Дисциплина Б1.В.04 Современные инструменты финансовых рынков является обязательной для освоения в 7 семестре, на 4 курсе.

Дисциплина реализуется в рамках части, формируемой участниками образовательных отношений ОПОП.

Для освоения дисциплины необходимы знания, умения и компетенции, полученные студентами в ходе освоения следующих дисциплин: «Страхование коммерческих и финансовых рисков»

4 ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

1. Изучение дисциплины направлено на приобретение следующих компетенций и индикаторов их достижения:

Универсальные компетенции (УК) и индикаторы их достижения:

Наименование категории (группы) компетенций	Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции
1	2	3
Системное и критическое мышление	УК-1 Способен осуществлять поиск, критический анализ и синтез информации, применять системный подход для решения поставленных задач	УК-1.1 Анализирует задачу, выделяя ее базовые составляющие. Определяет, интерпретирует и ранжирует информацию, требуемую для решения поставленной задачи
		УК-1.2 Осуществляет поиск информации для решения поставленной задачи по различным типам запросов
		УК-1.3 При обработке информации отличает факты от мнений, интерпритаций, оценок, формирует собственные мнения и суждения, аргументирует свои выводы и точку зрения
		УК -1.4 Рассматривает и предлагает возможные варианты решения поставленной задачи, оценивая их достоинства и недостатки
Разработка и реализация проектов	УК-2 Способен определять круг задач в рамках поставленной цели и выбирать оптимальные способы их решения, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	УК-2.1 Определяет круг задач в рамках поставленной цели, определяет связи между ними и ожидаемые результаты их решения.
		УК-2.2 В рамках поставленных задач определяет имеющиеся ресурсы и ограничения, действующие правовые нормы
		УК-2.5 Представляет результаты проекта, предлагает возможности их использования и/или совершенствования
Самоорганизация и саморазвитие (в том числе здоровьесбережение)	УК-6 Способен управлять своим временем, выстраивать и реализовывать траекторию саморазвития на основе принципов образования в течение всей жизни	УК-6.1 Использует инструменты и методы управления временем при выполнении конкретных задач, проектов, при достижении поставленных целей

Профессиональные компетенции (ПК) и индикаторы их достижения

Тип задач профессиональной деятельности	Код и наименование профессиональной компетенции выпускника	Индикаторы достижения компетенции
исследовательский	ПК-7 Способен организовать и провести исследование финансовых рынков	ПК -7.2 Организует сбор, обработку и анализ информации о финансовых рынках;
		ПК -7.3 Изучает предложение финансовых продуктов и услуг;
сервисный	ПК-8 Способен выбрать финансовые продукты исходя из финансовых возможностей клиента	ПК -8.2 Сравнивает параметры финансовых продуктов, организует и проводит презентации финансовых продуктов и услуг;
		ПК -8.3 Рассчитывает стоимость финансовых услуг, оценивает потенциальные финансовые риски;

сервисный	ПК-9 Способен организовать оформление сделок по предоставлению финансовых услуг клиентам	ПК -9.1 Консультирует клиента по выбору вида финансовой услуги и поставщика финансовой услуги;
		ПК -9.4 Составляет аналитическую отчетность об оказании финансовых услуг.

В результате изучения дисциплины студент бакалавриата должен:

Знать:

- основные инструменты финансового рынка;
- теории финансовых рынков для принятия инвестиционных решений;
- методы математического анализа и моделирования, теоретического и экспериментального исследования показателей финансовых рынков для принятия управленческих решений;

Уметь:

- осуществлять поиск информации, характеризующей тенденции финансовых рынков;
- составлять аналитическую отчетность об оказании финансовых услуг;
- использовать и оценивать различные финансовые инструменты;
- оценивать риск и доходность на основных этапах финансового управления;
- оценивать эффективность принятых управленческих решений;

Владеть:

- методикой экономического исследования финансовых рынков;
- методами и приемами анализа экономических явлений и процессов на финансовых рынках;
- навыками использования различных финансовых инструментов;
- навыками проведения расчетов доходности финансовых инструментов.

5 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

5.1 Объем дисциплины и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет **216** часа или **8** зачетных единиц (з.е). 1 з.е. равна 27 астрономическим часам или 36 академическим часам. Дисциплина изучается на 4 курсе в 8 семестре.

Вид учебной работы	Объем, акад. ч.	в том числе в форме практической подготовки, акад. ч.
Общая трудоемкость дисциплины	216	10
Контактная работа - аудиторные занятия:	18,6	10
Лекции	6	10
Практические занятия (ПЗ)	12	-
Лабораторные работы (ЛР)	-	-
Контактная самостоятельная работа (групповые консультации и индивидуальная работа обучающихся с педагогическим работником)		
Контактная работа - промежуточная аттестация	0,6	
Самостоятельная работа	189	-
Самостоятельное изучение разделов дисциплины	189	-
Форма(ы) контроля:	Курсовая работа, экзамен	
Контактная работа - промежуточная аттестация	0,6	-
Подготовка к экзамену.	8,4	-

6 СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

6.1 Разделы дисциплины и виды занятий

№ п/п	Раздел дисциплины	Академ. часов								
		Всего	в т.ч. в форме практ. подг.	Лекции	в т.ч. в форме практ. подг.	Прак. занятия	в т.ч. в форме практ. подг.	Лаб. работы	в т.ч. в форме практ. подг.	Сам. работа
1	Раздел 1. Сущность, роль и функции финансовых рынков в экономике	19	-	-	-	-	-	-	-	9
1.1	Основные понятия финансового рынка и модели его исследования	4	-	-	-	-	-	-	-	4
1.2	Инфраструктура и участники финансового рынка.	4	-	-	-	-	-			4
1.3	Развитие финансового рынка в РФ	4	-	-	-	-	2			4
1.4	Риск и доходность финансовых активов на рынке. Анализ финансовых рынков.	7	-	-	-	-	-			7
2	Раздел 2. Рынок производных финансовых инструментов	75	5	1	5	4	-	-	-	70
2.1	Сущность, функции и свойства производных финансовых инструментов.	11	1	-	1	1	-	-	-	10
2.2	Рынок ссудного капитала – важнейшая составная часть финансового рынка.	22	1	1	1	1	-			20
2.3	Механизм функционирования и современные инструменты финансовых рынков.	21	2	-	2	1	-			20
2.4	Форвардные, фьючерсные и опционные контракты. Свопы. Экзотические производные финансовые инструменты.	21	1	-	1	1	-			20
	Раздел 3. Регулирование финансовых рынков	69	3	3	3	6	-			60
3.1	Понятие регулятивной инфраструктуры финансового рынка. Глобальная система финансового регулирования.	23	1	1	1	2	-			20
3.2	Государственное регулирование и саморегулирование финансового рынка.	23	1	1	1	2	-			20
3.3	Опыт регулирования финансовых рынков в разных странах.	23	1	1	1	2	-			20
	Раздел 4. Инновации на финансовых рынках	44	2	2	2	2	-	-	-	40
4.1	Финансовый инжиниринг	12	1	1	1	1	-	-	-	10
4.2	Финансовые конгломераты. Новые финансовые инструменты. Совершенствование финансовых механизмов. Развитие финансовых институтов	32	1	1	1	1	-	-	-	30
	ИТОГО	207	10	6	10	12	-	-	-	189
	Контактная самостоятельная работа (консультации)									
	Подготовка к экзамену	8,4								
	Контактная работа - промежуточная аттестация	0,6								
	ИТОГО	216								

6.2 Содержание дисциплины

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела
1	2	3
Раздел 1. Сущность, роль и функции финансовых рынков в экономике		
1.1	Основные понятия финансового рынка и модели его исследования	Понятие, роль, значение и функции финансового рынка. Причины усиления влияния финансовых рынков на экономическое развитие. Финансовые потоки в экономике. Состав и структура финансового рынка. Классификация финансовых рынков. Взаимосвязь сегментов различных сегментов финансового рынка. Кредитный рынок: функциональные особенности, участники. Рынок ценных бумаг: сущность, функции, индикаторы. Валютный рынок: суть, классификация. Валютный курс: теоретические основы и классификация. Страховой рынок: особенности функционирования, участники, отрасли и виды
1.2	Инфраструктура и участники финансового рынка	Понятие и основные элементы инфраструктуры финансового рынка. Участники финансового рынка. Фондовая биржа и фондовый рынок. Участники биржевого рынка, финансовые посредники. Сущность биржевой сделки на фондовой бирже. Модель институциональной инфраструктуры финансовых рынков. Финансовые посредники: функции, классификация, направления деятельности. Центральные банки как ведущее звено финансовой системы. Биржи: виды, функции и состав. Соотношение банковских и небанковских институтов: отечественная и зарубежная практика.
1.3	Развитие финансового рынка в РФ	Этапы формирования финансового рынка Российской Федерации. Отличительные черты рынка ценных бумаг России. Специфика выпуска ценных бумаг в Российской Федерации. Ценные бумаги, допущенные к обращению в Российской Федерации. Особенности валютного рынка России. Современное состояние и перспективы развития кредитного рынка Российской Федерации. Показатели и тенденции развития финансового рынка РФ.
1.4	Риск и доходность финансовых активов на рынке. Анализ финансовых рынков.	Основы фундаментального анализа финансовых рынков Показатели фундаментального анализа (уровень процентных ставок, валовый внутренний продукт (ВВП), сальдо бюджета (дефицит, профицит), валютный курс, ставка рефинансирования, уровень инфляции, уровень занятости и безработицы, торговый баланс страны, количество новых рабочих мест. Основы технического анализа финансовых рынков Методы технического анализа (графические, количественные, теория циклов.
Раздел 2. Рынок производных финансовых инструментов		
2.1	Сущность, функции и свойства производных финансовых инструментов	Классификация финансовых инструментов. Характеристика важнейших инструментов финансовых рынков: процентных ставок, валютного курса, финансовых операций и др.
2.2	Рынок ссудного капитала – важнейшая составная часть финансового рынка	Понятие и фундаментальные свойства ценных бумаг. Отличительные признаки и преимущества ценной бумаги от других финансовых инструментов. Классификация ценных бумаг. Валюта, валютные ценности: понятие, классификация, структура. Кредит как эффективный инструмент привлечения ресурсов. Виды кредитов.
2.3	Механизм функционирования и современные инструменты финансовых рынков.	Основные понятия рынка производных финансовых инструментов. Форвардные и фьючерсные контракты. Рынок фьючерсных контрактов. Опционы. Рынок опционов. Свопы. Экзотические производные финансовые инструменты.
2.4	Форвардные, фьючерсные и опционные контракты. Свопы. Экзотические производные финансовые инструменты	Понятие своповой сделки. Определения своповой сделки согласно законодательству РФ. Типы и виды свопов. Валютный, валютно-процентный, товарный, фондовый свопы, другие виды свопов. Валютный своп Банка России. Предпосылки для возможности реализации своповой сделки. Понятие относительной силы и слабости. Основные отличия между свопами и фьючерсными/форвардными контрактами. Преимущества и риски использования свопов. Участники и инфраструктура свопового рынка. Оценка стоимости свопа. Соглашение о форвардной ставке. Свопующие банки. Котировки свопов.
Раздел 3. Регулирование финансовых рынков		
3.1	Понятие регулятивной инфраструктуры финансового рынка.	Содержание финансового регулирования, его формы и методы. Регулирование рынка ценных бумаг. Место и функции саморегулируемых организаций в системе регулирования финансовых

	Глобальная система финансового регулирования.	рынков. Методы государственного валютного регулирования. Валютное регулирование в РФ. Государственное регулирование страхового рынка. Влияние Банка России на развитие финансового рынка
3.2	Государственное регулирование и саморегулирование финансового рынка.	Понятие регулятивной инфраструктуры финансового рынка. Государственное регулирование и саморегулирование финансового рынка.
3.3	Опыт регулирования финансовых рынков в разных странах	Опыт регулирования финансовых рынков в разных странах. Глобальная система финансового регулирования.
Раздел 4. Инновации на финансовых рынках		
4.1	Финансовый инжиниринг	Финансовый инжиниринг. Финансовые конгломераты. Совершенствование финансовых механизмов.
4.2	Финансовые конгломераты. Новые финансовые инструменты.	Новые финансовые инструменты. Развитие финансовых институтов. Экзотические производные финансовые инструменты. Финансовые конгломераты.

7 СООТВЕТСТВИЕ СОДЕРЖАНИЯ ТРЕБОВАНИЯМ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

№	В результате освоения дисциплины студент должен:	Раздел 1	Раздел 2	Раздел 3	Раздел 4
	Знать:				+
1	- основные инструменты финансового рынка;	+	+		+
2	- теории финансовых рынков для принятия инвестиционных решений;	+	+	+	+
3	- методы математического анализа и моделирования, теоретического и экспериментального исследования показателей финансовых рынков для принятия управленческих решений;	+		+	+
	Уметь:				+
1	- осуществлять поиск информации, характеризующей тенденции финансовых рынков;	+	+	+	+
2	- составлять аналитическую отчетность об оказании финансовых услуг;		+	+	+
3	- использовать и оценивать различные финансовые инструменты;		+		+
4	- оценивать риск и доходность на основных этапах финансового управления;			+	+
5	- оценивать эффективность принятых управленческих решений;			+	+
	Владеть:				+
1	- методикой экономического исследования финансовых рынков;	+		+	+
2	- методами и приемами анализа экономических явлений и процессов на финансовых рынках;		+	+	+
3	- навыками использования различных финансовых инструментов;		+	+	+
4	- навыками проведения расчетов доходности финансовых инструментов.			+	+

В результате освоения дисциплины студент должен овладеть следующими компетенциями и индикаторами их достижения:

№	Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Раздел 1	Раздел 2	Раздел 3	Раздел 4
1	2	3	4	5	6	7

1	УК-1 Способен осуществлять поиск, критический анализ и синтез информации, применять системный подход для решения поставленных задач	УК-1.1 Анализирует задачу, выделяя ее базовые составляющие. Определяет, интерпретирует и ранжирует информацию, требуемую для решения поставленной задачи УК-1.2 Осуществляет поиск информации для решения поставленной задачи по различным типам запросов УК-1.3 При обработке информации отличает факты от мнений, интерпретаций, оценок, формирует собственные мнения и суждения, аргументирует свои выводы и точку зрения УК -1.4 Рассматривает и предлагает возможные варианты решения поставленной задачи, оценивая их достоинства и недостатки.	+	+	+	+
2	УК-2 Способен определять круг задач в рамках поставленной цели и выбирать оптимальные способы их решения, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	УК-2.1 Определяет круг задач в рамках поставленной цели, определяет связи между ними и ожидаемые результаты их решения. УК-2.2 В рамках поставленных задач определяет имеющиеся ресурсы и ограничения, действующие правовые нормы УК-2.5 Представляет результаты проекта, предлагает возможности их использования и/или совершенствования	+	+	+	+
3	УК-6 Способен управлять своим временем, выстраивать и реализовывать траекторию саморазвития на основе принципов образования в течение всей жизни	УК-6.1 Использует инструменты и методы управления временем при выполнении конкретных задач, проектов, при достижении поставленных целей	+	+	+	+
4	ПК-7 Способен осуществить расчет затрат, составление смет расходов и калькуляций себестоимости продукции (работ, услуг) экономического субъекта	ПК -7.2 Ведет учет затрат на осуществление хозяйственной деятельности; ПК -7.3 Составляет сметы расходов, калькуляции себестоимости продукции (работ, услуг).	+	+	+	+

5	ПК-8 Способен выбрать финансовые продукты исходя из финансовых возможностей клиента	ПК -8.2 Сравнивает параметры финансовых продуктов, организует и проводит презентации финансовых продуктов и услуг; ПК -8.3 Рассчитывает стоимость финансовых услуг, оценивает потенциальные финансовые риски;	+	+	+	+
6	ПК-9 Способен организовать оформление сделок по предоставлению финансовых услуг клиентам	ПК -9.1 Консультирует клиента по выбору вида финансовой услуги и поставщика финансовой услуги; ПК -9.4 Составляет аналитическую отчетность об оказании финансовых услуг.	+	+	+	+

8 ПРАКТИЧЕСКИЕ И ЛАБОРАТОРНЫЕ ЗАНЯТИЯ

8.1 Практические занятия

Темы практических занятий по дисциплине

№ п/п	№ раздела дисциплины	Тематика практических занятий (семинаров)	Трудоемкость час.	Формы текущего контроля	Код формируемой компетенции
1	2	3	4	5	6
1	1	Обсуждение теоретических вопросов. 1 История финансовых рынков. 2 Сегменты финансового рынка. 3 Фундаментальный и технический анализ финансовых рынков. Финансовые потоки в экономике. Состав и структура финансового рынка. Классификация финансовых рынков. Взаимосвязь сегментов различных сегментов финансового рынка.	2	УО	УК-1.1; УК-1.2; УК-1.3; УК-1.4; УК-2.1; УК-2.2; УК-2.5; УК-6.1; ПК-7.2; ПК-7.3; ПК-8.2; ПК-8.3; ПК-9.1; ПК-9.4
2	2	Особенности финансового рынка Российской Федерации Дискуссия по вопросам целесообразности и возможности использования разных видов финансовых инструментов в деятельности финансово-кредитных институтов. Презентация обучающимися результатов домашнего творческого задания. Этапы формирования финансового рынка РФ. Отличительные черты рынка ценных бумаг России. Специфика выпуска ценных бумаг в Российской Федерации. Ценные бумаги, допущенные к обращению в Российской Федерации. Особенности валютного рынка России. Современное состояние и перспективы развития кредитного рынка Российской Федерации. Показатели и тенденции развития финансового рынка РФ.	2	УО	УК-1.1; УК-1.2; УК-1.3; УК-1.4; УК-2.1; УК-2.2; УК-2.5; УК-6.1; ПК-7.2; ПК-7.3; ПК-8.2; ПК-8.3; ПК-9.1; ПК-9.4

2	2	1 История производных финансовых инструментов. 2 Виды опционов и фьючерсов. 3 Основы организации рынка свопов. Рассмотрение видов финансовых инструментов. Формирование творческих коллективов – малых групп для выполнения творческого домашнего задания. Обсуждение содержания творческого домашнего задания. Решение задач. Классификация финансовых инструментов. Характеристика важнейших инструментов финансовых рынков: процентных ставок, валютного курса, финансовых операций и др. Понятие и фундаментальные свойства ценных бумаг. Отличительные признаки и преимущества ценной бумаги от других финансовых инструментов. Классификация ценных бумаг. Валюта, валютные ценности: понятие, классификация, структура. Кредит как эффективный инструмент привлечения ресурсов. Виды кредитов.	10	Т,УО	УК-1.1; УК-1.2; УК-1.3; УК-1.4; УК-2.1; УК-2.2; УК-2.5; УК-6.1; ПК-7.2; ПК-7.3; ПК-8.2; ПК-8.3; ПК-9.1; ПК-9.4
3	2	Основные понятия рынка производных финансовых инструментов. Форвардные и фьючерсные контракты. Рынок фьючерсных контрактов. Опционы. Рынок опционов. Свопы. Экзотические производные финансовые инструменты	10	УО	УК-1.1; УК-1.2; УК-1.3; УК-1.4; УК-2.1; УК-2.2; УК-2.5; УК-6.1; ПК-7.2; ПК-7.3; ПК-8.2; ПК-8.3; ПК-9.1; ПК-9.4
4	3	Регулирование финансовых рынков Дискуссия по выбору модели регулирования финансового рынка. Презентация обучающимися результатов домашнего творческого задания. Содержание финансового регулирования, его формы и методы. Регулирование рынка ценных бумаг. Место и функции саморегулируемых организаций в системе регулирования финансовых рынков. Методы государственного валютного регулирования. Валютное регулирование в РФ. Государственное регулирование страхового рынка. Влияние Банка России на развитие финансового рынка.	16	УО	УК-1.1; УК-1.2; УК-1.3; УК-1.4; УК-2.1; УК-2.2; УК-2.5; УК-6.1; ПК-7.2; ПК-7.3; ПК-8.2; ПК-8.3; ПК-9.1; ПК-9.4
5	4	Инновации на финансовых рынках 1 Структурированные продукты. 2 Кредитные деривативы. 3 Роботизированная торговля.	20	УО	УК-1.1; УК-1.2; УК-1.3; УК-1.4; УК-2.1; УК-2.2; УК-2.5; УК-6.1; ПК-7.2; ПК-7.3; ПК-8.2; ПК-8.3; ПК-9.1; ПК-9.4

8.2 Лабораторные занятия

Лабораторные работы не предусмотрены.

8.3 Курсовая работа

Студенты выполняют курсовую работу по темам представленным ниже. Курсовая работа имеет следующую структуру: введение, три главы, заключение, список литературы. В введении раскрывается актуальность темы, ставится цель, определяются задачи, указываются методы исследования. В первой главе обобщаются теоретические аспекты по выбранной тематике. Вторая глава носит практический характер. Следует на основе цифрового материала в табличной и графической форме исследовать выбранный вопрос и дать оценку современного состояния. В третьей главе предлагаются направления и перспективы развития по выбранной тематике. В заключении делаются выводы по всей курсовой работе. Список литературы должен содержать не менее 15 наименований. Оформляется работа в соответствии с требованиями.

Тематика курсовых работ

1. Финансовый рынок: структура, роль в макро- и микроэкономике, участники
2. Фундаментальные факторы, воздействующие на финансовые рынки.
3. Финансовая глобализация: сущность, формы проявления, тенденции.

4. Сравнительная характеристика финансовых систем.
5. Проблема информационных асимметрий на финансовом рынке и ее решение в различных типах финансовых систем.
6. Риски на финансовом рынке.
7. Секьюритизация финансовых активов: мировой опыт и перспективы на российском фондовом рынке.
8. Современное состояние, структура и тенденции развития мирового финансового рынка.
9. Ключевые проблемы развития российского финансового рынка и методы их решения.
10. Перспективы формирования мирового финансового центра в России
11. Финансовые кризисы и пузыри
12. Профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг и ее виды
13. Профессиональные участники рынка ценных бумаг
14. Операции коммерческих банков с ценными бумагами
15. Инвестиционный банк: понятие, структура, требования к деятельности
16. Эмитенты и инвесторы на рынке ценных бумаг и их виды
17. Российский рынок акций: эволюция, современное состояние и перспективы развития
18. Рынок корпоративных облигаций в России
19. Рынок государственных и муниципальных ценных бумаг в России: структура, механизм выпуска и обращения ценных бумаг, риски
20. Ипотечные облигации: зарубежный опыт и перспективы на российском рынке
21. Рынок евробумаг: структура, механизм эмиссии, операции
22. Использование депозитных и сберегательных сертификатов коммерческих банков в российской и зарубежной практике
23. Товарораспорядительные ценные бумаги: российский и зарубежный опыт
24. Российские ценные бумаги на международных финансовых рынках
25. Вексель: этапы развития, область, масштабы и технологии использования на современном финансовом рынке.
26. Финансовое посредничество на финансовом рынке.
27. Современное состояние и роль финансового рынка в России
28. Развитие секьюритизации в России
29. «Экзотические» производные финансовые инструменты.

9 САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА

Самостоятельная работа проводится с целью освоения знаний и умений по дисциплине и предусматривает:

- ознакомление и проработку рекомендованной литературы, работу с электронно-библиотечными системами, включая переводы публикаций из научных журналов, цитируемых в базах Web of Science, Scopus, Chemical Abstracts, РИНЦ;

- посещение отраслевых выставок и семинаров;

- участие в семинарах, конференциях, проводимых в Институте по тематике дисциплины;

- подготовку к выполнению тестов и контрольных работ по материалу лекционного курса;

- подготовку к защите курсовой работы и сдаче экзамена по дисциплине.

Планирование времени на самостоятельную работу, необходимого на изучение дисциплины, студентам надо осуществлять на весь период изучения, предусматривая при этом регулярное повторение пройденного материала. Материал, законспектированный на лекциях, необходимо регулярно дополнять сведениями из литературных источников, представленных в рабочей программе. При работе с указанными источниками рекомендуется составлять краткий конспект материала, с обязательным фиксированием библиографических данных источника.

10 ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ

10.1 Текущий контроль успеваемости, обеспечивающий оценивание хода освоения дисциплины

Для оценивания результатов обучения в виде знаний текущий контроль организуется в формах:

- устного опроса (фронтальной беседы, индивидуального опроса, докладов);
- проверки решения задач на практических занятиях (использование формул);
- тестирования (бланкового).

Для оценивания результатов обучения в виде умений и навыков (владений) текущий контроль организуется в форме проверки контрольной работы (решения простых и/или сложных практико-ориентированных заданий).

Отдельно оцениваются личностные качества студента (аккуратность, исполнительность, инициативность) – работа у доски, своевременная сдача тестов и контрольной работы.

Критерии для оценивания устного опроса

Оценка «отлично» выставляется в случае, если студент свободно оперирует приобретенными знаниями, умениями, применяет их в ситуациях повышенной сложности.

Оценка «хорошо» выставляется в случае, если студент оперирует приобретенными знаниями, умениями, применяет их в стандартных ситуациях, но допускает незначительные ошибки, неточности, затруднения при аналитических операциях, переносе знаний и умений на новые, нестандартные ситуации.

Оценка «удовлетворительно» выставляется в случае, если студент допускает существенные ошибки, проявляет отсутствие знаний, умений, по отдельным темам (не более 1/3), испытывает значительные затруднения при оперировании знаниями и умениями при их переносе на новые ситуации.

Оценка «неудовлетворительно» выставляется в случае, если студент демонстрирует полное отсутствие или явную недостаточность (менее 1/3) знаний, умений в соответствии с планируемыми результатами обучения.

Критерии для оценивания компьютерного тестирования

Оценка «отлично» выставляется, если студент правильно ответил на 90% вопросов теста.

Оценка «хорошо» выставляется, если студент правильно ответил на 75-89% вопросов теста.

Оценка «удовлетворительно» выставляется, если студент правильно ответил на 60-74% вопросов теста.

Оценка «неудовлетворительно» выставляется, если студент правильно ответил менее, чем на 60% вопросов теста.

Критерии для оценивания бланкового тестирования

Оценка «отлично» выставляется, если студент правильно ответил на 90% вопросов теста.

Оценка «хорошо» выставляется, если студент правильно ответил на 75-89% вопросов теста.

Оценка «удовлетворительно» выставляется, если студент правильно ответил на 60-74% вопросов теста.

Оценка «неудовлетворительно» выставляется, если студент правильно ответил менее, чем на 60% вопросов теста.

Критерии для оценивания курсовой работы

По данной дисциплине студентом подготавливается курсовая работа. Тема курсовой работы определяется преподавателем и утверждается приказом.

Курсовая работа – индивидуальная письменная, самостоятельно выполненная, работа обучающегося, предполагающая анализ изложения в научных и других источниках определенной научной проблемы или вопроса и выполнения двух индивидуальных заданий. Обычно курсовая работа имеет стандартную структуру: титульный лист, лист задания, содержание, введение, основное содержание темы, выполнение обоих расчетных заданий, заключение, список использованных источников, приложения.

Оценивание курсовой работы осуществляет преподаватель. Оценивается оригинальность курсовой работы, системность излагаемого материала, логика изложения и убедительность аргументации, правильность выполнения расчетных заданий, полнота использованных источников, оформление, своевременность срока сдачи, публичная защита курсовой работы.

Оценка «отлично» выставляется в случае, если студент выполнил все требования к написанию курсовой работы: обозначена проблема и обоснована её актуальность, сделан краткий анализ различных точек зрения на рассматриваемую проблему и логично изложена собственная позиция, сформулированы выводы, тема раскрыта полностью, в полном объеме выполнены расчетные задания, выдержан объём, соблюдены требования к внешнему оформлению.

Оценка «хорошо» выставляется в случае, если студент выполнил основные требования к курсовой работы, но при этом допустил недочёты: имеются неточности в изложении материала; отсутствует логическая последовательность в суждениях и правильности выполнения курсовой работы; не выдержан объём курсовой работы; имеются упущения в оформлении.

Оценка «удовлетворительно» выставляется в случае, если студент существенно отступил от требований к курсовой работы: тема освещена лишь частично; допущены фактические ошибки в содержании курсовой работы и выполнения расчетных заданий; отсутствует вывод.

Оценка «неудовлетворительно» выставляется в случае, если тема курсовой работы не раскрыта, расчетные задания не выполнены, обнаруживается существенное непонимание проблемы.

Курсовая работа, сданная студентом после окончания текущего семестра, не оценивается.

10.2 Промежуточная аттестация

Промежуточная аттестация обучающихся – оценивание промежуточных результатов обучения по дисциплине. Промежуточная аттестация осуществляется в форме защиты курсовой работы и экзамена.

Контроль результатов обучения по дисциплине проводится в форме письменно-устных ответов на билеты. Перечень вопросов и форма билета доводятся до сведения обучающегося накануне контроля.

На подготовку к ответу обучающемуся отводятся не менее 1 академического часа. Возможен досрочный ответ.

Билеты включают два теоретических вопроса и задачу. Трудоемкость заданий каждого билета примерно одинакова.

10.3 Оценивание результатов обучения

Показатели оценивания сформированности компетенции (части компетенции) по дисциплине

Сформированность знаний	Сформированность умений	Сформированность навыков и (или) опыта деятельности
полнота, глубина, осознанность	результативность, правильность, прочность, последовательность, рефлексивность	качественность, скорость, автоматизм, редуцированность действий

10.3.1 Шкала оценки и критерии уровня сформированности компетенции (части компетенции) по дисциплине при текущем контроле

Показатели текущего контроля	Уровень сформированности компетенции		
	высокий	пороговый	не сформирована
Тестирование	с оценкой* «отлично» или «хорошо».	с оценкой «удовлетворительно»	с оценкой «неудовлетворительно»
Выполнение контрольной работы	с оценкой* «отлично» или «хорошо».	с оценкой «удовлетворительно»	с оценкой «неудовлетворительно» или не выполнены
Решение задач на практических занятиях	в полном объеме с высоким качеством	в полном объеме	не выполнены в полном объеме ко времени контроля
Выполнение курсовой работы	в полном объеме с высоким качеством	в полном объеме	не выполнены в полном объеме ко времени контроля
Использование основной и дополнительной литературы	использует самостоятельно	по указанию преподавателя	не использует

*Критерии оценивания указаны в описании теста

10.3.2. Шкала оценивания уровня сформированности компетенций при промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

Показатели оценки (дескрипторы)	Уровень сформированности компетенции			
	высокий		пороговый	не сформирована
	оценка «отлично»	оценка «хорошо»	оценка «удовлетворительно»	оценка «неудовлетворительно»
1. Уровень усвоения материала, предусмотренного программой.	Демонстрирует полное понимание проблемы.	Демонстрирует понимание проблемы.	Демонстрирует понимание проблемы.	Демонстрирует непонимание проблемы.
2. Уровень выполнения заданий, предусмотренных программой.	Все требования, предъявляемые к заданию выполнены.	Большинство требований, предъявляемых к заданию выполнены.	В основном требования, предъявляемые к заданию, выполнены.	Задания не выполнены.
3. Уровень изложения (культура речи, аргументированность, уверенность).	Полные ответы на все теоретические вопросы.	Ответы по существу на все теоретические вопросы.	Ответы по существу на все теоретические вопросы, но не имеется доказательств, выводов, обоснований.	Ответы менее чем на половину теоретических вопросов.
4. Уровень использования справочной литературы.	Практические задания выполнены в полном объеме.	Практические задания выполнены.	Намечены схемы решения предложенных практических заданий	Решение практических заданий не предложено.
5. Уровень раскрытия причинно-следственных связей.	Получены правильные значения всех расчетных (определяемых) величин.	Допущена неточность в расчете (определении) расчетной величины.		
6. Ответы на вопросы: полнота, аргументированность, убежденность.				
7. Ответственное отношение к работе, стремление к достижению высоких результатов, готовность к дискуссии.				

Шкала используется при оценивании всех компетенций и индикаторов достижения компетенций, предусмотренных данной программой дисциплины.

10.4 Оценочные материалы для текущего контроля

Задачи для практических занятий

1. Инвестор приобрел 35 акций по курсу 135 руб. при рыночной цене 108 руб. и продал их через три года после приобретения до даты выплаты дивидендов. За первый год ставка дивидендов составила 7%, за второй год – 11%, за третий год – 14%. Определите текущую доходность за каждый год и конечную доходность в расчете на год, если известно, что цена продажи акции по отношению к цене приобретения составляет 1,3.

2. Рассчитайте размер дивидендов и текущую доходность по обыкновенным акциям, если известно, что:

- 1) прибыль АО, направляемая на выплату дивидендов, составляет 5 млн. руб.;
- 2) акции выпущены на сумму 3500 тыс. руб., из них на 500 тыс. руб. привилегированных с дивидендом, равным 120 % к номиналу;
- 3) номинальная стоимость обыкновенных акций составляет 300 руб.

3. Инвестор приобрел акцию по курсу 150 руб. Через 2 года он продал акцию по цене 600 руб. после получения дивидендов в размере 200% годовых.

Определите текущую доходность за 1-й и 2-й год владения акциями, номинальную стоимость акции и по какой цене инвестор ее купил, если известно, что совокупная доходность его операций составила 170 %.

4. Инвестор приобрел 120 акций компании А номинальной стоимостью 10 руб. по цене 500 руб. за акцию. Через 10 дней он купил 150 акций компании В по цене 320 руб. за акцию. Еще через 10 дней купил 210 акций компании А по цене 540 руб. за акцию. Определите совокупную доходность операций инвестора, если известно, что через год он продал все акции компании А по цене 530 руб. за акцию, а акции компании В – по цене 343 руб. за акцию и при этом получил дивиденды по акциям компании В в размере 5 руб. за акцию, а по акциям компании А доходность составила 250%.

5. Структура и функции органов государственного регулирования рынка ценных бумаг России. Заполнить таблицу.

№ п/п	Орган регулирования	Осуществляемые функции
1	Федеральное собрание	
2	Президент РФ	
3	Администрация Президента РФ	
4	Федеральная комиссия РФ по рынку ценных бумаг	
5	Министерство Финансов	
6	Центральный Банк РФ	
7	Министерство имущественных отношений РФ	
8	Российский фонд федерального имущества	
9	Государственный комитет по антимонопольной политике	
10	Министерство экономического развития и торговли РФ	
11	Министерство по налогам и сборам РФ	
12	Министерство социальной защиты населения РФ	
13	Государственный таможенный комитет РФ	

6. Товар стоимостью 1,5 тыс. ден. ед. поставлен под выпуск векселя со сроком оплаты через 45 дней. Какова должна быть сумма, указанная в векселе, если продавец установил ставку за предоставляемый кредит в размере 25 % годовых?

7. Вексель на сумму S, равную 20000 ден. ед., с датой погашения 27 ноября 2011 г. был учтен банком 11 августа 2011 г. по простой учетной ставке d, равной 12 % годовых. Продолжительность года K равна 365 дням. Определить сумму, выплаченную при учете векселя банком.

8. Определите сумму, уплачиваемую при индоссаменте векселя, если он выписан на 15 тыс. ден. ед., срок наступления платежа — 120 дней, ставка предоставляемого кредита — 20 % годовых.

9. Вексель на сумму 16 млн ден. ед. передается банку за четыре месяца до истечения срока. Какая сумма будет уплачена держателю векселя, если учетная ставка равна 3 %?

10. Рассчитайте цену трехмесячного финансового фьючерса, если рыночная процентная ставка равна 14 % годовых, затраты на хранение — 3 % годовых, доход базового актива — 11 % годовых, цена товара на спотовом рынке равна 1700 руб.

11. В нижеприведенной таблице представлены данные о доходности актива за прошедшие 10 лет.

Годы	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
Доходность, %	10	14	10	8	-5	-3	3	7	12	13

Определите ожидаемую доходность актива.

Ниже представлены примеры вопросов и заданий для текущего контроля и оценивания окончательных результатов изучения дисциплины. Полный текст всех вопросов и заданий для текущего контроля и промежуточной аттестации приведен в ФОС.

Вопросы (задания), включаемые в тесты

Критерии оценивания бланкового тестирования приведены в разделе 10.1.

Пример вопросов теста по теме: «Рынок производных финансовых инструментов» (Т1)

Тестовые задания

1 вариант

1 Финансовый рынок – это:

- а) механизм, обеспечивающий распределение и перераспределение денежных средств между участниками финансовых отношений;
- б) совокупность экономических отношений между продавцом и эмитентом по поводу выпуска и покупки ценных бумаг;
- в) совокупность экономических отношений по поводу выпуска и обращения ценных бумаг между его участниками;
- г) место, где продаются акции и облигации.

2 Рынок, на котором осуществляется купля-продажа ценных бумаг, только что выпущенных в обращение, называется:

- а) основным;
- б) традиционным;
- в) биржевым;
- г) первичный.

3 Рынок, на котором происходит торговля ценными бумагами, минуя фондовую биржу, называют:

- а) компьютеризированным;
- б) неорганизованным;
- в) внебиржевым;
- г) традиционным.

4 Биржевой рынок НЕ может быть:

- а) организованным;
- б) традиционным;
- в) неорганизованным;
- г) компьютеризированным.

5 Ценная бумага – это:

- а) документ, удостоверяющий право его владельца требовать исполнения определенных обязательств со стороны лица, выпустившего ценную бумагу;
- б) эмиссионная ценная бумага, дающая право ее владельцу на получение дохода;
- в) документ, составленный с соблюдением установленной формы и реквизитов и удостоверяющий право на получение дохода;
- г) форма существования капитала, представляющая собой его товарную форму, которая может передаваться вместо него самого, обращаться на рынке как товар и приносить доход.

6 Ценная бумага, в основе которой лежат имущественные права на какой-либо актив, называется:

- а) первичной;
- б) производной;
- в) основной;
- г) вторичной.

7 Ценная бумага, имя владельца которой зафиксировано на ее бланке или в реестре собственников, называется:

- а) именной;
- б) предъявительской;
- в) ордерной;
- г) государственной.

8 В зависимости от формы вложения средств ценные бумаги различают:

- а) титулы собственности, долговые;
- б) государственные, корпоративные;
- в) рискованные, безрисковые;
- г) инвестиционные, неинвестиционные.

9 Какая ценная бумага отражает отношение займа между владельцем и эмитентом, который обязуется выкупить ценную бумагу и выплатить доход:

- а) акция;
- б) рисковая;
- в) безрисковая;
- г) долговая.

10 Какая из перечисленных ценных бумаг по российскому законодательству НЕ относится к эмиссионным:

- а) акция;
- б) государственная облигация;
- в) вексель;
- г) корпоративная облигация.

Критерии для оценивания тестов

Оценка «отлично» выставляется, если студент правильно ответил на 90% вопросов теста.

Оценка «хорошо» выставляется, если студент правильно ответил на 75-89% вопросов теста.

Оценка «удовлетворительно» выставляется, если студент правильно ответил на 60-74% вопросов теста.

Оценка «неудовлетворительно» выставляется, если студент правильно ответил менее, чем на 60% вопросов теста.

Теоретические вопросы к экзамену

1. Сущность, виды и функции финансового рынка.
2. Место и роль финансового рынка в экономической системе страны.
3. Задачи и структура рынка ценных бумаг.
4. Понятие и виды финансовых институтов.
5. Участники рынка ценных бумаг.
6. Классификация видов ценных бумаг.
7. Организационно-правовая специфика рынка ценных бумаг в России.
8. Нормативные документы, регулирующие отношения на финансовых рынках.
9. Профессиональные участники рынка ценных бумаг.
10. История рынка ценных бумаг.
11. Денежный рынок.
12. Корпоративные ценные бумаги.
13. Государственные ценные бумаги.
14. Производные ценные бумаги.
15. Финансовые инструменты.
16. Спотовый финансовый рынок.
17. Фундаментальный и технический анализ фондового рынка.
18. Формирование портфеля ценных бумаг.
19. Кредитный рынок.
20. Возникновение, роль, развитие фондовой биржи.
21. Листинг.
22. Рынок золота.
23. Рынок капиталов.
24. Фондовый рынок.
25. Рынок ценных бумаг России.
26. Рынок полисов и пенсионных счетов.
27. Общая характеристика и классификация векселей.
28. Облигации: общая характеристика и классификация.
29. Акции и акционерные общества.
30. Цели и принципы государственного регулирования рынка ценных бумаг в РФ.
31. Инструменты страхового сегмента финансового рынка.
32. Ипотечный рынок.
33. Институты денежного рынка.
34. Порядок и процедура эмиссии ценных бумаг в РФ.
35. Срочные сделки с ценными бумагами (форвардные, фьючерсные и опционные контракты).
36. Организация биржевой торговли.
37. Инвестиционные институты.
38. Рынок производных финансовых инструментов.
39. Институты рынка ценных бумаг.

40. Инструменты фондового рынка.
41. Появление и развитие финансовых рынков
42. Понятие, свойства и функции производных финансовых инструментов
43. Технический анализ финансовых рынков
43. Саморегулируемые организации финансового рынка
44. Этика финансового рынка
45. Роль свопового дилера
46. Хеджирование с помощью опционов

Практические задания к экзамену

Задача 1. Дайте сравнительную характеристику посредников на прямом и розничном финансовом рынке. Определите на примере современного рынка ценных бумаг России структуру финансового рынка по первичным и вторичным видам рынка. Предложите пути улучшения структуры финансового рынка России. Сделайте выводы.

Задача 2. Проанализируйте динамику развития отдельных видов финансового рынка в России (денежного и срочного) за последние три года. Сделайте выводы.

Задача 3. Вексель на сумму 100 000 рублей учтён в банке по учётной ставке 30% годовых за три года до срока его погашения. Определите сумму, полученную предъявителем векселя по простой и сложной учётной ставке. Сделайте выводы.

Задача 4. Курс акций фирмы на 20 июня текущего года составлял; покупка – 95,00 рублей, продажа – 145,00 рублей. На 20 октября курс тех же акций составил: покупка - 160,00 рублей, продажа – 195 рублей. Определите доход, полученный от покупки акции 20 июня и её продажи 20 ноября, и доходность операции купли-продажи в виде эффективной годовой ставки процентов. Сделайте выводы.

Задача 5. Коммерческие банки используют при начислении сложных процентов на вклад сроком хранения 3 года номинальные ставки: 20% при начислении процентов ежемесячно и 30% при поквартальном начислении. Определите, в какой банк выгоднее вложить деньги на основе вычисления эффективных процентных ставок. Сделайте выводы.

Задание 6. Вклад 2875 руб. был положен в банк 12 марта 20__ года и востребован 25 декабря того же года. Ставка процентов банка составляла 15% годовых. Определить сумму процентных денег по простой ставке процентов.

Задача 8. В результате инвестирования суммы 900 000 рублей получены следующие поступления денежных средств: в конце первого года – 300 000 рублей, в конце второго года – 350 000 рублей, в конце третьего года – 450 000 рублей. Определите эффективность инвестиционной операции. Сделайте выводы.

Задача 9. Обязательство уплатить через 180 дней 9 000 рублей с начислением простых процентов по ставке 20% годовых по германской практике учтено в банке за 30 дней до срока погашения по простой учётной ставке 20% годовых. Определить сумму, полученную владельцем обязательства при его учёте. Сделайте выводы.

Задача 10. Рассчитать уровень маржи в процентах, требуемой брокерской конторой, если она покрывает ссудой 20 тыс. руб. Клиент покупает 100 акций компании X по цене 50 руб. за штуку. Сделайте выводы.

Задача 11. Инвестор обратился к брокеру фьючерсной биржи с заказом на заключение 3-х месячного фьючерсного контракта на индекс иностранной валюты по курсу ЦБ. Сумма по контракту 1000 единиц. Инвестор и брокер заключили договор - поручение на брокерское обслуживание. Определить финансовый результат по фьючерсной сделке.

Финансовые биржи организуют сделки с фьючерсами и опционами на ценные бумаги и на валюту. Маржа – разность между курсами валют на день открытия и закрытия позиций или на день заключения и исполнения договора.

Для фьючерса на покупку валюты:

$M = K (C_b - C_{пок})$, где M – величина маржи; K – объём сделки по фьючерсу (количество покупаемой валюты);

C_b – курс иностранной валюты на бирже;

Спок. – курс иностранной валюты на покупку в сделке по фьючерсу.

Для фьючерса на продажу валюты:

$$M = K (C_{пр} - C_б),$$

Спр – курс иностранной валюты на продажу в сделке по фьючерсу.

Задача 12. Банк принимает депозиты на полгода по ставке 30% годовых.

Определить реальные результаты от вложения для вклада 537 руб. при уровне инфляции за месяц 2%

При проведении расчётов может быть учтена инфляция – снижение покупательной способности денег. Инфляцию характеризуют уровнем (на сколько процентов выросли цены) и индексом (во сколько раз выросли цены).

Индекс инфляции (I_n) и уровень инфляции (t) связаны между собой соотношением:

$$I_n = 1 + t; t = I_n - 1$$

При использовании простых ставок процентов можно определить сумму вклада с учётом инфляции:

Сумма обесценивания денег будет равна разнице между первоначальной суммой вклада и суммой вклада с учётом инфляции. В кредитных операциях уровень инфляции может быть учтён при определении эффективной ставки процентов по кредиту.

Задача 13. На бирже предлагается опцион на покупку долларов США (опцион call) со следующими параметрами: сумма – 10 тыс. долларов США; срок – 3 месяца; страйк – цена: по курсу ЦБ на день решения задачи; премия 0,3 руб. за 1 доллар США; стиль – европейский. Определить финансовый результат по опционной сделке.

Валютный опцион представляет собой договор между двумя брокерами (дилерами). Опцион на покупку даёт владельцу право приобрести валюту, высоко оцениваемую рынком, по более низкому курсу и получить доход.

Этот доход оценивается:

$$D = (P_1 - P_2)n - Ц,$$

D – доход опциона на покупку;

P_1 – курс валюты на рынке на момент исполнения опциона (курс – спот);

P_2 – страйк – цена (опционный курс на покупку валюты); $Ц$ – премия опциона (цена опциона);

n – количество валюты, покупаемой по опциону.

Доход опциона на продажу:

$$D = Ц - (P_1 - P_0)n; 1000,$$

P_0 – страйк – цена (опционный курс на продажу валюты);

n – количество валюты, продаваемой по опциону.

Форма экзаменационного билета

Министерство образования и науки РФ
ФГБОУ ВО «Российский химико-технологический университет
имени Д.И. Менделеева»
Новомосковский институт (филиал)
Кафедра «Экономика, финансы и бухгалтерский учет»

УТВЕРЖДАЮ
Зав. кафедрой

подпись (Ф.И.О.)

Дисциплина
Направление
Направленность

СОВРЕМЕННЫЕ ИНСТРУМЕНТЫ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ
38.03.01 «ЭКОНОМИКА»
«ЭКОНОМИКА»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 1

- 1.
- 2.
- 3.

Лектор,

Фамилия И.О.

Критерии оценивания и шкала оценок по заданиям билета приведены в разделе 6.4.

10.6.1 Критерии оценивания и шкала оценок по заданиям экзаменационного билета

Оценка «отлично» выставляется в случае, если студент отвечает на все задания билета, свободно оперирует приобретенными знаниями, умениями, применяет их в ситуациях повышенной сложности.

Оценка «хорошо» выставляется в случае, если студент оперирует приобретенными знаниями, умениями, применяет их в стандартных ситуациях, но допускает незначительные ошибки, неточности, затруднения при аналитических операциях, переносе знаний и умений на новые, нестандартные ситуации.

Оценка «удовлетворительно» выставляется в случае, если студент допускает ошибки, проявляет отсутствие знаний, умений, по отдельным темам (не более 1/3), испытывает значительные затруднения при оперировании знаниями и умениями при их переносе на новые ситуации.

Оценка «неудовлетворительно» выставляется в случае, если студент демонстрирует полное отсутствие или явную недостаточность (менее 1/3) знаний, умений в соответствии с планируемыми результатами обучения.

10.6.2 Критерии оценивания и шкала оценок по защите курсовой работы

Оценка «отлично» выставляется в случае, если студент свободно оперирует приобретенными знаниями, умениями, применяет их в ситуациях повышенной сложности.

Оценка «хорошо» выставляется в случае, если студент оперирует приобретенными знаниями, умениями, применяет их в стандартных ситуациях, но допускает незначительные ошибки, неточности, затруднения при аналитических операциях, переносе знаний и умений на новые, нестандартные ситуации.

Оценка «удовлетворительно» выставляется в случае, если студент допускает существенные ошибки, проявляет отсутствие знаний, умений, по отдельным темам (не более 1/3), испытывает значительные затруднения при оперировании знаниями и умениями при их переносе на новые ситуации.

Оценка «неудовлетворительно» выставляется в случае, если студент демонстрирует полное отсутствие или явную недостаточность (менее 1/3) знаний, умений в соответствии с планируемыми результатами обучения.

11 МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

Организация образовательного процесса регламентируется учебным планом и расписанием учебных занятий. Язык обучения (преподавания) - русский. Для всех видов аудиторных занятий «час» устанавливается продолжительностью 45 минут. Зачетная единица составляет 27 астрономических часов или 36 академических час. Через каждые 45 мин контактной работы делается перерыв продолжительностью 5 мин, а после двух час контактной работы делается перерыв продолжительностью 10 мин.

Сетевая форма реализации программы дисциплины не используется.

Обучающийся имеет право на зачет результатов обучения по дисциплине, если она освоена им при получении среднего профессионального образования и (или) высшего образования, а также дополнительного образования (при наличии) (далее - зачет результатов обучения). Зачтенные результаты обучения учитываются в качестве результатов промежуточной аттестации в установленном в Институте порядке.

11.1 Образовательные технологии

Образовательный процесс при освоении дисциплины основывается на использовании традиционных, инновационных и информационных образовательных технологий. Возможна реализация ОПОП с применением электронного обучения и дистанционных образовательных технологий. Традиционные образовательные технологии представлены лекциями и семинарскими (практическими) занятиями. Инновационные образовательные технологии используются в виде применения активных и интерактивных форм проведения занятий. Информационные образовательные технологии реализуются путем активизации самостоятельной работы студентов в информационной образовательной среде. При проведении учебных занятий обеспечивается развитие у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств в том числе с учетом региональных особенностей профессиональной деятельности выпускников и потребностей работодателей).

11.2 Лекции

Лекционный курс предполагает систематизированное изложение основных вопросов содержания дисциплины.

На первой лекции лектор обязан предупредить студентов, применительно к какому базовому учебнику (учебникам, учебным пособиям) будет прочитан курс.

Лекционный курс обеспечивает более глубокое понимание учебных вопросов при значительно меньшей затрате времени, чем это требуется среднестатистическому студенту на самостоятельное изучение материала.

11.3 Занятия семинарского типа

Семинарские (практические) занятия представляют собой детализацию лекционного теоретического материала, направлены на отработку навыков, проводятся в целях закрепления курса и охватывают все основные разделы дисциплины.

Основной формой проведения семинаров и практических занятий является обсуждение наиболее проблемных и сложных вопросов по отдельным темам, а также решение задач и разбор примеров и ситуаций при контактной работе. В обязанности преподавателя входят: оказание методической помощи и консультирование студентов по соответствующим темам курса, ответы на вопросы, управление процессом решения задач.

Активность на практических занятиях оценивается по следующим критериям:

- ответы на вопросы, предлагаемые преподавателем;
- участие в дискуссиях;
- выполнение заданий (решение задач);

Доклады и оппонирование докладов проверяют степень владения теоретическим материалом, а также корректность и строгость рассуждений.

Оценивание практических заданий входит в оценку.

11.4 Самостоятельная работа студента

Для успешного усвоения дисциплины необходимо не только посещать аудиторные занятия, но и вести активную самостоятельную работу. При самостоятельной проработке курса обучающиеся должны:

повторить законспектированный на лекционном занятии материал и дополнить его с учетом рекомендованной по данной теме литературы;

изучить рекомендованную основную и дополнительную литературу, составлять тезисы, аннотации и конспекты наиболее важных моментов;

использовать для самопроверки материала оценочные средства.

Индивидуальное задание оценивается по следующим критериям:

- правильность выполнения задания;
- аккуратность в оформлении работы;
- использование специальной литературы;
- своевременная сдача выполненного задания (указывается преподавателем).

11.5 Методические рекомендации для преподавателей

Основные принципы обучения

1. Цель обучения – развить мышление, выработать мировоззрение; познакомить с идеями и методами науки; научить применять принципы и законы для решения простых и нестандартных экономических задач.

2. Обучение должно органически сочетаться с воспитанием. Нужно развивать в студентах волевые качества и трудолюбие. Ненавязчиво, к месту прививать элементы культуры поведения. В частности, преподаватель должен личным примером воспитывать в студентах пунктуальность и уважение к чужому времени. Недопустимо преподавание односеместровой учебной дисциплины превращать в многосеместровое. Возникшая академическая задолженность должна быть ликвидирована в период следующего семестра до начала зачетной недели.

3. Обучение должно быть не пассивным (сообщим студентам некоторый объем информации, расскажем, как решаются те или иные задачи), а активным. Нужно строить обучение так, чтобы в овладении материалом основную роль играла память логическая, а не формальная. Запоминание должно достигаться через глубокое понимание.

4. Одно из важнейших условий успешного обучения – умение организовать работу студентов.

5. Отношение преподавателя к студентам должно носить характер доброжелательной требовательности. Для стимулирования работы студентов нужно использовать поощрение, одобрение, похвалу, но не порицание (порицание может применяться лишь как исключение). Преподаватель должен быть для студентов доступным.

6. Необходим регулярный контроль работы студентов. Правильно поставленный, он помогает им организовать систематические занятия, а преподавателю достичь высоких результатов в обучении.

7. Важнейшей задачей преподавателей, ведущих занятия по дисциплине, является выработка у студентов осознания необходимости и полезности знания дисциплины как теоретической и практической основы для изучения профильных дисциплин.

8. С целью более эффективного усвоения студентами материала данной дисциплины рекомендуется при проведении лекционных, практических и лабораторных занятий использовать современные технические средства обучения, а именно презентации лекций, наглядные пособия в виде схем приборов, деталей и конструкций приборов, компьютерное тестирование.

9. Для более глубокого изучения предмета и подготовки ряда вопросов (тем) для самостоятельного изучения по разделам дисциплины преподаватель предоставляет студентам необходимую информацию о использовании учебно-методического обеспечения: учебниках, учебных пособиях, сборниках примеров и задач и описание лабораторных работ, наличии Интернет-ресурсов.

При текущем контроле рекомендуется использовать компьютерное или бланковое тестирование, контрольные коллоквиумы или контрольные работы.

Контрольное (итоговое) тестирование включает в себя задания по всем темам раздела рабочей программы дисциплины.

10. Цель лекции – формирование у студентов ориентировочной основы для последующего усвоения материала методом самостоятельной работы. Содержание лекции должно отвечать следующим дидактическим требованиям:

- изложение материала от простого к сложному, от известного к неизвестному;
- логичность, четкость и ясность в изложении материала;
- возможность проблемного изложения, дискуссии, диалога с целью активизации деятельности студентов;
- опора смысловой части лекции на подлинные факты, события, явления, статистические данные;
- тесная связь теоретических положений и выводов с практикой и будущей профессиональной деятельностью студентов.

Преподаватель, читающий лекционные курсы, должен знать существующие в педагогической практике варианты лекций, их дидактические и воспитывающие возможности, а также их место в структуре процесса обучения.

11. При проведении аттестации студентов важно всегда помнить, что систематичность, объективность, аргументированность – главные принципы, на которых основаны контроль и оценка знаний студентов. Знание критериев оценки знаний обязательно для преподавателя и студента.

11.6 Методические указания для студентов

По подготовке к лекционным занятиям

Изучение дисциплины требует систематического и последовательного накопления теоретических знаний, следовательно, пропуски отдельных тем не позволяют глубоко освоить предмет. Студентам необходимо:

- перед каждой лекцией просматривать рабочую программу дисциплины;
- перед следующей лекцией необходимо просмотреть по конспекту материал предыдущей.

При затруднениях в восприятии материала следует обратиться к основным литературным источникам. Если разобраться в материале не удалось, необходимо обратиться к лектору или к преподавателю на практических занятиях.

По подготовке к практическим занятиям

Цель практических занятий – углубление, расширение, детализация знаний, полученных на лекциях в обобщенной форме, содействие выработке умений использовать теоретический материал для решения практических задач в области изучаемой дисциплины и навыков, необходимых для формирования компетенций по дисциплине.

Студентам следует:

- проводить предварительную подготовку к практическому занятию, просматривая конспекты лекций, рекомендованную литературу, Интернет-ресурсы;
- приносить с собой рекомендованную преподавателем к конкретному занятию литературу;
- в начале занятий задать преподавателю вопросы по материалу, вызвавшему затруднения в ходе самостоятельной работы;
- соотносить теоретический материал с современным состоянием дел, так как в содержании предмета могут появиться изменения, дополнения, которые не всегда отражены в учебной литературе;
- доводить каждое задание до окончательного решения, демонстрировать понимание проведенных расчетов (анализов, ситуаций);
- в случае затруднений обращаться к преподавателю;
- в ходе устного опроса не отвлекаться, давать конкретные, четкие ответы по существу вопросов.

Студентам, пропустившим занятия (независимо от причин), или не выполнившим рассматриваемые на занятии задания, рекомендуется не позже, чем в двухнедельный срок явиться на консультацию к преподавателю и отчитаться по теме занятия.

По организации самостоятельной работы

Самостоятельная работа студентов включает в себя выполнение различного рода заданий, которые ориентированы на более глубокое усвоение материала изучаемой дисциплины. К выполнению заданий для самостоятельной работы предъявляются следующие требования: задания должны исполняться самостоятельно и представляться в установленный срок, а также соответствовать установленным требованиям по оформлению.

Студентам следует:

- руководствоваться планом контрольных пунктов, определенным рабочей программой дисциплины;
- выполнять все плановые задания, выдаваемые преподавателем для самостоятельного выполнения, и разбирать на семинарах и консультациях неясные вопросы;

- использовать при подготовке нормативные документы ВУЗа (требования к оформлению письменных работ и др.).

При решении задач целесообразно руководствоваться следующими правилами.

1. Прежде всего, нужно хорошо вникнуть в условие задачи, записать кратко ее условие.
2. Если позволяет характер задачи, обязательно сделать рисунок, поясняющий ее сущность.
3. За редкими исключениями, каждая задача должна быть сначала решена в общем виде (т.е. в буквенных обозначениях, а не в числах).
4. Получив числовой ответ, нужно оценить его правдоподобность. Такая оценка может в ряде случаев обнаружить ошибочность полученного результата.

Решение задач принесет наибольшую пользу только в том случае, если обучающийся решает задачи самостоятельно. Решить задачу без помощи, без подсказки часто бывает нелегко и не всегда удается. Но даже не увенчавшиеся успехом попытки найти решение, если они предпринимались достаточно настойчиво, приносят ощутимую пользу, так как развивают мышление и укрепляют волю. Решение задач ни в коем случае не следует откладывать на последний вечер перед занятиями, как, к сожалению, нередко поступают студенты. В этом случае более сложные и притом наиболее содержательные и полезные задачи заведомо не могут быть решены.

Курсовая работа – вид самостоятельной письменной работы, направленный на творческое освоение общепрофессиональных и профильных профессиональных дисциплин и выработку соответствующих профессиональных компетенций. Объем курсовой работы может достигать 30–50 с.; время, отводимое на ее написание – от 1–2 месяцев до семестра. В зависимости от объема времени, отводимого на выполнение задания, курсовая работа может иметь различную творческую направленность. При написании курсовой работы студент должен полностью раскрыть выбранную тему, соблюсти логику изложения материала, показать умение делать обобщения и выводы. Курсовая работа должна состоять из введения, основной части, заключения и списка использованной литературы. При оценке уровня выполнения курсовой работы, в соответствии с поставленными целями для данного вида учебной деятельности, могут контролироваться следующие умения, навыки и компетенции: умение работать с объектами изучения, критическими источниками, справочной и энциклопедической литературой; умение собирать и систематизировать практический материал; умение самостоятельно осмысливать проблему на основе существующих методик; умение логично и грамотно излагать собственные умозаключения и выводы; умение соблюдать форму научного исследования; умение пользоваться глобальными информационными ресурсами; владение современными средствами телекоммуникаций; способность и готовность к использованию основных прикладных программных средств; способность создать содержательную презентацию выполненной работы. При защите представленной курсовой работы целесообразно проводить оценивание знаниевой компоненты дисциплин, использованных при выполнении задания.

По работе с литературой

В рабочей программе дисциплины представлен список основной и дополнительной литературы – это учебники, учебно-методические пособия или указания. Дополнительная литература – учебники, монографии, сборники научных трудов, журнальные и газетные статьи, различные справочники, энциклопедии, Интернет-ресурсы.

Любая форма самостоятельной работы студента (подготовка к семинарскому занятию, докладу и т.п.) начинается с изучения соответствующей литературы как в библиотеке / электронно-библиотечной системе, так и дома. Изучение указанных источников расширяет границы понимания предмета дисциплины.

При работе с литературой выделяются следующие виды записей. Конспект – краткая схематическая запись основного содержания научной работы. Целью является не переписывание произведения, а выявление его логики, системы доказательств, основных выводов. Хороший конспект должен сочетать полноту изложения с краткостью. Цитата – точное воспроизведение текста. Заключается в кавычки. Точно указывается страница источника. Тезисы – концентрированное изложение основных положений прочитанного материала. Аннотация – очень краткое изложение содержания прочитанной работы. Резюме – наиболее общие выводы и положения работы, ее концептуальные итоги.

Учебно-методическое обеспечение для самостоятельной работы студентов по дисциплине

Учебно-методическое обеспечение для самостоятельной работы студентов по дисциплине

Раздел 1. Сущность, роль и функции финансовых рынков в экономике

Вопросы для самопроверки:

- 1 Товары финансового рынка.
- 2 Понятие финансовых инструментов.
- 3 Структура финансовых рынков.
- 4 Сегментирование финансовых рынков с точки зрения типа финансового актива: кредитный рынок, рынок ценных бумаг, страховой рынок, валютный рынок, рынок драгоценных металлов.

- 6 Регулирующие и контролирующие организации.
- 7 Особый класс участников финансовых рынков?
- 8 финансовые посредники.
- 9 Необходимость финансовых посредников на финансовых рынках.
- 10 Функции финансовых посредников. Классификация финансовых посредников.
11. Каким образом организованы взаимоотношения продавцов и покупателей на финансовом рынке?
12. Назовите основные особенности финансового рынка?

Задания для самостоятельной работы:

- 1 Самостоятельное изучение основной и дополнительной литературы.
- 2 Конспектирование основных моментов или запись тезисов по прочитанному материалу.

Раздел 2. Рынок производных финансовых инструментов

Вопросы для самопроверки:

1. Инструменты денежного рынка.
2. Инструменты рынка капиталов.
3. Рынок производных финансовых инструментов.
4. Какая основная функция производных ценных бумаг на РЦБ?
5. Инструменты фондового рынка.
6. Основные группы производных финансовых инструментов?

Задания для самостоятельной работы:

- 1 Самостоятельное изучение основной и дополнительной литературы.
- 2 Конспектирование основных моментов или запись тезисов по прочитанному материалу.

Раздел 3. Регулирование финансовых рынков

Вопросы для самопроверки:

1. Модель мегарегулятора, ее преимущества и недостатки.
2. Три направления регулирования финансовых рынков: пруденциальный надзор, регулирование бизнес-поведения, обеспечение финансовой стабильности.
3. Нормативные документы, регулирующие отношения на финансовых рынках.
4. Интеграция финансового регулирования.

Задания для самостоятельной работы:

- 1 Самостоятельное изучение основной и дополнительной литературы.
- 2 Конспектирование основных моментов или запись тезисов по прочитанному материалу.

Раздел 4. Инновации на финансовых рынках

Вопросы для самопроверки:

1. Что такое финансовая инновация?
2. Как влияет глобализация и интернационализация на развитие финансовых рынков?
3. Влияние процессов секьюритизации на структуру финансовых рынков.
4. Как скажутся на развитии финансового рынка социальные факторы?

Задания для самостоятельной работы:

- 1 Самостоятельное изучение основной и дополнительной литературы.
- 2 Конспектирование основных моментов или запись тезисов по прочитанному материалу

11.7 Особенности организации образовательного процесса для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья

Профессорско-преподавательский состав знакомится с психолого-физиологическими особенностями обучающихся инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья, индивидуальными программами реабилитации инвалидов (при наличии). При необходимости осуществляется дополнительная поддержка преподавания психологами, социальными работниками, прошедшими подготовку ассистентами.

Предполагается использовать социально-активные и рефлексивные методы обучения, технологии социокультурной реабилитации с целью оказания помощи в установлении полноценных межличностных отношений с другими студентами, создании комфортного психологического климата в студенческой группе. Подбор и разработка учебных материалов производятся с учетом предоставления материала в различных формах: аудиальной, визуальной, с использованием специальных технических средств и информационных систем.

Освоение дисциплины лицами с ОВЗ осуществляется с использованием средств обучения общего и специального назначения (персонального и коллективного использования).

Для студентов с ОВЗ предусматривается доступная форма предоставления заданий оценочных средств, а именно:

- в печатной или электронной форме (для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата);
 - в печатной форме или электронной форме с увеличенным шрифтом и контрастностью (для лиц с нарушениями слуха, речи, зрения);
 - методом чтения ассистентом задания вслух (для лиц с нарушениями зрения).
- Студентам с инвалидностью увеличивается время на подготовку ответов на контрольные вопросы. Для таких студентов предусматривается доступная форма предоставления ответов на задания, а именно:
- письменно на бумаге или набором ответов на компьютере (для лиц с нарушениями слуха, речи);
 - выбором ответа из возможных вариантов при тестировании с использованием услуг ассистента (для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата);
 - устно (для лиц с нарушениями зрения, опорно-двигательного аппарата).
- При необходимости для обучающихся с инвалидностью процедура оценивания результатов обучения может проводиться в несколько этапов.

12 УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Информационную поддержку освоения дисциплины осуществляет библиотека Института, которая обеспечивает обучающихся основной учебной, учебно-методической и научной литературой, необходимой для организации образовательного процесса по дисциплине. Общий объем многоотраслевого фонда на 01.03.2021 г составляет более 405 000 экз.

Библиотека располагает учебной, учебно-методической и научно-технической литературой в форме печатных и электронных изданий, а также включает официальные, справочно-библиографические, специализированные отечественные и зарубежные периодические и информационные издания. Библиотека обеспечивает доступ к профессиональным базам данных, информационным, справочным и поисковым системам.

Каждый обучающийся обеспечен свободным доступом из любой точки, в которой имеется доступ к сети Интернет и к электронно-библиотечной системе (ЭБС) Института и Университета, которая содержит различные издания по основным изучаемым дисциплинам и сформирована по согласованию с правообладателями учебной и учебно-методической литературы.

Полный перечень электронных информационных ресурсов, используемых в процессе обучения, представлен в основной образовательной программе.

12.1 Перечень основной и дополнительной литературы, необходимой для освоения дисциплины

а) основная литература

Основная литература	Режим доступа	Обеспеченность
О-1. Иванченко, И. С. Производные финансовые инструменты: оценка стоимости деривативов : учебник для вузов / И. С. Иванченко. — Москва: Издательство Юрайт, 2019. — 261 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-11386-0. — Текст: электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. https://www.urait.ru/bcode/445194	Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/433417 .	Да
О-2 Рынок ценных бумаг : учебник для вузов / Н. И. Берзон [и др.] ; под общей редакцией Н. И. Берзона. — 5-е изд., перераб. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2021 — 514 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-11196-5. — Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/468351 .	Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/433417 .	Да

б) дополнительная литература

Дополнительная литература	Режим доступа	Обеспеченность
Д-1. Гусева, И. А. Финансовые рынки и институты : учебник и практикум для академического бакалавриата / И. А. Гусева. — Москва : Издательство Юрайт, 2019 — 347 с. — (Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-00339-0. — Текст : электронный Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/433417 .	Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/433417 .	Да
Д-2. Никитина, Т. В. Финансовые рынки и институты. Краткий курс : учебник и практикум для вузов / Т. В. Никитина, А. В. Репета-Турсунова. — 3-е изд., испр. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2022 — 97 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12443-9. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/490688	Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/490688	Да

*Договор № 33.03-Л-3.1-4377/2022 на оказание услуг по предоставлению доступа к образовательной платформе «Юрайт» ИКЗ 22 1770707263777070100100040015814244 от 16.03.2022г., срок действия с 16.03.2022 по 15.03.2023г.

12.2 Информационно-образовательные ресурсы, профессиональные базы данных и информационные справочные системы

При освоении дисциплины студенты должны использовать информационные и информационно-образовательные ресурсы следующих порталов и сайтов:

1 Экономические науки: научно-информационный журнал. Режим доступа: <http://ecsn.ru/> (дата обращения 01.06.2022).

2 Единое окно доступа к образовательным ресурсам: бесплатная электронная библиотека. Режим доступа: <http://window.edu.ru/> (дата обращения: 01.06.2022).

3 Информационный портал «EREPORT.RU: мировая экономика». Режим доступа: <http://www.ereport.ru/stat.php> (дата обращения 01.06.2022).

4 Библиотека НИ РХТУ им. Д.И. Менделеева / Официальный сайт НИ РХТУ им. Д.И. Менделеева. Режим доступа: <http://www.nirhtu.ru/administration/library/elibrary.html> (дата обращения 01.06.2022).

5 Кафедра «Экономика, финансы и бухгалтерский учет» / Официальный сайт НИ РХТУ им. Д.И. Менделеева. Режим доступа: <http://www.nirhtu.ru/faculties/economics/efibu.html> (дата обращения 01.06.2022).

6. Федеральная служба государственной статистики: официальный сайт. Режим доступа: <http://www.gks.ru>

7. www.budget.ru – Финансовое казначейство РФ

8. www.cbr.ru (Центральный Банк Российской Федерации)

9. www.cea.gov.ru (Центр экономической конъюнктуры при правительстве РФ)

10. www.minfin.ru – Министерство финансов РФ

11. www.akm.ru (Агентство АК&М)

12. Образовательная платформа <http://www.urait.ru>

13 МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, а также помещения для самостоятельной работы обучающихся, оснащенные компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспеченные доступом в электронную информационно-образовательную среду Института.

Наименование специальных помещений и помещений для самостоятельной работы	Оснащенность специальных помещений и помещений для самостоятельной работы	Приспособленность помещений для использования инвалидами и лицами с ОВЗ
Лекционная аудитория (ауд.212)	Учебная мебель (столы стулья, доска), переносная презентационная техника (ноутбук, проектор, экран - постоянное хранение в ауд. 215).	приспособлено*
Аудитория для проведения занятий семинарского типа (ауд. 212)	Учебная мебель (столы стулья, доска), переносная презентационная техника (ноутбук, проектор, экран - постоянное хранение в ауд. 215).	приспособлено*
Аудитория для групповых и индивидуальных консультаций обучающихся (ауд.212)	Учебная мебель (столы стулья, доска), переносная презентационная техника (ноутбук, проектор, экран - постоянное хранение в ауд. 215).	приспособлено*
Аудитория для текущего контроля и промежуточной аттестации (ауд.212)	Учебная мебель (столы стулья, доска), переносная презентационная техника (ноутбук, проектор, экран - постоянное хранение в ауд. 215).	приспособлено*
Аудитория для самостоятельной работы студентов (ауд. 222)	Учебная мебель. Компьютеры в сборке (2 шт.) с возможностью просмотра видеоматериалов и презентаций, доступом к сети «Интернет», электронным образовательным и информационным ресурсам, базе данных электронного каталога НИ РХТУ, системе управления учебными курсами Moodle. Принтер.	приспособлено*

	Многофункциональное устройство (принтер, сканер, копир).	
--	--	--

* Для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья есть возможность проводить лекционные занятия и занятия семинарского типа на 1-ых этажах учебных корпусов. Возле входных дверей в учебные корпуса установлен звонок в дежурную сотруднику. Предусмотрены широкие дверные проемы. Имеются специализированные кабинеты для самостоятельной и индивидуальной работы, оснащенные ПК.

Технические средства обучения, служащие для предоставления учебной информации большой аудитории

Ноутбук с возможностью просмотра видеоматериалов и презентаций, доступом к сети «Интернет», электронным образовательным и информационным ресурсам, базе данных электронного каталога Института, системе управления учебными курсами Moodle.

Проектор, экран.

Программное обеспечение

1 Операционная система MS Windows XP и MS Windows 7 бессрочные права и бессрочная лицензия по подписке Microsoft Imagine Premium, идентификатор подписки: a936248f-3805-4c6a-a64f-8c344976ef6d, идентификатор подписчика: ICM-164914.

2 Интернет-браузер Mozilla Firefox. Распространяется под лицензией Mozilla Public License 2.0 (MPL).

3 Текстовый редактор LibreOffice Writer. Распространяется под лицензией LGPLv3.

4 MS Excel из пакета MS Office 365 A1 бесплатная веб-версия Office <https://products.office.com/ru-ru/academic/compare-office-365-education-plans> для учащихся, преподавателей и сотрудников.

5 Редактор презентаций LibreOffice Impress. Распространяется под лицензией LGPLv3.

6 Средство чтения файлов PDF Adobe Acrobat Reader DC является бесплатным и доступно для корпоративного распространения (<https://acrobat.adobe.com/ru/ru/acrobat/pdf-reader/volume-distribution.html>).

7 Архиватор 7zip (распространяется под лицензией GNU LGPL license)

Печатные и электронные образовательные и информационные ресурсы

Информационно-методические материалы: учебные издания по дисциплине.

Электронные образовательные ресурсы: электронные презентации к разделам лекционного курса; учебно-методические разработки в электронном виде; справочные материалы в электронном виде; кафедральная библиотека электронных изданий.

АННОТАЦИЯ
рабочей программы дисциплины
Б1.В.04 «Современные инструменты финансовых рынков»

1 Общая трудоемкость (з.е./ час): 6/216. Контактная работа 18.4 часов, из них: лекционные 6, практические занятия 12. Самостоятельная работа студента 189 часов. Форма промежуточного контроля: курсовая работа, экзамен. Дисциплина изучается на 4 курсе в 8 семестре.

2 Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина реализуется в рамках части, формируемой участниками образовательных отношений ОПОП. Для освоения дисциплины необходимы знания, умения и компетенции, полученные студентами в ходе освоения следующих дисциплин: «Страхование коммерческих и финансовых рисков»

3 Цель и задачи изучения дисциплины

Целью освоения дисциплины «Современные инструменты финансовых рынков» является формирование у студентов глубоких и качественных профессиональных знаний в области теоретических основ и практических аспектов функционирования системы финансовых рынков и рынка производных финансовых инструментов, представляющих собой составные компоненты финансового рынка.

Задачи преподавания дисциплины:

- исследование системы действующих на рынке финансовых инструментов;
- приобретения практических навыков по оценке инвестиционной привлекательности вложения средств;
- использовать полученные знания для консультирования клиента по выбору вида финансовой услуги и поставщика финансовой услуги;
- формирование умений и навыков составления аналитической отчетности об оказании финансовых услуг;
- использование системы знаний о принципах и особенностях применения различных инструментов управления финансовыми рисками;
- определение круга методических проблем управления рисками в рамках индивидуального финансового планирования.

4 Содержание дисциплины

Основные понятия финансового рынка и методы его исследования. Инфраструктура и участники финансового рынка. Рынок производных финансовых инструментов. Развитие финансового рынка в РФ. Рынок ссудного капитала – важнейшая составная часть финансового рынка. Механизм функционирования и современные инструменты финансовых рынков.

Финансовый инжиниринг. Финансово-кредитные институты как основные участники финансовых рынков. Современные тенденции развития финансово-кредитных институтов. Регулирование финансовых рынков: принципиальные подходы и опыт разных стран. Инновации на финансовых рынках.

5. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов освоения образовательной программы

В результате освоения ОПОП бакалавриата обучающийся должен овладеть следующими компетенциями и индикаторами достижения компетенций:

Способен осуществлять поиск, критический анализ и синтез информации, применять системный подход для решения поставленных задач (УК-1):

- анализирует задачу, выделяя её базовые составляющие. Определяет, интерпретирует и ранжирует информацию, требуемую для решения поставленной задачи (УК-1.1);
- осуществляет поиск информации для решения поставленной задачи по различным типам запросов (УК-1.2);
- при обработке информации отличает факты от мнений, интерпретаций, оценок, формирует собственные мнения и суждения, аргументирует свои выводы и точку зрения (УК-1.3);
- рассматривает и предлагает возможные варианты решения поставленной задачи, оценивая их достоинства и недостатки (УК-1.4).

Способен определять круг задач в рамках поставленной цели и выбирать оптимальные способы их решения, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений (УК-2):

- определяет круг задач в рамках поставленной цели, определяет связи между ними и ожидаемые результаты их решения (УК-2.1);
- в рамках поставленных задач определяет имеющиеся ресурсы и ограничения, действующие правовые нормы (УК- 2.2);
- представляет результаты проекта, предлагает возможности их использования и/или совершенствования (УК 2.5).

Способен управлять своим временем, выстраивать и реализовывать траекторию саморазвития на основе принципов образования в течение всей жизни (УК-6):

- использует инструменты и методы управления временем при выполнении конкретных задач, проектов, при достижении поставленных целей (УК-6.1).

Способен организовать и провести исследование финансовых рынков (ПК-7):

- организует сбор, обработку и анализ информации о финансовых рынках (ПК 7.2);

- изучает предложение финансовых продуктов и услуг (ПК-7.3).

Способен выбрать финансовые продукты исходя из финансовых возможностей клиента (ПК-8):

- сравнивает параметры финансовых продуктов, организует и проводит презентации финансовых продуктов и услуг (ПК-8.2);

- рассчитывает стоимость финансовых услуг, оценивает потенциальные финансовые риски (ПК-8.3).

Способен организовать оформление сделок по предоставлению финансовых услуг клиентам (ПК-9):

- консультирует клиента по выбору вида финансовой услуги и поставщика финансовой услуги (ПК-9.1);

- составляет аналитическую отчетность об оказании финансовых услуг (ПК-9.4).

В результате сформированности компетенции обучающийся должен:

Знать:

- основные инструменты финансового рынка;

- теории финансовых рынков для принятия инвестиционных решений;

- методы математического анализа и моделирования, теоретического и экспериментального исследования показателей финансовых рынков для принятия управленческих решений;

Уметь:

- осуществлять поиск информации, характеризующей тенденции финансовых рынков;

- составлять аналитическую отчетность об оказании финансовых услуг;

- использовать и оценивать различные финансовые инструменты;

- оценивать риск и доходность на основных этапах финансового управления;

- оценивать эффективность принятых управленческих решений;

Владеть:

- методикой экономического исследования финансовых рынков;

- методами и приемами анализа экономических явлений и процессов на финансовых рынках;

- навыками использования различных финансовых инструментов;

- навыками проведения расчетов доходности финансовых инструментов.

6. Виды учебной работы и их объем

5.1 Объем дисциплины и виды учебной работы

Вид учебной работы	Объем, акад. ч.	в том числе в форме практической подготовки, акад. ч.
Общая трудоемкость дисциплины	216	10
Контактная работа - аудиторные занятия:	18,6	10
Лекции	6	10
Практические занятия (ПЗ)	12	-
Лабораторные работы (ЛР)	-	-
Контактная самостоятельная работа (групповые консультации и индивидуальная работа обучающихся с педагогическим работником)		
Контактная работа - промежуточная аттестация	0,6	
Самостоятельная работа	189	-
Самостоятельное изучение разделов дисциплины	189	-
Форма(ы) контроля:	Курсовая работа, экзамен	
Контактная работа - промежуточная аттестация	0,6	-
Подготовка к экзамену.	8,4	-