

УТВЕРЖДАЮ

д.юр.н., доц. Васильева Н.В.



30.06.2022г

дисциплины

ансовый рынок

30.06.2022г.

Направление подготовки: 38.03.01 Экономика
Направленность (профиль): Мировая экономика
Квалификация выпускника: бакалавр
Форма обучения: очная

Иркутск 2022

Программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению 38.03.01 Экономика.

Автор Т.И. Кубасова

Рабочая программа обсуждена и утверждена на заседании кафедры менеджмента и сервиса

Заведующий кафедрой О.Н. Баева

1. Цели изучения дисциплины

Целью освоения дисциплины «Финансовые рынки и финансово-кредитные институты» является формирование у студентов целостное представление о функционировании финансовых рынков и финансово-кредитных институтов, знаний о видах и практическом применении финансовых инструментов, механизме принятия решений по совершению операций и сделок на финансовых рынках.

2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины

Код компетенции по ФГОС ВО	Компетенция
ПК-5	Способен анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей
ПК-6	Способен, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные, проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет

Структура компетенции

Компетенция	Формируемые ЗУНы
ПК-5 Способен анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей	З. Знать основные методы анализа статистических данных о социально-экономических процессах и явлениях У. Уметь анализировать данные отечественной и зарубежной статистики, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей Н. Владеть навыками интерпретации данных отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях
ПК-6 Способен, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные, проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет	З. Знать основные принципы построения информационных обзоров и/или аналитических отчетов У. Уметь подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет по результатам проведенного анализа собранных данных Н. Владеть навыком сбора данных, необходимых для составления информационного обзора или аналитического отчета

3. Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Принадлежность дисциплины - БЛОК 1 ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛИ): Часть, формируемая участниками образовательных отношений.

4. Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся

Общая трудоемкость дисциплины составляет 5 зач. ед., 180 часов.

Вид учебной работы	Количество часов
Контактная(аудиторная) работа	
Лекции	36
Практические (сем, лаб.) занятия	18
Самостоятельная работа, включая подготовку к экзаменам и зачетам	126
Всего часов	180

5. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий

5.1. Содержание разделов дисциплины

№ п/п	Раздел и тема дисциплины	Семестр	Лекции	Семинар Лаборат. Практич.	Самостоят. раб.	В интерактивной форме	Формы текущего контроля успеваемости
1	Роль, виды и функции финансовых рынков в экономике	32	8	4	30		Вопросы для дискуссии
2	Инструменты финансовых рынков	32	8	4	40		Тестовые задания 1
3	Основные финансовые рынки	32	10	4	40		Тестовые задания 2
4	Операции на финансовых рынках	32	10	6	16		Доклад
	ИТОГО		36	18	126		

5.2. Лекционные занятия, их содержание

№ п/п	Наименование разделов и тем	Содержание
1	Роль, виды и функции финансовых рынков в экономике	Финансовый рынок: понятие, структура, функции. Типы финансово-кредитных систем. Виды финансовых посредников (институтов) на финансовом рынке. Финансово-кредитные институты: структура, виды, характеристика.
2	Инструменты финансовых рынков	Ценные бумаги: понятие, свойства, виды, классификация. Долговые ценные бумаги. Характеристика облигаций, векселей, депозитных и сберегательных сертификатов по удостоверяемым правам, параметрам, целям и особенностям выпуска и обращения. Отличительные черты еврооблигаций.
3	Инструменты финансовых рынков	Долевые ценные бумаги (акции). Обыкновенные и привилегированные акции: удостоверяемые права. Ценные бумаги, основанные на акциях (депозитарные расписки, опционы эмитента). Ипотечные ценные бумаги. Закладные.
4	Инструменты финансовых рынков	Производные ценные бумаги. Форвардные, фьючерсные, опционные контракты.
5	Основные финансовые рынки	Понятие валютного рынка, его структура, функции. Основные участники валютного рынка и их операции. Основные финансовые инструменты валютного рынка и стратегии участников рынка.

№ п/п	Наименование разделов и тем	Содержание
		Кредитный рынок: понятие, характеристики, участники, классификация. Банковский кредитный рынок: характеристика, инфраструктура. Регулирование кредитного рынка. Рынок ценных бумаг: понятие, структура, функции. Участники рынка ценных бумаг. Эмитенты. Инвесторы. Профессиональные участники рынка ценных бумаг. Направления объединения профессиональных участники рынка ценных бумаг: фондовые посредники, учетные институты. Некредитные финансовые организации, осуществляющие организационно-техническое обслуживание рынка ценных бумаг. Виды лицензий на рынке ценных бумаг. Брокеры, дилеры и управляющие на рынке ценных бумаг: основы осуществления профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг.
6	Основные финансовые рынки	Рынок страхования: понятие, виды, функции. Участники страхового рынка: виды, характеристика. Страховые продукты. Рынок золота как особый сегмент финансового рынка. Типы золотых рынков. Участники рынка золота и его функции. Основные виды банковских операций с драгоценными металлами.
7	Операции на финансовых рынках	Эмиссия эмиссионных ценных бумаг. Андеррайтинг на рынке ценных бумаг. Маржинальные сделки. Сделки РЕПО.

5.3. Семинарские, практические, лабораторные занятия, их содержание

№ раздела и темы	Содержание и формы проведения
1	Роль, виды и функции финансовых рынков в экономике. Задание 1-2. Финансовый рынок: понятие, структура, функции. Типы финансово-кредитных систем. Виды финансовых посредников (институтов) на финансовом рынке. Финансово-кредитные институты: структура, виды, характеристика. Занятие проводится в форме семинара, включающего обсуждение вопросов, предусмотренных планом семинара с элементами дискуссии по вопросам: <ul style="list-style-type: none"> • Финансовый рынок: структура, роль в макро- и микроэкономике, участники; • Фундаментальные факторы, воздействующие на финансовые рынки; • Сравнительная характеристика финансовых систем; • Риски на финансовом рынке; • Эволюция финансового рынка и его функций. Презентация докладов с последующим обсуждением.
2	Инструменты финансовых рынков. Задание 3-4. Проводятся в форме семинара, включающего разбор тестовых заданий, обсуждение предусмотренных планом семинара вопросов: Ценные бумаги: понятие, свойства, виды, классификация. Долговые ценные бумаги. Характеристика облигаций, векселей, депозитных и сберегательных сертификатов по удостоверяемым правам, параметрам, целям и особенностям выпуска и обращения. Отличительные черты

№ раздела и темы	Содержание и формы проведения
	еврооблигаций. Презентация докладов с последующим обсуждением.
3	Основные финансовые рынки. Задание 5-6. Проводятся в форме семинара, включающего разбор тестовых заданий, обсуждение предусмотренных планом семинара вопросов: Долевые ценные бумаги (акции). Обыкновенные и привилегированные акции: удостоверяемые права. Ценные бумаги, основанные на акциях (депозитарные расписки, опционы эмитента). Презентация докладов с последующим обсуждением.
4	Операции на финансовых рынках. Задание 7-9..Проводятся в форме семинара, включающего разбор тестовых заданий, обсуждение предусмотренных планом семинара вопросов: Инвестиционный пай: определение, удостоверяемые права, основные характеристики. Ипотечный сертификат участия: определение, основные характеристики. Презентация докладов с последующим обсуждением.

6. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации по дисциплине (полный текст приведен в приложении к рабочей программе)

6.1. Текущий контроль

№ п/п	Этапы формирования компетенций (Тема из рабочей программы дисциплины)	Перечень формируемых компетенций по ФГОС ВО	(ЗУНы: (З.1...З.п, У.1...У.п, Н.1...Н.п))	Контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы (Наименование оценочного средства)	Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания (по 100-балльной шкале)
1	1. Роль, виды и функции финансовых рынков в экономике	ПК-6	З.Знать основные принципы построения информационных обзоров и/или аналитических отчетов У.Уметь подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет по результатам проведенного анализа собранных данных	Вопросы для дискуссии	Оценивается от 0 до 25 баллов. Учитывается логика рассуждения, аргументация и обоснование выводов, знание законодательства и умение его применять в качестве доказательства (25)
2	2. Инструменты финансовых рынков	ПК-5	З.Знать основные методы анализа статистических данных о социально-экономических процессах и явлениях Н.Владеть навыками интерпретации данных отечественной и зарубежной статистики о	Тестовые задания 1	Тест содержит 25 вопросов, правильный ответ на один вопрос оценивается 1 балл (25)

№ п/п	Этапы формирования компетенций (Тема из рабочей программы дисциплины)	Перечень формируемых компетенций по ФГОС ВО	(ЗУНы: (З.1...З.п, У.1...У.п, Н.1...Н.п)	Контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы (Наименование оценочного средства)	Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания (по 100- балльной шкале)
			социально- экономических процессах и явлениях		
3	3. Основные финансовые рынки	ПК-6	З.Знать основные принципы построения информационных обзоров и/или аналитических отчетов Н.Владеть навыком сбора данных, необходимых для составления информационного обзора или аналитического отчета	Тестовые задания 2	Тест содержит 25 вопросов, каждый правильный ответ на вопрос оценивается в 1 балл. (25)
4	4. Операции на финансовых рынках	ПК-5	З.Знать основные методы анализа статистических данных о социально- экономических процессах и явлениях У.Уметь анализировать данные отечественной и зарубежной статистики, выявлять тенденции изменения социально- экономических показателей	Доклад	Доклад оценивается от 0- 25 баллов. 5 баллов- за своевременность сдачи; 5 баллов - за актуальность предоставленног о материала; 10 баллов - за полноту рассматриваемог о материала; 5 баллов - за защиту. (25)
				Итого	100

6.2. Промежуточный контроль (зачет, экзамен)

Рабочим учебным планом предусмотрен Экзамен в семестре 32.

ВОПРОСЫ ДЛЯ ПРОВЕРКИ ЗНАНИЙ:

1-й вопрос билета (40 баллов), вид вопроса: Тест/проверка знаний. Критерий: Оценка задания от 0-40 баллов.

Компетенция: ПК-5 Способен анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей
Знание: Знать основные методы анализа статистических данных о социально-экономических процессах и явлениях

1. Биржевой товар, определение, признаки, классификация.
2. Биржевые сделки: определение и классификация
3. Лицензирование участников рынка ценных бумаг
4. Московская биржа: особенности торговли
5. Организационно- правовые основы функционирования бирж.
6. Особенности биржевой торговли на валютных биржах
7. Особенности биржевой торговли на товарных биржах
8. Понятие биржи, классификация
9. Регулирование биржевого рынка: государственное регулирование и саморегулирование
10. Регулирование финансового рынка: государственное регулирование и саморегулирование
11. Современные сделки: маржинальные, хеджирование, секьюритизация
12. Сущность и классификация долговых ценных бумаг
13. Технология биржевой торговли
14. Финансовый рынок Китая: характеристика, особенности, тенденции
15. Финансовый рынок: понятие, структура.

Компетенция: ПК-6 Способен, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные, проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет

Знание: Знать основные принципы построения информационных обзоров и/или аналитических отчетов

16. Доходность инвестирования: текущая доходность и доходность к погашению
17. Инвесторы на рынке ценных бумаг
18. Инфраструктура рынка ценных бумаг
19. Классификация финансовых рынков.
20. Методика дисконтирования: сфера применения
21. Особенности брокерской деятельности: договоры поручения и комиссии
22. Особенности депозитарной деятельности. Расчетный, кастодиальный, глобальный депозитарий
23. Особенности деятельности по ведению реестра: виды зарегистрированных лиц. Номинальный держатель
24. Особенности деятельности по управлению ценными бумагами: индивидуальное управление и коллективное управление
25. Особенности дилерской деятельности: понятие котировок
26. Портфельное инвестирование: модели и принципы инвестирования.
27. Современные тенденции развития финансовых рынков.
28. Сущность и классификация долевых ценных бумаг
29. Сущность и классификация производных ценных бумаг
30. Финансовый рынок России: характеристика, особенности, тенденции
31. Финансовый рынок США: характеристика, особенности, тенденции
32. Фундаментальный и технический анализ на рынке ценных бумаг: общее и отличия
33. Характеристика валютного рынка, как сегмента финансового рынка
34. Характеристика кредитного рынка, как сегмента финансового рынка
35. Характеристика рынка ценных бумаг, как сегмента финансового рынка
36. Ценные бумаги: сущность и их классификация

ТИПОВЫЕ ЗАДАНИЯ ДЛЯ ПРОВЕРКИ УМЕНИЙ:

2-й вопрос билета (30 баллов), вид вопроса: Задание на умение. Критерий: Оценка задания от 0-30 баллов. Задание содержит две части, каждая оценивается в 15 баллов: 5 баллов за формулу расчета, 10 баллов- за правильное решение.

Компетенция: ПК-5 Способен анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей

Умение: Уметь анализировать данные отечественной и зарубежной статистики, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей

Задача № 1. Задания по инвестированию

Компетенция: ПК-6 Способен, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные, проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет

Умение: Уметь подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет по результатам проведенного анализа собранных данных

Задача № 2. Задания на финансовые вычисления

ТИПОВЫЕ ЗАДАНИЯ ДЛЯ ПРОВЕРКИ НАВЫКОВ:

3-й вопрос билета (30 баллов), вид вопроса: Задание на навыки. Критерий: Оценка задания от 0-30 баллов. Задание содержит две части, каждая оценивается в 15 баллов: 5 баллов за формулу расчета, 10 баллов- за правильное решение.

Компетенция: ПК-5 Способен анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей

Навык: Владеть навыками интерпретации данных отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях

Задание № 1. Задачи по ценообразованию производных инструментов

Компетенция: ПК-6 Способен, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные, проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет

Навык: Владеть навыком сбора данных, необходимых для составления информационного обзора или аналитического отчета

Задание № 2. Задачи по ценообразованию облигаций

ОБРАЗЕЦ БИЛЕТА

Министерство науки и высшего образования
Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное
образовательное учреждение
высшего образования
**«БАЙКАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ
УНИВЕРСИТЕТ»
(ФГБОУ ВО «БГУ»)**

Направление - 38.03.01 Экономика
Профиль - Мировая экономика
Кафедра менеджмента и сервиса
Дисциплина - Мировой финансовый
рынок

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 1

1. Тест (40 баллов).
2. Задания по инвестированию (30 баллов).
3. Задачи по ценообразованию производных инструментов (30 баллов).

Составитель _____ Т.И. Кубасова

Заведующий кафедрой _____ О.Н. Баева

7. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

а) основная литература:

1. Чалдаева Л. А. Лариса Алексеевна, Блохина Т. К. Татьяна Константиновна, Шемякин А. Б. Андрей Борисович Биржевое дело. учебник для бакалавров. допущено Учеб.-метод. отделом высшего образования/ Л. А. Чалдаева, Т. К. Блохина, А. Б. Шемякин.- М.: Юрайт, 2013.-372 с.
2. Пакова О.Н. Финансовые рынки и финансово-кредитные институты [Электронный ресурс] : практикум / О.Н. Пакова, Ю.А. Коноплева. — Электрон. текстовые данные. — Ставрополь: Северо-Кавказский федеральный университет, 2016. — 105 с. — 2227-8397. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/66125.html>

б) дополнительная литература:

1. Галанов В. А. Рынок ценных бумаг. учебник для вузов. допущено М-вом образования и науки РФ/ В. А. Галанов.- М.: ИНФРА-М, 2013.-378 с.
2. Селищев А. С. Александр Сергеевич, Маховикова Г. А. Галина Афонасьевна Рынок ценных бумаг. учеб. для бакалавров. допущено М-вом образования и науки РФ/ А. С. Селищев, Г. А. Маховикова.- М.: Юрайт, 2013.-431 с.
3. Алексеева И. А. Ирина Анатольевна Рынок ценных бумаг. Ч. 1. учеб. пособие. Электронный ресурс. 2-е изд., доп. и перераб./ И. А. Алексеева.- Иркутск: Изд-во БГУЭП, 2013.-252 с.
4. Корпоративные финансы и управление бизнесом [Электронный ресурс] : монография / С.В. Большаков [и др.]. — Электрон. текстовые данные. — М. : Русайнс, 2015. — 378 с. — 978-5-4365-0485-8. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/48908.html>
5. Фомина О.Н. Корпоративное право [Электронный ресурс] : учебное пособие / О.Н. Фомина. — Электрон. текстовые данные. — М. : Всероссийский государственный университет юстиции (РПА Минюста России), 2015. — 118 с. — 978-5-00094-143-0. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/43222.html>

8. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины (модуля), включая профессиональные базы данных и информационно-справочные системы

Для освоения дисциплины обучающемуся необходимы следующие ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:

- Сайт Байкальского государственного университета, адрес доступа: <http://bgu.ru/>, доступ круглосуточный неограниченный из любой точки Интернет
- ИВИС - Универсальные базы данных, адрес доступа: <http://www.dlib.eastview.ru/>. доступ круглосуточный неограниченный из любой точки Интернет при условии регистрации в БГУ
- КиберЛенинка, адрес доступа: <http://cyberleninka.ru>. доступ круглосуточный, неограниченный для всех пользователей, бесплатное чтение и скачивание всех научных публикаций, в том числе пакет «Юридические науки», коллекция из 7 журналов по правоведению
- Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU, адрес доступа: <http://elibrary.ru/>. доступ к российским журналам, находящимся полностью или частично в открытом доступе при условии регистрации
- Сайт ЦБ РФ, адрес доступа: <http://www.cbr.ru/publ>. доступ неограниченный

9. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

Изучать дисциплину рекомендуется в соответствии с той последовательностью, которая обозначена в ее содержании. Для успешного освоения курса обучающиеся должны иметь первоначальные знания в области финансов, кредита, страхования.

На лекциях преподаватель озвучивает тему, знакомит с перечнем литературы по теме, обосновывает место и роль этой темы в данной дисциплине, раскрывает ее практическое значение. В ходе лекций студенту необходимо вести конспект, фиксируя основные понятия и проблемные вопросы.

Практические (семинарские) занятия по своему содержанию связаны с тематикой лекционных занятий. Начинать подготовку к занятию целесообразно с конспекта лекций. Задание на практическое (семинарское) занятие сообщается обучающимся до его проведения. На семинаре преподаватель организует обсуждение этой темы, выступая в качестве организатора, консультанта и эксперта учебно-познавательной деятельности обучающегося.

Изучение дисциплины (модуля) включает самостоятельную работу обучающегося.

Основными видами самостоятельной работы студентов с участием преподавателей являются:

- текущие консультации;
- коллоквиум как форма контроля освоения теоретического содержания дисциплин: (в часы консультаций, предусмотренные учебным планом);
- прием и разбор домашних заданий (в часы практических занятий);

Основными видами самостоятельной работы студентов без участия преподавателей являются:

- формирование и усвоение содержания конспекта лекций на базе рекомендованной лектором учебной литературы, включая информационные образовательные ресурсы (электронные учебники, электронные библиотеки и др.);
- самостоятельное изучение отдельных тем или вопросов по учебникам или учебным пособиям;
- подготовка докладов с презентацией;
- подготовка к семинарам;
- выполнение домашних заданий в виде ответов на тестовые задания.

10. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения

В учебном процессе используется следующее программное обеспечение:

- MS Office,
- КонсультантПлюс: Версия Проф - информационная справочная система,
- КонсультантПлюс: Сводное региональное законодательство,
- MS Project Professional,

11. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю):

В учебном процессе используется следующее оборудование:

- Помещения для самостоятельной работы, оснащенные компьютерной техникой с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду вуза,
- Учебные аудитории для проведения: занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, практических занятий, выполнения курсовых работ, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, укомплектованные специализированной мебелью и техническими средствами обучения,
- Наборы демонстрационного оборудования и учебно-наглядных пособий