

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Крылова Людмила Владимировна
Должность: Проректор по учебно-методической работе
Дата подписания: 24.02.2025 09:28:19
Уникальный программный ключ:
b066544bae1e449cd8bfce392f7274a676a271fb2

**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**
**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ
ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«ДОНЕЦКИЙ НАЦИОНАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ЭКОНОМИКИ И
ТОРГОВЛИ ИМЕНИ МИХАИЛА ТУГАН-БАРАНОВСКОГО»**

КАФЕДРА БАНКОВСКОГО ДЕЛА

УТВЕРЖДАЮ:

Проректор по учебно-методической работе



Л.В.Крылова

2024 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.ДВ.11.02 АНАЛИЗ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

(шифр, название учебной дисциплины в соответствии с учебным планом)

Укрупненная группа направлений подготовки 38.00.00 Экономика и управление

Программа высшего образования – программа бакалавриата

Направление подготовки 38.03.01 Экономика

Профиль: Банковское дело

Институт учета и финансов

Форма обучения, курс:

очная форма обучения, 4 курс

очно-заочная форма обучения, 5 курс

Рабочая программа адаптирована для лиц с ограниченными
возможностями здоровья и инвалидов

Донецк
2024

Рабочая программа учебной дисциплины «Анализ финансовых рынков» для обучающихся по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, профилю: Банковское дело, разработанная в соответствии с учебным планом, утвержденным Ученым советом Университета
- в 2024 г. - для очной формы обучения;
- в 2024 г. - для очно-заочной формы обучения.

Разработчик: Жильцова Кристина Игоревна, к.э.н., доцент кафедры банковского дела



Рабочая программа утверждена на заседании кафедры банковского дела
Протокол от « 20 » 02 2024 года № 12
Зав. кафедрой банковского дела

(подпись)

КАФЕДРА И.В. Попова
БАНКОВСКОГО (инициалы, фамилия)
ДЕЛА

СОГЛАСОВАНО
Директор института учета и финансов

(подпись)



Л.И. Тымчина
(инициалы, фамилия)

« 21 » 02 2024 года

ОДОБРЕНО

Учебно-методическим советом Университета

Протокол от « 28 » 02 2024 года № 7

Председатель Л.В. Крылова

(подпись)

(инициалы, фамилия)

© Жильцова К.И., 2024 год
© ФГБОУ ВО «Донецкий национальный университет экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского», 2024 год

1. ОПИСАНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Наименование показателя	Наименование укрупненной группы направлений подготовки / специальностей, направление подготовки / специальность, профиль / магистерская программа / специализация, программа высшего образования	Характеристика учебной дисциплины	
		очная форма обучения	Очно-заочная форма обучения
Количество зачетных единиц – 2	Укрупненная группа направлений подготовки 38.00.00 Экономика и управление	Вариативная	
	Направление подготовки: 38.03.01 Экономика		
Модулей – 1	Профиль: Банковское дело	Год подготовки:	
Смысловых модулей – 2		4-й	5-й
Общее количество часов – 72		Семестр:	
		8-й	10-й
		Лекции	
	12 часов	12 часов	
Количество часов в неделю для очной формы обучения: аудиторных – 3 самостоятельной работы обучающегося – 5,5	Программа высшего образования – программа бакалавриата	Практические, семинарские занятия	
		12 часов	12 часов
		Лабораторные работы	
		-	-
		Самостоятельная работа	
		47,15 час.	46,55 час.
		Индивидуальные задания¹	
		2 ТМК	2 ТМК
Форма промежуточной аттестации			
	Зачет	Зачет	

* для очной формы обучения указывается количество проводимых текущих модульных контролей (например, 2ТМК), при наличии – курсовая работа/проект (КР/КП)

для заочной формы обучения указывается, при наличии, аудиторная письменная работа/контрольная работа (АПР), курсовая работа/проект (КР/КП)

Соотношение количества часов аудиторных занятий и самостоятельной работы составляет:

для очной формы обучения – 24,85 / 47,15

для очно-заочной формы обучения – 25,45 / 46,55

2. ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель учебной дисциплины: формирование у обучающихся фундаментальных знаний по теории и анализу финансового рынка, а также выработка практических навыков для принятия управленческих решений по привлечению компаниями капитала и размещению временно свободных денежных средств в финансовые инструменты на фондовом рынке.

Задачи учебной дисциплины: раскрыть функции участников финансового рынка, сущность основных проводимых ими операций, а также роль и значение деятельности каждого из них; дать представление об основных видах финансовых инструментов и их свойствах, научиться анализировать функционирование финансовых рынков.

3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП ВО

Учебная дисциплина «Анализ финансовых рынков» относится к вариативной части ОПОП ВО.

Связь с другими дисциплинами учебного плана:

- перечень действующих и - перечень действующих и предшествующих дисциплин: «Финансы», «Деньги, кредит, банки», «Мировая экономика»;
- перечень теоретических дисциплин и практик, для которых освоение данной дисциплины необходимо как предшествующее: «Валютный рынок», «Анализ финансовых рынков», «Международный рынок банковских услуг и тенденции его развития».

4. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ), СООТНЕСЕННЫХ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

В результате освоения учебной дисциплины у обучающегося должны быть сформированы компетенции и индикаторы их достижения:

<i>Код и наименование компетенции</i>	<i>Код и наименование индикатора достижения компетенции</i>
ПК-13 Способен осуществлять мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты с целью консультирования клиентов по использованию финансовых продуктов и услуг	ИД-1ПК-13 Осуществляет сбор, обработку и анализ информации о состоянии финансового рынка, изучает спрос и предложения на рынке финансовых услуг; ИД-2ПК-13 Выбирает и обосновывает выбор инструментальных средств для обработки финансовой и иной экономической информации; ИД-4ПК-13 Составляет аналитические заключения, рейтинги, прогнозы с целью предотвращения сделок с недобросовестными партнерами.

В результате изучения учебной дисциплины обучающийся должен:

знать: закономерности развития финансового рынка в целом, а также цикличность динамики рынка ценных бумаг; функции и принципы организации деятельности профессиональными участниками рынка ценных бумаг; основные закономерности развития финансовых рынков, а также статистические показатели, используемые на рынке ценных бумаг для оценки динамики его развития; виды ценных бумаг, принципы их выпуска и обращения, а также закономерности выбора компанией источника финансирования в зависимости от стадии жизненного цикла компании и цикла развития финансового рынка; правила регулирования рынка ценных бумаг, функции государственного регулятора рынка ценных бумаг и саморегулируемых организаций.

уметь: обобщать и систематизировать информацию, характеризующую деятельность компаний на рынке ценных бумаг; анализировать основные показатели результатов торгов ценными бумагами на фондовой бирже с использованием информации, представленной на сайтах

фондовых бирж, рейтинговых агентств и инвестиционных компаний; использовать для выполнения аналитических заданий современные технические средства и информационные технологии; оценивать условия и последствия принимаемых управленческих решений на рынке ценных бумаг по привлечению и размещению капитала; анализировать основные финансовые показатели, характеризующие ценные бумаги.

владеть: методологией экономического исследования на макроуровне; методами планирования проведения научного исследования и совокупностью способов и приемов в области исследования методов и инструментов валютного регулирования; навыками применения инструментов сравнительного и ситуационного анализа.

5. ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

МОДУЛЬ 1. ФИНАНСОВЫЙ РЫНОК

Смысловой модуль 1. Общие основы функционирования финансового рынка.

Тема 1. Финансовый рынок: сущность, функции и роль в экономике.

Тема 2. Инфраструктура финансового рынка: основные участники и инструменты.

Тема 3. Регулирование финансового рынка.

Тема 4. Рынок долгового капитала.

Смысловой модуль 2. Организация деятельности финансового рынка.

Тема 5. Рынок акций.

Тема 6. Рынок производных ценных бумаг.

Тема 7. Международные рынки капитала.

Тема 8. Денежный рынок и рынок банковских займов.

Тема 9. Государственные ценные бумаги.

Тема 10. Валютный рынок.

6. СТРУКТУРА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Названия смысловых модулей и тем	Количество часов											
	очная форма обучения						Очно-заочная форма обучения					
	всего	в том числе					всего	в том числе				
		л ¹	п ²	лаб ³	инд ⁴	СР ⁵		л	п	лаб	инд	СР
<i>1</i>	<i>2</i>	<i>3</i>	<i>4</i>	<i>5</i>	<i>6</i>	<i>7</i>	<i>8</i>	<i>9</i>	<i>10</i>	<i>11</i>	<i>12</i>	<i>13</i>
МОДУЛЬ 1. РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ												
Смысловой модуль 1. Общие основы функционирования финансового рынка												
Тема 1. Финансовый рынок: сущность, функции и роль в экономике.	5	1	1	-	-	3	5	1	1	-	-	3
Тема 2. Инфраструктура финансового рынка: основные участники и инструменты.	5	1	1	-	-	3	5	1	1	-	-	3
Тема 3. Регулирование финансового рынка	5	1	1	-	-	3	5	1	1	-	-	3
Тема 4. Рынок долгового капитала.	5	1	1	-	-	3	5	1	1	-	-	3
Всего по смысловому модулю 1	20	4	4	-	-	12	20	4	4	-	-	12
Смысловой модуль 2. Организация деятельности финансового рынка												
Тема 5. Рынок акций.	5	1	1	-	-	3	5	1	1	-	-	3

Тема 6. Рынок производных ценных бумаг.	5	1	1	-	-	3	5	1	1	-	-	3
Тема 7. Международные рынки капитала	9	1	1	-	-	7	9	1	1	-	-	7
Тема 8. Денежный рынок и рынок банковских займов	10	1	1	-	-	8	10	1	1	-	-	8
Тема 9. Государственные ценные бумаги	10	2	2	-	-	6	10	2	2	-	-	6
Тема 10. Валютный рынок.	10,4	2	2	-	-	6,4	10,4	2	2	-	-	6,4
Всего по смысловому модулю 2	49,4	8	8	-	-	33,4	49,4	8	8	-	-	34,5
Всего часов	68,1	12	12	-	-	47,1	69,4	12	12	-	-	46,5
<i>Катт</i>	-	-	-	-	0,6	-	-	-	-	-	1,2	-
<i>СРЭК</i>	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<i>ИК</i>	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<i>КЭ</i>	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<i>Каттэк</i>	-	-	-	-	0,2	-	-	-	-	-	0,25	-
<i>Контроль</i>	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Всего часов	72	12	12	-	0,8	47,15	72	12	12	-	1,45	46,55

Примечания: Лек – лекции, Лаб – лабораторные занятия, Пр – практические занятия, ИК – индивидуальные консультации, Катт – контактная работа на аттестацию в период теоретического обучения, в период прохождения практик, СР – самостоятельная работа, КЭ – консультации экзаменационные, Каттэк – контактная работа на аттестацию в период экзаменационной сессии и итоговой аттестации

7. ТЕМЫ СЕМИНАРСКИХ И ПРАКТИЧЕСКИХ ЗАНЯТИЙ

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	Очно-заочная форма
1	2	3	4
Смысловой модуль 1. Общие основы функционирования финансового рынка			
1	Тема 1. Финансовый рынок: сущность, функции и роль в экономике.	1	1
2	Тема 2. Инфраструктура финансового рынка: основные участники и инструменты.	1	1
3	Тема 3. Регулирование финансового рынка	1	1
4	Тема 4. Рынок долгового капитала.	1	1
Смысловой модуль 2. Организация деятельности финансового рынка			
5	Тема 5. Рынок акций.	1	1
6	Тема 6. Рынок производных ценных бумаг.	1	1
7	Тема 7. Международные рынки капитала	1	1
8	Тема 8. Денежный рынок и рынок банковских займов	1	1
9	Тема 9. Государственные ценные бумаги	2	2
10	Тема 10. Валютный рынок.	2	2
ВСЕГО		12	12

8. ТЕМЫ ЛАБОРАТОРНЫХ ЗАНЯТИЙ – не предусмотрены

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	заочная форма
1	2	3	4

9. САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	заочная форма
1	2	3	4
Смысловой модуль 1. Общие основы функционирования финансового рынка			
1	Тема 1. Финансовый рынок: сущность, функции и роль в экономике.	3	3
2	Тема 2. Инфраструктура финансового рынка: основные участники и инструменты.	3	3
3	Тема 3. Регулирование финансового рынка	3	3
4	Тема 4. Рынок долгового капитала.	3	3
Смысловой модуль 2. Организация деятельности финансового рынка			
5	Тема 5. Рынок акций.	3	3
6	Тема 6. Рынок производных ценных бумаг.	3	3
7	Тема 7. Международные рынки капитала	7	7
8	Тема 8. Денежный рынок и рынок банковских займов	8	8
9	Тема 9. Государственные ценные бумаги	6	6
10	Тема 10. Валютный рынок.	6,15	5,55
ВСЕГО		47,15	46,55

10. ОБЕСПЕЧЕНИЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ДЛЯ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ И ИНВАЛИДОВ

В ходе реализации учебной дисциплины используются следующие дополнительные методы обучения, текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся в зависимости от их индивидуальных особенностей:

- 1) для слепых и слабовидящих:
 - лекции оформляются в виде электронного документа;
 - письменные задания оформляются увеличенным шрифтом или заменяются устным ответом;
- 2) для глухих и слабослышащих:
 - лекции оформляются в виде электронного документа;
 - письменные задания выполняются на компьютере в письменной форме;
 - зачет проводится в письменной форме на компьютере; возможно проведение в форме тестирования с использованием дистанционной системы Moodle;
- 3) для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:
 - лекции оформляются в виде электронного документа;
 - письменные задания заменяются устным ответом;
 - зачет проводится в устной форме.

При необходимости предусматривается увеличение времени для подготовки ответа.

Процедура проведения промежуточной аттестации для обучающихся устанавливается с учётом их индивидуальных психофизических особенностей. Промежуточная аттестация может проводиться в несколько этапов.

При проведении процедуры оценивания результатов обучения предусматривается

использование технических средств, необходимых в связи с индивидуальными особенностями обучающихся. Эти средства могут быть предоставлены университетом, или могут использоваться собственные технические средства.

Проведение процедуры оценивания результатов обучения допускается с использованием дистанционных образовательных технологий.

Обеспечивается доступ к информационным и библиографическим ресурсам в сети Интернет для каждого обучающегося в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

- 1) для слепых и слабовидящих:
 - в печатной форме увеличенным шрифтом;
 - в форме электронного документа.
- 2) для глухих и слабослышащих:
 - в печатной форме;
 - в форме электронного документа.
- 3) для обучающихся с нарушениями опорно-двигательного аппарата:
 - в печатной форме;
 - в форме электронного документа.

11. ИНДИВИДУАЛЬНЫЕ ЗАДАНИЯ

Вопросы для текущего модульного контроля (ТМК)

Смысловой модуль 1. Общие основы функционирования финансового рынка

1. История развития Центрального Республиканского Банка.
 2. Фондовый рынок в условиях планово-распределительной экономики: исторический и функциональный аспекты.
 3. Роль фондового рынка в развитии и экономических систем рыночного типа.
 4. Классификация рынков ценных бумаг.
 5. Функции рынка ценных бумаг в современных экономических условиях.
 6. Сущность ценной бумаги и их классификация по инвестиционным и иным характеристикам.
 7. Инвестиционные качества ценных бумаг.
 8. Национальные модели рынков ценных бумаг: сравнительный анализ
 9. Новые виды рынков и новые виды ценных бумаг (коммерческие бумаги, складские свидетельства).
 10. Формирование, проблемы и перспективы вторичного рынка ценных бумаг в ДНР.
 11. Формирование, проблемы и перспективы первичного рынка ценных бумаг в ДНР.
 12. Роль организованного рынка ценных бумаг в реализации механизма привлечения инвестиций в реальный сектор экономики ДНР.
 13. Формирование правовой инфраструктуры рынка ценных бумаг в ДНР.
 14. Национальные модели рынков ценных бумаг: сравнительный анализ.
 15. Ценные бумаги в системе инвестиционного проектирования.
 16. Ценные бумаги в системе исламских финансов.
- Смысловой модуль 2. Организация деятельности финансового рынка*
17. Рынок ценных бумаг: структура, роль в макро и микроэкономике, участники.
 18. Технология банкротства на фондовом рынке
 19. Долговые обязательства предприятий: отечественный и зарубежный опыт.
 20. Коммерческие бумаги: понятие, виды, роль в современной экономике.
 21. Ипотечные облигации: зарубежный опыт и перспективы на российском рынке.
 22. Рынок валютных облигаций: операции и перспективы развития.
 23. Складские свидетельства: понятие, область применения, зарубежный опыт.
 24. Финансовые опционы и фьючерсы: опыт развитых стран.
 25. Товарные опционы и фьючерсы, опыт развитых стран.

26. Управление портфелем ценных бумаг. Портфельные стратегии.
27. Рынок государственных ценных бумаг как объект для инвестиций и государственного контроля за денежно-кредитной сферой.
28. Технология работы сектора государств ценных бумаг: отечественный и зарубежный опыт.
29. Регулирование ГЦБ: отечественный и зарубежный опыт.
30. Развитие рынков муниципальных ценных бумаг (на примере...).

Смысловой модуль 2. Организация деятельности финансового рынка.

Задача

Номинал облигации 100 руб., ожидаемая сумма купонных выплат 5 руб, рыночная цена облигации 85 руб., срок до погашения 4 месяца.

Определите: доходность облигации к погашению.

Задача

Фирма приобрела 3 банковских векселя 1 марта 1998 г. сроком по предъявлению, но не ранее 1 июня 1998 г. Номинал каждого векселя - 100 тыс. руб. Процентный доход, гарантированный банком по векселям, - 25% годовых. Векселя были предъявлены фирмой к платежу банку 1 июля 1998 г.

Определите доходность операции с векселями.

Задача

Рассчитайте доходность инвестиций, если первоначальные инвестиции составляют 500 тыс. руб., сумма продисконтированных денежных потоков – 1200 тыс. руб.

Задача

Страйк-цена опциона пут 28 руб. Опционная премия - 2 руб. Спот-цена базового актива равна 26,5 руб. за единицу.

Определите внутреннюю и временную стоимость.

Вопросы к контрольной работе (АПР)

1. Залог ценных бумаг в операциях на финансовом рынке.
2. Методы оценки стоимости ценных бумаг.
3. Управление рисками, возникающими при доверительном управлении ценными бумагами.
4. Мировой рынок акций: состояние, проблемы и перспективы развития.
5. Мировой рынок облигаций: состояние, проблемы и перспективы развития.
6. Европейский рынок ценных бумаг: структура, механизм эмиссии, операции.
7. Состояние и тенденции развития рынка производных финансовых инструментов.
8. Мировой опыт секьюритизации финансовых активов.
9. Организация биржевой торговли финансовыми инструментами.
10. Развитие системы расчетов и клиринга по операциям с ценными бумагами.
11. Проблемы развитие депозитарно-клиринговых систем в отечественной практике.
12. Оборот первичных акций на рынке ценных бумаг.
13. Государственные и муниципальные ценные бумаги: международная практика
14. Рынок высокорисковых облигаций: история и современное состояние
15. Фундаментальный и технический анализ на рынке ценных бумаг.
16. Облигации, обеспеченные залогом имущества.
17. Методы анализа рынка ценных бумаг.
18. Анализ ипотечного рынка ценных бумаг.
19. Вексель на современном финансовом рынке.
20. Анализ вексельного рынка, перспективы развития.
21. Депозитные и сберегательные сертификаты в банковской деятельности
22. Фьючерсы и опционы как инструменты хеджирования рисков.

23. Привилегированные акции: разновидности и использование в международной практике
23. Торговля ценными бумагами российских эмитентов на зарубежных рынках
24. Инвестиционные инструменты рынка ценных бумаг.
25. Банковские учреждения на рынке ценных бумаг.
26. Российские фондовые индексы
27. Банковские операции на первичном и вторичном рынке ценных бумаг.
28. Система регулирования рынка ценных бумаг.
29. Методы управления рисками на рынке ценных бумаг.
30. Деятельность инвестиционных банков на финансовом рынке.
31. Международная практика андеррайтинга ценных бумаг.
32. Доверительное управление ценными бумагами.
33. Пенсионные фонды на финансовом рынке.
34. Инструменты хеджирования на рынке ценных бумаг.
35. Методы анализа облигаций.
36. Методы и модели оценки стоимости ценных бумаг.
37. Стратегии управления портфелем ценных бумаг.
38. Модели формирования оптимального портфеля ценных бумаг.
39. Методы анализа конъюнктуры рынка ценных бумаг.
40. Фундаментальный анализ в принятии инвестиционных решений.
41. Структура рынка евробумаг и механизм их эмиссии
42. Налогообложение участников рынка ценных бумаг.
43. Роль рынка ценных бумаг в накоплении капитала и перераспределении финансовых ресурсов в различных странах
44. Саморегулируемые организации рынка ценных бумаг.
45. Глобализация рынка ценных бумаг
46. Рейтинг ценных бумаг: значение и виды.
47. Организация деятельности рейтинговых агентств.
48. Минимизация рисков купли-продажи ценных бумаг.
49. Страховые компании как инвесторы на рынке ценных бумаг.
50. Анализ рисков портфеля ценных бумаг.
51. Эмиссия ценных бумаг.
52. Американские депозитарные расписки: понятие, необходимость выпуска.
53. Финансовые риски частных и институциональных инвесторов, связанные с ценными бумагами

12. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ ЗНАНИЙ ОБУЧАЮЩИХСЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ

Оценочные средства детализируются по видам работ в оценочных материалах по учебной дисциплине, которые утверждаются на заседании кафедры.

Система оценивания по учебной дисциплине по очной форме обучения*

Форма контроля	Максимальное количество баллов	
	За одну работу	Всего
Текущий контроль:		
- собеседование (темы 1-10)	5	50
- разноуровневые задачи и задания (темы 2,4,5,7,8,10)	5	30
- контрольная работа (ТМК 1)	10	10
- контрольная работа (ТМК 2)	10	10
Промежуточная аттестация	<i>зачет с оценкой</i>	100
Итого за семестр	100	

Система оценивания по учебной дисциплине по очно-заочной форме обучения*

Форма контроля	Максимальное количество баллов	
	За одну работу	Всего
Текущий контроль:		
- тестирование	30	30
- контрольная работа (ТМК 1)	35	35
- контрольная работа (ТМК 2)	35	35
Промежуточная аттестация	<i>зачет с оценкой</i>	100
Итого за семестр	100	

* в соответствии с утвержденными оценочными материалами по учебной дисциплине

Вопросы для подготовки к экзамену:

1. Понятие «ценные бумаги» и их классификация.
2. Структура долгового рынка.
3. Опционы: определение и виды.
4. Эмиссия ценных бумаг.
5. Понятие, функции и классификация деривативов.
6. Волатильность и методы ее оценки.
7. Фундаментальные свойства ценных бумаг.
8. Вексель: понятие и виды. Операции с векселями.
9. Опционная премия.
10. Эмитенты: определение и выполняемые функции. Категории эмитентов.
11. Классификация облигаций в зависимости от источника получения дохода, срока погашения.
12. Рынок еврооблигаций.
13. Участники РЦБ и их взаимодействие.
14. Международные ценные бумаги: виды, характеристики, перспективы развития.
15. Классификация рынка ценных бумаг.
16. Процедура размещения ценных бумаг.
17. Фьючерсный контракт: определение и свойства.
18. Биржа: функции и задачи.
19. Задачи современных фондовых бирж.
20. Акция и ее фундаментальные свойства
21. Риск и доходность ценных бумаг.
22. Рынок ценных бумаг как сегмент финансового рынка: сущность и задачи.
23. Этапы эмиссии ценных бумаг.
24. Виды биржевых аукционов.
25. Цели операций с деривативами.

26. Инвесторы: определение и выполняемые функции. Категории инвесторов.
27. Классификация облигаций в зависимости от возможности досрочного погашения и возможности обмена на акции.
28. Депозитарные расписки: назначение и порядок выпуска.
29. Профессиональные участники рынка ценных бумаг.
30. Классификация облигаций в зависимости от эмитента, срока выплаты номинала, обеспечения.
31. Роль фондового рынка в развитии и экономических систем рыночного типа
32. Американские депозитарные расписки: виды и порядок выпуска.
33. Посредники на рынке ценных бумаг. Маркет-мейкеры и маркет-тейкеры.
34. Оценка стоимости облигаций.
35. Государственные облигации.
36. Участники рынка ценных бумаг, обеспечивающие исполнение сделок с ценными бумагами.
37. Рейтинг облигаций.
38. Функции рынка ценных бумаг в современных экономических условиях
39. Облигации с государственной гарантией.
40. Информационная инфраструктура рынка ценных бумаг.
41. Показатели развития рынка облигаций.
42. Рынок ценных бумаг: структура, роль в макро и микроэкономике, участники
43. Инфраструктурные облигации.
44. Участники рынка ценных бумаг.
45. Облигации и их свойства.
46. Свопы: определение и виды.
47. Торговые системы на фондовом рынке
48. Процедура заключения сделок на бирже.
49. Характеристика срочных сделок в системе биржевой торговли
50. Объявленные, размещенные и оплаченные акции.
51. Складские свидетельства: понятие, область применения.
52. Ликвидность рынка ценных бумаг.
53. Саморегулируемые организации.
54. Операции с собственными акциями.
55. Модель САМР.
56. Содержание и цели регулирования рынка ценных бумаг.
57. Акции в зависимости от источника генерируемого дохода.
58. Технический анализ.
59. Составляющие системы регулирования рынка ценных бумаг.
60. Номинальная и рыночная цена акции. Капитализация.
61. Соотношение между риском и доходностью ценных бумаг.
62. Государственное и рыночное прямое регулирование мирового финансового рынка.
63. Доходность по акциям.
64. Инвестиционные качества ценных бумаг.
65. Основы портфельной теории.
66. Листинг и делистинг.
67. Классификация акций.
68. Фундаментальный анализ. Функции рынка ценных бумаг.
69. Андеррайтинг.
70. Форвардный контракт.
71. В чем состоит привлекательность еврооблигаций?
72. Этапы эмиссии американской депозитарной расписки.
73. Методы оценки риска портфеля ценных бумаг.
74. Портфель ценных бума

75. Диверсификация портфеля ценных бумаг
76. Отличительные черты иньестиционного портфеля, от портфеля ценных бумаг
77. Форвард и фьючерс, сходства и отличия
78. Виды операций с собственными акциями
79. Операция сплит, что такое, как проводят?
80. Государственные облигации
81. Концессионные облигации
82. Порядок выпуска концессионных облигаций
83. Преимущества государственного партнерства для государственного и частного сектора
84. Имеет ли право государство выпускать ценную бумагу «Акция», ответ обосновать.
85. Порядок выпуска Американской депозитарной расписки.
86. Чем представлен долговой рынок капитала?
87. Мировые облигации, положительные и отрицательные стороны
88. Акция и ее фундаментальные свойства
89. Суть метода анализа ценных бумаг по Марковицу
90. Назначение инвестиционного портфеля и портфеля ценных бумаг.

13. РАСПРЕДЕЛЕНИЕ БАЛЛОВ, КОТОРЫЕ ПОЛУЧАЮТ ОБУЧАЮЩИЕСЯ

Максимальное количество баллов за текущий контроль и самостоятельную работу										Максимальная сумма баллов		
Смысловый модуль 1				Смысловый модуль 2						Текущий контроль	Экзамен	Все виды учебной деятельности
T1	T2	T3	T4	T5	T6	T7	T8	T9	T10	40	60	100
2	2	2	4	5	5	5	5	5	5			

Соответствие государственной шкалы оценивания академической успеваемости

Сумма баллов за все виды учебной деятельности	По государственной шкале	Определение
90-100	«Отлично» (5)	отличное выполнение с незначительным количеством неточностей
80-89	«Хорошо» (4)	в целом правильно выполненная работа с незначительным количеством ошибок (до 10%)
75-79		в целом правильно выполненная работа с незначительным количеством ошибок (до 15%)
70-74	«Удовлетворительно» (3)	неплохо, но со значительным количеством недостатков
60-69		выполнение удовлетворяет минимальные критерии
35-59	«Неудовлетворительно» (2)	с возможностью повторной аттестации
0-34		с обязательным повторным изучением дисциплины (выставляется комиссией)

14. РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА

Основная литература:

Международные валютно-кредитные отношения : учебник / Н. Н. Мокеева, П.П. Князев, А. Е. Заборовская [и др.] ; Министерство науки и высшего образования Российской Федерации, Уральский федеральный университет имени первого Президента России Б. Н. Ельцина. - Екатеринбург : Изд-во Уральского университета, 2021. - 330 с. - URL: <http://catalog.donnuet.ru/>. - Режим доступа: Электронная библиотека ДОННУЭТ. – Текст : электронный. - ISBN ISBN 978-5-7996-3106.

Волков, А.Н. Мониторинг конъюнктуры финансовых рынков : учебное пособие / А.Н. Волков, А.Е. Заборовская. - Екатеринбург : АМБ, 2023. - 96 с. - URL: https://www.elibrary.ru/download/elibrary_53740401_29397408.pdf. - Режим доступа: Локальная компьютерная сеть НБ ДОННУЭТ. – Текст : электронный.

Финансы : учебное пособие / Л.Л. Игонина, М.В. Радченко, Э.В. Соболев, Н.В. Тимошенко ; ред. Л.Л. Игонина. - Москва : ООО "РУСАЙНС", 2023. - 296 с. - Библиогр.: с. 293-295. - Текст: непосредственный. - ISBN 978-5-466-02181-3.

Дополнительная литература:

Алешина, А. В. Финансовые рынки. Ч.1 : учебно-методическое пособие и практикум для изучения курса «Финансовые рынки»: базовый уровень / А. В. Алешина, А. Л. Булгаков, А. С. Крикунов. — 2-е изд. — Москва : Научный консультант, 2024. — 192 с. — ISBN 978-5-6040844-0-3. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/140412.html> (дата обращения: 04.01.2025). — Режим доступа: для авторизир. пользователей

Учебно-методические издания:

1. Малецкий А.В. Финансовый рынок [Электронный ресурс]: конспект лекций / А.В. Малецкий; М-во образования и науки ДНР, ГОВПО "Донец. нац. ун-т экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского", Каф. финансов . — Донецк : [ДонНУЭТ], 2020 . — Учеб.-метод. комплекс дисциплины.

2. Малецкий А.В. Финансовый рынок [Текст]: метод. указания и задания для практических и семинарских занятий для студентов направления подготовки 38.03.01 экономика, профиль «Финансы и кредит» оч. и заоч. форм обучения / А.В. Малецкий; М-во образования и науки ДНР, ГОВПО "Донец. нац. ун-т экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского", Каф. финансов . — Донецк : [ДонНУЭТ], 2019 . — Учеб.-метод. комплекс дисциплины.

3. Малецкий А.В. Финансовый рынок [Текст] : метод. указания. для самостоятельной работы студентов направления подготовки 38.03.01 экономика, профиль «Финансы и кредит» очной и заочной форм обучения / А.В. Малецкий; М-во образования и науки ДНР, ГОВПО "Донец. нац. ун-т экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского", Каф. финансов . — Донецк : [ДонНУЭТ], 2019 . — Учеб.-метод. комплекс дисциплины.

4. Малецкий А.В. Финансовый рынок [Текст] : индивид. задания для студентов направления подготовки 38.03.01 «Экономика» (профиль «Финансы и кредит» очной и заочной форм обучения / А.В. Малецкий; М-во образования и науки ДНР, ГОВПО "Донец. нац. ун-т экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского", Каф. финансов . — Донецк : [ДонНУЭТ], 2019 . — Учеб.-метод. комплекс дисциплины.

5. Дистанционный курс в системе Moodle. [Электронный ресурс] / Режим доступа: <http://distant.donnuet.education/>

15. ИНФОРМАЦИОННЫЕ РЕСУРСЫ

1. Автоматизированная библиотечная информационная система Unilib UC : версия 2.110 // Научная библиотека Донецкого национального университета экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского. – [Донецк, 2021–]. – Текст : электронный.

2. Электронный каталог Научной библиотеки Донецкого национального университета экономики и торговли им. Михаила Туган-Барановского. – Донецк : НБ ДОННУЭТ, 1999– . – URL:<http://catalog.donnuet.ru>. – Текст : электронный.

3. Автоматизированная интегрированная библиотечная система (АИБС) «МегаПро». – Москва : ООО «Дата Экспресс», 2024– . – Текст : электронный.

4. IPR SMART : весь контент ЭБС Irg books : цифровой образовательный ресурс / ООО «Ай Пи Эр Медиа». – Саратов : Ай Пи Эр Медиа, 2007 –. – URL:<http://www.iprbookshop.ru>. – Режим доступа: для авторизованных пользователей. – Текст. Аудио. Изображения : электронные.

5. Лань : электронная-библиотечная система. – Санкт-Петербург : Лань, сор. 2011–2024. – URL:<https://e.lanbook.com/> – Режим доступа: для авторизованных пользователей. – Текст : электронный.

6. СЭБ : Консорциум сетевых электронных библиотек / Электронная-библиотечная система «Лань» при поддержке Агентства стратегических инициатив. – Санкт-Петербург : Лань, сор. 2011–2024. – URL:<https://seb.e.lanbook.com/> – Режим доступа : для пользователей организаций – участников, подписчиков ЭБС «Лань». – Текст : электронный.

7. Polpred : электронная библиотечная система : деловые статьи и интернет-сервисы / ООО «Полпред Справочники». – Москва : Полпред Справочники, сор. 1997–2024. – URL:<https://polpred.com>. – Текст : электронный.

8. Book on lime : дистанционное образование : электронная библиотечная система / издательство КДУ МГУ им. М.В. Ломоносова. – Москва : КДУ, сор. 2017 –. – URL:<https://bookonlime.ru>. – Текст . Изображение. Устная речь : электронные.

9. Информо : электронный справочник / ООО «РИНФИЦ». – Москва : Издательский дом «Информо», 2009 –. – URL: <https://www.informio.ru>. – Текст : электронный.

10. Университетская библиотека онлайн : электронная библиотечная система. – ООО «Директ-Медиа», 2006–. – URL:<https://biblioclub.ru/> – Режим доступа: для авторизованных пользователей. – Текст : электронный.

11. Научно-информационный библиотечный центр имени академика Л.И. Абалкина / Российский экономический университет имени В.Г. Плеханова. – Москва : KnowledgeTree Inc., 2008– . – URL:<http://liber.rea.ru/login.php>. – Режим доступа: для авторизованных пользователей. – Текст : электронный.

12. Библиотечно-информационный комплекс / Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации. – Москва : Финансовый университет, 2019– . – URL:<http://library.fa.ru/> – Режим доступа: для авторизованных пользователей. – Текст : электронный.

13. Зональная научная библиотека имени Ю.А. Жданова / Южный федеральный университет. – Ростов-на-Дону : Южный федеральный университет, 2016 – . – URL:<https://library.lib.sfedu.ru/> – Режим доступа: для авторизованных пользователей. – Текст : электронный.

14. Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU: информационно- аналитический портал / ООО Научная электронная библиотека. – Москва : ООО Научная электронная библиотека, сор. 2000–2024. – URL:<https://elibrary.ru>. – Режим доступа: для зарегистрированных пользователей. – Текст : электронный.

15. CYBERLENINKA : Научная электронная библиотека «КиберЛенинка» / [Е. Кисляк, Д. Семячкин, М. Сергеев ; ООО «Итеос»]. – Москва : КиберЛенинка, 2012 – . – URL:<http://cyberleninka.ru>. – Текст : электронный.

16. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Минимально необходимый для реализации ОПОП ВО бакалавриата перечень материально-технического обеспечения включает аудиторный фонд в соответствии с утвержденным

расписанием с использованием мультимедийного демонстрационного комплекса кафедры банковского дела (проектор, ноутбук).

17. КАДРОВОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Фамилия, имя, отчества	Условия привлечения (по основному месту работы, на условиях внутреннего/ внешнего совместительства; на условиях договора гражданско-правового характера (далее – договор ГПХ)	Должность, ученая степень, ученое звание	Уровень образования, наименование специальности, направления подготовки, наименование присвоенной квалификации	Сведения о дополнительном профессиональном образовании
Жильцова Кристина Игоревна	По основному месту работы	Доцент, к.э.н., ученое звание отсутствует	Высшее, финансы и кредит, профессионал в сфере финансовой деятельности, магистр, диплом кандидата наук КА №000413	<p>1. Удостоверение о ПК №771802829956, 27.05.2022 «Работа в электронной информационно-образовательной среде», 16 ч. ФГБОУВО "Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова", Москва.</p> <p>2. Сертификат о ПК №2557, 07.07.2022 «Инновационные технологии в профессиональном образовании», 36 ч. УО "Республиканский институт профессионального образования", Минск.</p> <p>3. Удостоверение о ПК №612400026348, 21.09.2022 «Актуальные вопросы преподавания в образовательных учреждениях высшего образования: нормативно-правовое, психолого-педагогическое и методическое сопровождение», 24 ч. ФГБОУ ВО "Донской государственный технический университет", Ростов-на-Дону</p> <p>4. Удостоверение о ПК №612400036367, 08.09.2023 «Организационно-методические аспекты разработки и реализации программ высшего</p>

				<p>образования по направлению подготовки Экономика и управление», 36 ч. ФГБОУ ВО "Донской государственный технический университет", Ростов-на-Дону</p> <p>5. Удостоверение о ПК 0068-02/2023, 20.11.2023</p> <p>«Финансово-здоровое поведение населения как драйвер устойчивого роста экономики», 36 ч. Ассоциация развития финансовой грамотности, Москва</p>
--	--	--	--	--

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.ДВ.11.02 АНАЛИЗ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ

Направление подготовки 38.03.01 Экономика

Профиль: Банковское дело

Трудоемкость учебной дисциплины: 3 з.е.

Планируемые результаты обучения по учебной дисциплине:

знать: закономерности развития финансового рынка в целом, а также цикличность динамики рынка ценных бумаг; функции и принципы организации деятельности профессиональными участниками рынка ценных бумаг; основные закономерности развития финансовых рынков, а также статистические показатели, используемые на рынке ценных бумаг для оценки динамики его развития; виды ценных бумаг, принципы их выпуска и обращения, а также закономерности выбора компанией источника финансирования в зависимости от стадии жизненного цикла компании и цикла развития финансового рынка; правила регулирования рынка ценных бумаг, функции государственного регулятора рынка ценных бумаг и саморегулируемых организаций.

уметь: обобщать и систематизировать информацию, характеризующую деятельность компаний на рынке ценных бумаг; анализировать основные показатели результатов торгов ценными бумагами на фондовой бирже с использованием информации, представленной на сайтах фондовых бирж, рейтинговых агентств и инвестиционных компаний; использовать для выполнения аналитических заданий современные технические средства и информационные технологии; оценивать условия и последствия принимаемых управленческих решений на рынке ценных бумаг по привлечению и размещению капитала; анализировать основные финансовые показатели, характеризующие ценные бумаги.

владеть: методологией экономического исследования на макроуровне; методами планирования проведения научного исследования и совокупностью способов и приемов в области исследования методов и инструментов валютного регулирования; навыками применения инструментов сравнительного и ситуационного анализа.

Компетенции выпускников и индикаторы их достижения:

<i>Код и наименование компетенции</i>	<i>Код и наименование индикатора достижения компетенции</i>
ПК-13 Способен осуществлять мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты с целью консультирования клиентов по использованию финансовых продуктов и услуг	ИД-1 _{ПК-13} Осуществляет сбор, обработку и анализ информации о состоянии финансового рынка, изучает спрос и предложения на рынке финансовых услуг; ИД-2 _{ПК-13} Выбирает и обосновывает выбор инструментальных средств для обработки финансовой и иной экономической информации; ИД-4 _{ПК-13} Составляет аналитические заключения, рейтинги, прогнозы с целью предотвращения сделок с недобросовестными партнерами.

Наименование смысловых модулей и тем учебной дисциплины:

Смысловой модуль 1. Общие основы функционирования финансового рынка. Тема 1. Финансовый рынок: сущность, функции и роль в экономике. Тема 2. Инфраструктура финансового рынка: основные участники и инструменты. Тема 3. Регулирование финансового рынка. Тема 4. Рынок долгового капитала.

Смысловой модуль 2. Организация деятельности рынка ценных бумаг. Тема 5. Рынок акций. Тема 6. Рынок производных ценных бумаг. Тема 7. Международные рынки капитала. Тема 8. Денежный рынок и рынок банковских займов. Тема 9. Государственные ценные бумаги. Тема 10. Валютный рынок.

Форма промежуточной аттестации: зачет

Разработчик

Жильцова Кристина Игоревна, к.э.н.,
доцент кафедры банковского дела

Заведующий кафедрой банковского дела

Попова Ирина Витальевна, д.э.н., доцент

