МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РФ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования

«ТОМСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ СИСТЕМ
УПРАВЛЕНИЯ И РАДИОЭЛЕКТРОНИКИ»
(ТУСУР)

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по учебной работе
_____ П. Е. Троян
«___» _____ 20__ г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Финансовые инструменты и институты

Уровень образования: **высшее образование - бакалавриат**
Направление подготовки (специальность): **38.03.02 Менеджмент**
Направленность (профиль): **Финансовый менеджмент**
Форма обучения: **очная**
Факультет: **ЭФ, Экономический факультет**
Кафедра: **экономики, Кафедра экономики**
Курс: **2**
Семестр: **4**
Учебный план набора 2017 года

Распределение рабочего времени

№	Виды учебной деятельности	4 семестр	Всего	Единицы
1	Лекции	36	36	часов
2	Практические занятия	36	36	часов
3	Всего аудиторных занятий	72	72	часов
4	Самостоятельная работа	36	36	часов
5	Всего (без экзамена)	108	108	часов
6	Общая трудоемкость	108	108	часов
		3.0	3.0	З.Е

Зачет: 4 семестр

Томск 2017

Согласована на портале № 20752

Рассмотрена и одобрена на заседании кафедры
протокол № 6 от «16» 5 2017 г.

ЛИСТ СОГЛАСОВАНИЙ

Рабочая программа составлена с учетом требований федерального государственного образовательного стандарта высшего образования (ФГОС ВО) по направлению подготовки (специальности) 38.03.02 Менеджмент, утвержденного 12 января 2016 года, рассмотрена и утверждена на заседании кафедры «___» _____ 20__ года, протокол №_____.

Разработчик:

Доцент каф. Экономики _____ В. Ю. Цибульникова

Заведующий обеспечивающей каф. экономики _____ М. В. Рыжкова

Рабочая программа согласована с факультетом, профилирующей и выпускающей кафедрами направления подготовки (специальности).

Декан ЭФ _____ А. В. Богомолова

Заведующий выпускающей каф. экономики _____ М. В. Рыжкова

Эксперт:

доцент каф. Экономики _____ Л. В. Земцова

Согласована на портале № 20752

1. Цели и задачи дисциплины

1.1. Цели дисциплины

Целью преподавания дисциплины «Финансовые рынки» является:

- формирование у студентов системы знаний и устойчивых представлений о сущности, структуре, функциях и механизме функционирования финансовых рынков, финансовых институтов и инструментов;

- выработка умений и практических навыков, необходимых для деятельности финансового института или финансовой службы корпорации на разных уровнях менеджмента;

- развитие способности и готовности адекватно и эффективно использовать приобретенные знания, умения и навыки для достижения целей развития организации.

1.2. Задачи дисциплины

– - рассмотрение связанных с теорией, организацией и функционированием основных финансовых рынков вопросов, в состав которых входят: сущность, функции и классификация финансовых рынков; фондовый рынок и его участники; рынок ссудного капитала; страховой рынок и его организация; риски на финансовом рынке и основные методы управления риском;

– - изучение фундаментальных основ финансовой системы, современных особенностей работы финансовых рынков, структуры финансовых инструментов, ключевых финансовых инноваций в развивающейся рыночной экономике;

– - знакомство с практической деятельностью институтов, составляющих инфраструктуру финансовой системы.

–

2. Место дисциплины в структуре ОПОП

Дисциплина «Финансовые инструменты и институты» (Б1.В.ОД.3) относится к блоку 1 (вариативная часть).

Предшествующими дисциплинами, формирующими начальные знания, являются следующие дисциплины: Макроэкономика, Финансовые вычисления.

Последующими дисциплинами являются: Управление портфелем финансовых активов, Управление рисками, Финансово-экономическая оценка инвестиций, Финансовый менеджмент, Фундаментальный анализ на финансовых рынках.

3. Требования к результатам освоения дисциплины

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

– ПК-16 владением навыками оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов;

В результате изучения дисциплины студент должен:

– **знать** • основные понятия, категории и инструменты экономической теории и прикладных экономических дисциплин; • основы построения, расчета и анализа современной системы показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов на микро- и макроуровне; • основные особенности российской экономики, ее институциональную структуру, направления экономической политики государства;

– **уметь** • применять понятийно-категориальный аппарат в профессиональной деятельности; • осуществлять поиск информации по полученному заданию, сбор, анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач; • использовать источники экономической, социальной, управленческой информации; • анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей; • осуществлять поиск информации по полученному заданию, сбор, анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач;

– **владеть** • методологией экономического исследования; • современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных; • современными методиками расчета и анализа социально-экономических показателей, характеризующих экономические процессы и явления на микро- и макроуровне; • навыками извлечения необходимой информации из оригиналь-

Согласована на портале № 20752

ного текста на иностранном языке по проблемам экономики и бизнеса.

4. Объем дисциплины и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3.0 зачетных единицы и представлена в таблице 4.1.

Таблица 4.1 – Трудоемкость дисциплины

Виды учебной деятельности	Всего часов	Семестры
		4 семестр
Аудиторные занятия (всего)	72	72
Лекции	36	36
Практические занятия	36	36
Самостоятельная работа (всего)	36	36
Проработка лекционного материала	16	16
Самостоятельное изучение тем (вопросов) теоретической части курса	4	4
Подготовка к практическим занятиям, семинарам	16	16
Всего (без экзамена)	108	108
Общая трудоемкость ч	108	108
Зачетные Единицы	3.0	3.0

5. Содержание дисциплины

5.1. Разделы дисциплины и виды занятий

Разделы дисциплины и виды занятий приведены в таблице 5.1.

Таблица 5.1 – Разделы дисциплины и виды занятий

Названия разделов дисциплины	Лекции	Практические занятия	Самостоятельная работа	Всего часов (без экзамена)	Формируемые компетенции
4 семестр					
1 СУЩНОСТЬ И СТРУКТУРА ФИНАНСОВОГО РЫНКА	4	4	4	12	ПК-16
2 РЫНОК КАПИТАЛОВ	7	8	5	20	ПК-16
3 МЕЖДУНАРОДНЫЙ ВАЛЮТНЫЙ РЫНОК	4	8	6	18	ПК-16
4 РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ	6	4	9	19	ПК-16
5 РЫНОК ДРАГОЦЕННЫХ МЕТАЛЛОВ	4	6	5	15	ПК-16
6 СТРАХОВОЙ РЫНОК	5	0	4	9	ПК-16
7 РИСК И ДОХОДНОСТЬ НА ФИНАНСОВЫХ РЫНКАХ	6	6	3	15	ПК-16
Итого за семестр	36	36	36	108	
Итого	36	36	36	108	

Согласована на портале № 20752

5.2. Содержание разделов дисциплины (по лекциям)

Содержание разделов дисциплин (по лекциям) приведено в таблице 5.2.

Таблица 5.2 - Содержание разделов дисциплин (по лекциям)

Названия разделов	Содержание разделов дисциплины по лекциям	Трудоемкость, ч	Формируемые компетенции
4 семестр			
1 СУЩНОСТЬ И СТРУКТУРА ФИНАНСОВОГО РЫНКА	Лекция 1. Введение в финансовый рынок. Сущность финансового рынка Основные понятия о финансах, финансовой системе, финансовом рынке, финансовых инструментах. Субъекты финансового рынка. Сбережения и инвестиции. Фиктивный капитал и механизм его накопления. Функции финансового рынка.Лекция 2. Структура финансового рынка. Перспективы развитияНекоторые подходы к классификации финансовых рынков. Виды финансовых рынков (рынок капиталов, рынок ссудных капиталов, учетный рынок, денежный рынок, кредитный рынок, межбанковский рынок, валютный рынок, рынок ценных бумаг (фондовый рынок), рынок производных инструментов, деривативы, страховой рынок, первичный и вторичный рынок, рынок драгоценных металлов). Специфические особенности составляющих финансового рынка. Место финансового рынка в системе рыночных отношений. Влияние процесса глобализации в мировой экономике на развитие финансовых рынков.	4	ПК-16
	Итого	4	
2 РЫНОК КАПИТАЛОВ	Лекция 3. Рынок капиталов. Денежный рынок Ссудный капитал как основа рынка капиталов. Денежный рынок в системе формирования и развития рыночных отношений. Общность функций и специфические отличия составляющих денежного рынка. Лекция 4. Рынок капиталов. Учетный и межбанковский рынки Характеристика учетного рынка. Виды ценных бумаг и их характеристика. Суть межбанковского рынка. Межбанковские депозиты и сроки привлечения свободных денежных ресурсов.Направления использования средств межбанковско-	7	ПК-16

Согласована на портале № 20752

	го рынка. Характеристика межбанковских операций. Лекция 5. Рынок капиталов. Характеристика кредитного рынка Содержание и принципы формирования кредитных ресурсов. Источники образования кредитных ресурсов. Функции и формы международного кредита. Лекция 6. Рынок капиталов. Влияние кредита на развитие макроэкономических процессов Регулирующая роль кредита в развитии макроэкономических процессов. Синдицированное кредитование как основной инструмент привлечения финансовых ресурсов на международном рынке.		
	Итого	7	
3 МЕЖДУНАРОДНЫЙ ВАЛЮТНЫЙ РЫНОК	Лекция 7. Международный валютный Рынок. Сущность и основные понятия Понятие валютного рынка. Характерные черты международного валютного рынка. Специфика международных расчетов. Валютный курс и его виды.Лекция 8. Международный валютный Рынок. Характеристика валютных операций Виды валютных операций и механизм их осуществления. Паритеты покупательной способности и процентных ставок. Основные тенденции развития валютного рынка.	4	ПК-16
	Итого	4	
4 РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ	Лекция 9. Рынок ценных бумаг. Общая характеристика Понятие ценной бумаги. Основные виды и классификация ценных бумаг. Сущность рынка ценных бумаг и его структура. Участники рынка ценных бумаг.Лекция 10. Рынок ценных бумаг. характеристика международного рынка акцийПонятие и основные характеристики акции. Сущность международного рынка акций. Депозитарные расписки как основная составляющая международного рынка акций. Виды депозитарных расписок. Российские депозитарные расписки.Лекция 11. Рынок ценных бумаг. Характеристика международного рынка облигаций Сущность еврооблигаций. Участники рынка облигаций. Классификация еврооблигаций. Порядок выпуска и размещения еврооблигаций. Оценка инвестиционной привле-	6	ПК-16

Согласована на портале № 20752

	кательности еврооблигаций.Лекция 12. Рынок ценных бумаг. Характеристика Международного рынка производных ценных бумаг Регулирование международного рынка производных ценных бумаг. Форвардные и фьючерсные контракты. Международный рынок опционов. Кредитные деривативы		
	Итого	6	
5 РЫНОК ДРАГОЦЕННЫХ МЕТАЛЛОВ	Лекция 13. Характеристика Международного рынка драгоценных металлов Содержание и виды международного рынка драгоценных металлов. Участники международного рынка драгоценных металлов.Лекция 14. Основы операций с драгоценными металлами Ценообразование на рынке драгоценных металлов. Операции с золотом на мировом рынке драгоценных металлов.	4	ПК-16
	Итого	4	
6 СТРАХОВОЙ РЫНОК	Лекция 15. Страховой рынок. Общая характеристика Сущность и структура страхового рынка. Принципы функционирования и участники страхового рынка. Виды страхования финансовых рисков.Лекция 16. Страховой рынок. Специфические виды страхования и тенденции развития Страхование финансовых инвестиций и гарантий. Хеджирование. Тенденции развития страхового рынка.	5	ПК-16
	Итого	5	
7 РИСК И ДОХОДНОСТЬ НА ФИНАНСОВЫХ РЫНКАХ	Лекция 17. Основные критерии эффективности инвестиционных вложений на финансовых рынках Сущность и классификация финансовых рисков. Взаимосвязь основных критериев инвестиционных качеств объектов инвестирования. Сравнительная характеристика инвестиционных критериев для различных финансовых рынков.Лекция 18. Риск и доходность. Управление различными видами рисков Методы управления финансовыми рисками. Способы снижения риска.	6	ПК-16
	Итого	6	
Итого за семестр		36	

5.3. Разделы дисциплины и междисциплинарные связи с обеспечивающими (предыдущими) и обеспечиваемыми (последующими) дисциплинами

Разделы дисциплины и междисциплинарные связи с обеспечивающими (предыдущими) и

Согласована на портале № 20752

обеспечиваемыми (последующими) дисциплинами представлены в таблице 5.3.
Таблица 5.3 - Разделы дисциплины и междисциплинарные связи

Наименование дисциплин	№ разделов данной дисциплины, для которых необходимо изучение обеспечивающих и обеспечиваемых дисциплин						
	1	2	3	4	5	6	7
Предшествующие дисциплины							
1 Макроэкономика	+	+	+	+	+		
2 Финансовые вычисления		+					
Последующие дисциплины							
1 Управление портфелем финансовых активов		+	+	+	+	+	
2 Управление рисками						+	+
3 Финансово-экономическая оценка инвестиций				+		+	+
4 Финансовый менеджмент		+		+			
5 Фундаментальный анализ на финансовых рынках		+	+	+	+		

5.4. Соответствие компетенций, формируемых при изучении дисциплины, и видов занятий

Соответствие компетенций, формируемых при изучении дисциплины, и видов занятий представлено в таблице 5.4

Таблица 5.4 – Соответствие компетенций и видов занятий, формируемых при изучении дисциплины

Компетенции	Виды занятий			Формы контроля
	Лекции	Практические занятия	Самостоятельная работа	
ПК-16	+	+	+	Опрос на занятиях, Расчетная работа, Тест

6. Интерактивные методы и формы организации обучения

Не предусмотрено РУП

7. Лабораторные работы

Не предусмотрено РУП

8. Практические занятия (семинары)

Наименование практических занятий (семинаров) приведено в таблице 8.1.

Таблица 8. 1 – Наименование практических занятий (семинаров)

Названия разделов	Наименование практических занятий (семинаров)	Трудоемкость, ч	Формируемые компетенции

Согласована на портале № 20752

4 семестр			
1 СУЩНОСТЬ И СТРУКТУРА ФИНАНСОВОГО РЫНКА	Сущность и структура финансового рынка. Основные инструменты учетного рынка	4	ПК-16
	Итого	4	
2 РЫНОК КАПИТАЛОВ	Межбанковский рынок. Синдицированное кредитование	8	ПК-16
	Итого	8	
3 МЕЖДУНАРОДНЫЙ ВАЛЮТНЫЙ РЫНОК	Международный валютный рынок. Валютные курсы и паритететы покупательной способности	8	ПК-16
	Итого	8	
4 РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ	Рынок ценных бумаг. Основные участники и инструментыРынок ценных бумаг. Применение производных инструментов	4	ПК-16
	Итого	4	
5 РЫНОК ДРАГОЦЕННЫХ МЕТАЛЛОВ	Международный рынок драгоценных металлов. Операции с золотом	6	ПК-16
	Итого	6	
7 РИСК И ДОХОДНОСТЬ НА ФИНАНСОВЫХ РЫНКАХ	Страхование финансовых операций-Риск и доходность на финансовых рынках	6	ПК-16
	Итого	6	
Итого за семестр		36	

9. Самостоятельная работа

Виды самостоятельной работы, трудоемкость и формируемые компетенции представлены в таблице 9.1.

Таблица 9.1 - Виды самостоятельной работы, трудоемкость и формируемые компетенции

Названия разделов	Виды самостоятельной работы	Трудоемкость, ч	Формируемые компетенции	Формы контроля
4 семестр				
1 СУЩНОСТЬ И СТРУКТУРА ФИНАНСОВОГО РЫНКА	Проработка лекционного материала	4	ПК-16	Опрос на занятиях, Тест
	Итого	4		
2 РЫНОК КАПИТАЛОВ	Подготовка к практическим занятиям, семинарам	2	ПК-16	Опрос на занятиях, Тест
	Самостоятельное изучение тем (вопросов) теоретической части курса	2		

Согласована на портале № 20752

	Проработка лекционного материала	1		
	Итого	5		
3 МЕЖДУНАРОДНЫЙ ВАЛЮТНЫЙ РЫНОК	Подготовка к практическим занятиям, семинарам	2	ПК-16	Опрос на занятиях, Тест
	Проработка лекционного материала	4		
	Итого	6		
4 РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ	Подготовка к практическим занятиям, семинарам	6	ПК-16	Опрос на занятиях, Тест
	Самостоятельное изучение тем (вопросов) теоретической части курса	2		
	Проработка лекционного материала	1		
	Итого	9		
5 РЫНОК ДРАГОЦЕННЫХ МЕТАЛЛОВ	Подготовка к практическим занятиям, семинарам	4	ПК-16	Опрос на занятиях, Тест
	Проработка лекционного материала	1		
	Итого	5		
6 СТРАХОВОЙ РЫНОК	Проработка лекционного материала	4	ПК-16	Опрос на занятиях, Тест
	Итого	4		
7 РИСК И ДОХОДНОСТЬ НА ФИНАНСОВЫХ РЫНКАХ	Подготовка к практическим занятиям, семинарам	2	ПК-16	Опрос на занятиях, Тест
	Проработка лекционного материала	1		
	Итого	3		
Итого за семестр		36		
Итого		36		

9.1. Темы для самостоятельного изучения теоретической части курса

1. Технология применения российских депозитарных расписок в инвестиционной практике компаний (лекция № 10)
2. Что представляют собой российские депозитарные расписки?
3. Когда появились российские депозитарные расписки и для чего они впервые были выпущены?
4. Зачем в настоящее время инвесторы используют российские депозитарные расписки?
5. Есть ли выгоды для инвесторов при инвестировании в РДР?
6. Какова процедура выпуска РДР?
7. Порядок выпуска и размещения еврооблигаций (лекция № 11)
8. Разберитесь со схемой выпуска и размещения еврооблигаций.

Согласована на портале № 20752

9. Какие этапы необходимо пройти предприятию, чтобы выпустить еврооблигации?
10. Кто занимается размещением еврооблигаций?
11. Кто преимущественно инвестирует в еврооблигации?
12. Какую доходность могут показывать еврооблигации?
13. Приведите примеры известных вам еврооблигаций.
14. Кто чаще всего эмитирует еврооблигации?
15. Влияние процесса глобализации в мировой экономике на развитие финансовых рынков (лекция № 2)
16. Необходимо изучить понятие глобализации, причины и последствия глобализации; выяснить, почему глобализация оказывает существенное влияние на функционирование финансовых рынков.
17. Каковы, на ваш взгляд, положительные и отрицательные проявления глобализации применительно к финансовым рынкам?
18. Методика расчета вексельной стоимости (лекция № 4)
19. Необходимо изучить специальную литературу по теме «Вексель и вексельное обращение» и разобраться в методике расчета вексельной стоимости.
20. Для чего необходим подобный расчет, где он может применяться?
21. Почему учет векселей производится отдельно и применяется механизм «учетной ставки»?
22. Методика расчетов при синдицированном кредитовании (лекция № 6)
23. Разберитесь с методикой расчета сумм платежей и сумм кредитов при использовании различных схем синдицированного кредитования.
24. Для чего необходимо синдицированное кредитование в экономике?
25. В каких сферах может применяться механизм синдицированного кредита?
26. Специфика международных расчетов (лекция № 6)
27. В чем особенности международных расчетов?
28. Какие организации используют возможности международных расчетов?
29. Каковы методика международных расчетов?

10. Курсовая работа (проект)

Не предусмотрено РУП

11. Рейтинговая система для оценки успеваемости студентов

11.1. Балльные оценки для элементов контроля

Таблица 11.1 – Балльные оценки для элементов контроля

Элементы учебной деятельности	Максимальный балл на 1-ую КТ с начала семестра	Максимальный балл за период между 1КТ и 2КТ	Максимальный балл за период между 2КТ и на конец семестра	Всего за семестр
4 семестр				
Опрос на занятиях	5	10	10	25
Расчетная работа	10	15	20	45
Тест	5	10	15	30
Итого максимум за период	20	35	45	100
Нарастающим итогом	20	55	100	100

11.2. Пересчет баллов в оценки за контрольные точки

Пересчет баллов в оценки за контрольные точки представлен в таблице 11.2.

Таблица 11. 2 – Пересчет баллов в оценки за контрольные точки

Баллы на дату контрольной точки	Оценка
≥ 90% от максимальной суммы баллов на дату КТ	5

Согласована на портале № 20752

От 70% до 89% от максимальной суммы баллов на дату КТ	4
От 60% до 69% от максимальной суммы баллов на дату КТ	3
< 60% от максимальной суммы баллов на дату КТ	2

11.3. Пересчет суммы баллов в традиционную и международную оценку

Пересчет суммы баллов в традиционную и международную оценку представлен в таблице 11.3.

Таблица 11. 3 – Пересчет суммы баллов в традиционную и международную оценку

Оценка (ГОС)	Итоговая сумма баллов, учитывает успешно сданный экзамен	Оценка (ECTS)
5 (отлично) (зачтено)	90 - 100	A (отлично)
4 (хорошо) (зачтено)	85 - 89	B (очень хорошо)
	75 - 84	C (хорошо)
	70 - 74	D (удовлетворительно)
3 (удовлетворительно) (зачтено)	65 - 69	
	60 - 64	E (посредственно)
2 (неудовлетворительно) (не зачтено)	Ниже 60 баллов	F (неудовлетворительно)

12. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

12.1. Основная литература

1. Финансовые рынки: Учебно-методический комплекс / Цибульникова В. Ю., Буймов А. Г. - 2014. 396 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/6637, дата обращения: 26.05.2017.

12.2. Дополнительная литература

1. Финансовые рынки [Текст] : учебное пособие / Т. К. Блохина. - М. : Российский университет дружбы народов, 2009. - 199 с. (наличие в библиотеке ТУСУР - 6 экз.)
2. Суэтин А.А. Финансовые рынки в мировой экономике: учебник. — М.: ЭКОНОМИСТЪ, 2008. — 586 с. (наличие в библиотеке ТУСУР - 10 экз.)

12.3 Учебно-методические пособия

12.3.1. Обязательные учебно-методические пособия

1. Финансовые рынки: Методические указания к практическим занятиям для студентов направления 080100.62 «Экономика» / Цибульникова В. Ю. - 2014. 66 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/3908, дата обращения: 26.05.2017.
2. Финансовые инструменты и институты: Методические указания к практическим занятиям и самостоятельной работе / Цибульникова В. Ю. - 2017. 21 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/6956, дата обращения: 26.05.2017.

12.3.2 Учебно-методические пособия для лиц с ограниченными возможностями здоровья

Учебно-методические материалы для самостоятельной и аудиторной работы обучающихся из числа инвалидов предоставляются в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации.

Для лиц с нарушениями зрения:

- в форме электронного документа;
- в печатной форме увеличенным шрифтом.

Для лиц с нарушениями слуха:

- в форме электронного документа;
- в печатной форме.

Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

Согласована на портале № 20752

– в форме электронного документа;
– в печатной форме.

12.4. Базы данных, информационно-справочные, поисковые системы и требуемое программное обеспечение

1. Научно-образовательный портал университета, электронный каталог библиотеки ТУСУРа, электронная библиотечная система «ЛАНЬ», информационно-правовая система по законодательству Российской Федерации – «ГАРАНТ» (http://www.garant.ru), компьютерная справочно-правовая система по законодательству России — «Консультант Плюс» (http://www.consultant.ru/online/).

13. Материально-техническое обеспечение дисциплины

13.1. Общие требования к материально-техническому обеспечению дисциплины

13.1.1. Материально-техническое обеспечение для лекционных занятий

Для проведения лекционных и практических занятий на базе интерактивных методов необходим доступ в Интернет из компьютерных классов, а также наличие цифрового проектора или ЖК-телевизора (плазменной панели) для применения современных обучающих мультимедиа-технологий.

13.1.2. Материально-техническое обеспечение для практических занятий

Для проведения практических (семинарских) занятий используется учебная аудитория, расположенная по адресу 634034, Томская область, г. Томск, Красноармейская улица, д. 146, 6 этаж, ауд. 611. Состав оборудования: Учебная мебель; Доска магнитно-маркерная -1шт.; Коммутатор D-Link Switch 24 port - 1шт.; Компьютеры класса не ниже ПЭВМ INTEL Celeron D336 2.8ГГц. -30 шт. Используется лицензионное программное обеспечение, пакеты версией не ниже: Microsoft Windows XP Professional with SP3/Microsoft Windows 7 Professional with SP1; Microsoft Windows Server 2008 R2; Visual Studio 2008 EE with SP1; Microsoft Office Visio 2010; Microsoft Office Access 2003; VirtualBox 6.2. Имеется помещения для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования.

13.1.3. Материально-техническое обеспечение для самостоятельной работы

Для самостоятельной работы используется учебная аудитория (компьютерный класс), расположенная по адресу 634034, г. Томск, ул. Красноармейская, 146, 2 этаж, ауд. 204. Состав оборудования: учебная мебель; компьютеры класса не ниже ПЭВМ INTEL Ce1егоп D336 2.8ГГц. - 7 шт.; компьютеры подключены к сети ИНТЕРНЕТ и обеспечивают доступ в электронную информационно-образовательную среду университета.

13.2. Материально-техническое обеспечение дисциплины для лиц с ограниченными возможностями здоровья

Освоение дисциплины лицами с ОВЗ осуществляется с использованием средств обучения общего и специального назначения.

При обучении студентов **с нарушениями слуха** предусмотрено использование звукоусиливающей аппаратуры, мультимедийных средств и других технических средств приема/передачи учебной информации в доступных формах для студентов с нарушениями слуха, мобильной системы обучения для студентов с инвалидностью, портативной индукционной системы. Учебная аудитория, в которой обучаются студенты с нарушением слуха, оборудована компьютерной техникой, аудиотехникой, видеотехникой, электронной доской, мультимедийной системой.

При обучении студентов **с нарушениями зрениями** предусмотрено использование в лекционных и учебных аудиториях возможности просмотра удаленных объектов (например, текста на доске или слайда на экране) при помощи видеоувеличителей для удаленного просмотра.

При обучении студентов **с нарушениями опорно-двигательного аппарата** используются альтернативные устройства ввода информации и другие технические средства приема/передачи учебной информации в доступных формах для студентов с нарушениями опорно-двигательного аппарата, мобильной системы обучения для людей с инвалидностью.

Согласована на портале № 20752

14. Фонд оценочных средств

14.1. Основные требования к фонду оценочных средств и методические рекомендации

Фонд оценочных средств и типовые контрольные задания, используемые для оценки сформированности и освоения закрепленных за дисциплиной компетенций при проведении текущей, промежуточной аттестации по дисциплине приведен в приложении к рабочей программе.

В рамках изучения дисциплины «Финансовые рынки» студенту потребуется современная литература и возможность доступа в Интернет для поиска необходимой информации. Так как до изучения данной дисциплины в учебном плане предусмотрены различные предметы, которые предоставляют базовые знания о финансах, то изучение данной дисциплины не будет представлять сложностей.

Финансовые рынки охватывают множество аспектов мировой финансовой системы, поэтому для более детальной подготовки к практическим занятиям рекомендуется изучать узконаправленную литературу по предложенным вопросам.

14.2 Требования к фонду оценочных средств для лиц с ограниченными возможностями здоровья

Для студентов с инвалидностью предусмотрены дополнительные оценочные средства, перечень которых указан в таблице.

Таблица 14 – Дополнительные средства оценивания для студентов с инвалидностью

Категории студентов	Виды дополнительных оценочных средств	Формы контроля и оценки результатов обучения
С нарушениями слуха	Тесты, письменные самостоятельные работы, вопросы к зачету, контрольные работы	Преимущественно письменная проверка
С нарушениями зрения	Собеседование по вопросам к зачету, опрос по терминам	Преимущественно устная проверка (индивидуально)
С нарушениями опорно-двигательного аппарата	Решение дистанционных тестов, контрольные работы, письменные самостоятельные работы, вопросы к зачету	Преимущественно дистанционными методами
С ограничениями по общемедицинским показаниям	Тесты, письменные самостоятельные работы, вопросы к зачету, контрольные работы, устные ответы	Преимущественно проверка методами, исходя из состояния обучающегося на момент проверки

14.3 Методические рекомендации по оценочным средствам для лиц с ограниченными возможностями здоровья

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

- в печатной форме;
- в печатной форме с увеличенным шрифтом;
- в форме электронного документа;
- методом чтения ассистентом задания вслух;
- предоставление задания с использованием сурдоперевода.

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;
- набор ответов на компьютере;
- набор ответов с использованием услуг ассистента;
- представление ответов устно.

Процедура оценивания результатов обучения инвалидов по дисциплине предусматривает предоставление информации в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия

Согласована на портале № 20752

информации:

Для лиц с нарушениями зрения:

- в форме электронного документа;
- в печатной форме увеличенным шрифтом.

Для лиц с нарушениями слуха:

- в форме электронного документа;
- в печатной форме.

Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

- в форме электронного документа;
- в печатной форме.

При необходимости для обучающихся с инвалидностью процедура оценивания результатов обучения может проводиться в несколько этапов.

Согласована на портале № 20752

Приложение 1

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РФ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования

«ТОМСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ СИСТЕМ
УПРАВЛЕНИЯ И РАДИОЭЛЕКТРОНИКИ»
(ТУСУР)

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по учебной работе
_____ П. Е. Троян
«___» _____ 20__ г.

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ

Финансовые инструменты и институты

Уровень образования: **высшее образование - бакалавриат**
Направление подготовки (специальность): **38.03.02 Менеджмент**
Направленность (профиль): **Финансовый менеджмент**
Форма обучения: **очная**
Факультет: **ЭФ, Экономический факультет**
Кафедра: **экономики, Кафедра экономики**
Курс: **2**
Семестр: **4**

Учебный план набора 2017 года

Разработчик:
- Доцент каф. Экономики В. Ю. Цибульникова

Зачет: 4 семестр

Томск 2017

Согласована на портале № 20752

1. Введение

Фонд оценочных средств (ФОС) является приложением к рабочей программе дисциплины (практики) и представляет собой совокупность контрольно-измерительных материалов (типовые задачи (задания), контрольные работы, тесты и др.) и методов их использования, предназначенных для измерения уровня достижения студентом установленных результатов обучения.

ФОС по дисциплине (практике) используется при проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации студентов.

Перечень закрепленных за дисциплиной (практикой) компетенций приведен в таблице 1.

Таблица 1 – Перечень закрепленных за дисциплиной компетенций

Код	Формулировка компетенции	Этапы формирования компетенций
ПК-16	владением навыками оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов	Должен знать • основные понятия, категории и инструменты экономической теории и прикладных экономических дисциплин; • основы построения, расчета и анализа современной системы показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов на микро- и макроуровне; • основные особенности российской экономики, ее институциональную структуру, направления экономической политики государства; ; Должен уметь • применять понятийно-категориальный аппарат в профессиональной деятельности; • осуществлять поиск информации по полученному заданию, сбор, анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач; • использовать источники экономической, социальной, управленческой информации; • анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей; • осуществлять поиск информации по полученному заданию, сбор, анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач; ; Должен владеть • методологией экономического исследования; • современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных; • современными методиками расчета и анализа социально-экономических показателей, характеризующих экономические процессы и явления на микро- и макроуровне; • навыками извлечения необходимой информации из оригинального текста на иностранном языке по проблемам экономики и бизнеса. ;

Общие характеристики показателей и критериев оценивания компетенций на всех этапах приведены в таблице 2.

Согласована на портале № 20752

Таблица 2 – Общие характеристики показателей и критериев оценивания компетенций по этапам

Показатели и критерии	Знать	Уметь	Владеть
Отлично (высокий уровень)	Обладает фактическими и теоретическими знаниями в пределах изучаемой области с пониманием границ применимости	Обладает диапазоном практических умений, требуемых для развития творческих решений, абстрагирования проблем	Контролирует работу, проводит оценку, совершенствует действия работы
Хорошо (базовый уровень)	Знает факты, принципы, процессы, общие понятия в пределах изучаемой области	Обладает диапазоном практических умений, требуемых для решения определенных проблем в области исследования	Берет ответственность за завершение задач в исследовании, приспосабливает свое поведение к обстоятельствам в решении проблем
Удовлетворительно (пороговый уровень)	Обладает базовыми общими знаниями	Обладает основными умениями, требуемыми для выполнения простых задач	Работает при прямом наблюдении

2 Реализация компетенций

2.1 Компетенция ПК-16

ПК-16: владением навыками оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов.

Для формирования компетенции необходимо осуществить ряд этапов. Этапы формирования компетенции, применяемые для этого виды занятий и используемые средства оценивания представлены в таблице 3.

Таблица 3 – Этапы формирования компетенции и используемые средства оценивания

Состав	Знать	Уметь	Владеть
Содержание этапов	основные понятия, категории и инструменты финансовых рынков; основы построения, расчета и анализа со-временной системы показателей, характе-ризующих деятельность хозяйствующих субъектов на финансо-вых рынках; основные особенности российской экономики, ее институциональную структуру.	применять понятийно-категориальный аппарат в профессиональной деятельности; осуществлять поиск информации по полученному заданию, сбор, анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач; использовать источники экономической, социальной, управленческой информации; анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей.	методологией экономического исследования; современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных; современными методиками расчета и анализа социально-экономических показателей, характеризующих экономические процессы и явления на финансовых рынках.
Виды занятий	• Практические заня-	• Практические заня-	• Самостоятельная ра-

Согласована на портале № 20752

	тия; • Лекции; • Самостоятельная работа;	тия; • Лекции; • Самостоятельная работа;	бота;
Используемые средства оценивания	• Опрос на занятиях; • Расчетная работа; • Тест; • Зачет;	• Опрос на занятиях; • Расчетная работа; • Тест; • Зачет;	• Расчетная работа; • Зачет;

Формулировка показателей и критериев оценивания данной компетенции приведена в таблице 4.

Таблица 4 – Показатели и критерии оценивания компетенции на этапах

Состав	Знать	Уметь	Владеть
Отлично (высокий уровень)	• Способен понимать основные понятия теории финансовых рынков и институтов, перечислить основные термины и понятия и самостоятельно раскрыть содержание термина или понятия во взаимосвязи с иными элементами терминологии;	• Способен анализировать различные финансовые инструменты, корректно обрабатывать и анализировать материалы требуемые для подготовки работы из периодических журналов и информационных научно–образовательных ресурсов;	• Способен свободно с использованием информационных, компьютерных и сетевых технологий осуществлять поиск информации из различных источников и баз данных;
Хорошо (базовый уровень)	• Способен понимать основные понятия теории финансовых рынков и институтов, перечислить основные термины и понятия и самостоятельно раскрыть содержание термина или понятия;	• Способен анализировать различные финансовые инструменты, обрабатывать и анализировать материалы требуемые для подготовки работы из информационных научно-образовательных ресурсов;	• Способен использовать информационные, компьютерные и сетевые технологий для поиска информации из различных источников и баз данных, пользуясь инструктивными и справочными материалами;
Удовлетворительно (пороговый уровень)	• Способен понимать основные понятия теории финансовых рынков и институтов, перечислить основные термины и понятия и корректно определить значение термина или понятия через выбор из предложенного списка вариантов;	• Способен анализировать различные финансовые инструменты и корректно обрабатывать материалы требуемые для подготовки работы из информационных научно-образовательных ресурсов;	• Способен использовать информационные, компьютерные и сетевые технологии для поиска информации из различных источников и баз данных, периодически обращаясь за помощью к преподавателю;

3 Типовые контрольные задания

Для реализации вышеперечисленных задач обучения используются типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы, в следующем составе.

Согласована на портале № 20752

3.1 Тестовые задания

– 1. Одной из особенностей международного финансового рынка является:
– а) небольшие масштабы рынка;
– б) отсутствие географических единиц;
– в) проведение операций только в дневное время.
– 2. Финансовая глобализация предполагает:
– а) образование единой экономической среды;
– б) образование единой политической среды;
– в) образование единой культурной среды.
– 3. Виды средств, которые вкладываются в объекты предпринимательской и другой хозяйственной деятельности с целью получения дохода или достижения социального эффекта:
– а) сбережения;
– б) инвестиции;
– в) займы.
– 4. К функциям финансового рынка НЕ относятся:
– а) мобилизация средств для экономического развития;
– б) рост цен на ресурсы;
– в) обеспечение накопления средств, определяющих экономический рост;
– г) сокращение социального неравенства.
– 5. Функция финансового рынка «ускорение концентрации и централизации капитала» выражается в следующем:
– а) сосредоточение денежных средств в одних руках;
– б) образование крупных финансовых холдингов;
– в) быстрое преобразование материальных активов в денежные.

3.2 Темы опросов на занятиях

– Технология применения российских депозитарных расписок в инвестиционной практике компаний (лекция № 10)
– Что представляют собой российские депозитарные расписки?
– Когда появились российские депозитарные расписки и для чего они впервые были выпущены?
– Зачем в настоящее время инвесторы используют российские депозитарные расписки?
– Есть ли выгоды для инвесторов при инвестировании в РДР?
– Какова процедура выпуска РДР?
– Порядок выпуска и размещения еврооблигаций (лекция № 11)
– Разберитесь со схемой выпуска и размещения еврооблигаций.
– Какие этапы необходимо пройти предприятию, чтобы выпустить еврооблигации?
– Кто занимается размещением еврооблигаций?
– Кто преимущественно инвестирует в еврооблигации?
– Какую доходность могут показывать еврооблигации?
– Приведите примеры известных вам еврооблигаций.
– Кто чаще всего эмитирует еврооблигации?
– Влияние процесса глобализации в мировой экономике на развитие финансовых рынков (лекция № 2)
– Необходимо изучить понятие глобализации, причины и последствия глобализации; выяснить, почему глобализация оказывает существенное влияние на функционирование финансовых рынков.
– Каковы, на ваш взгляд, положительные и отрицательные проявления глобализации применительно к финансовым рынкам?
– Методика расчета вексельной стоимости (лекция № 4)
– Необходимо изучить специальную литературу по теме «Вексель и вексельное обращение» и разобраться в методике расчета вексельной стоимости.

Согласована на портале № 20752

– Для чего необходим подобный расчет, где он может применяться?

– Почему учет векселей производится отдельно и применяется механизм «учетной ставки»?

– Методика расчетов при синдицированном кредитовании (лекция № 6)

– Разберитесь с методикой расчета сумм платежей и сумм кредитов при использовании различных схем синдицированного кредитования.

– Для чего необходимо синдицированное кредитование в экономике?

– В каких сферах может применяться механизм синдицированного кредита?

– Специфика международных расчетов (лекция № 6)

– В чем особенности международных расчетов?

– Какие организации используют возможности международных расчетов?

– Каковы методика международных расчетов?

3.3 Темы расчетных работ

– В США выпускают товар X, один килограмм которого продается по 25 USD в США, и точно такое же количество товара X продается в Японии за 2300 йен. Каким должен быть спотовый обменный курс между долларом США и японской йеной согласно абсолютному паритету покупательной способности?

– Инвестор купил опцион пут за 20 руб. (премия), цена исполнения 460 руб. На дату исполнения цена этого актива составила 350 руб. Определить финансовый результат сделки.

– Два одинаковых по составу и качеству набора бытовой техники — американский и европейский — стоят соответственно 10 тыс. долл. и 9 тыс. евро. Номинальный обменный курс составляет 1,35 долл. за 1евро. Каков реальный обменный курс?

3.4 Зачёт

– Список теоретических вопросов для проведения зачета

– 1. Понятие финансового рынка. Виды финансовых рынков

– 2. Понятие и функции валютного рынка.

– 3. Понятие валютного курса и валютной котировки.

– 4. Участники валютного рынка. Виды валютных операций.

– 5. Функции и участники страхового рынка. Виды страхования

– 6. Роль страховых и пенсионных фондов на современном финансовом рынке.

– 7. Понятие кредитного рынка. Участники кредитного рынка.

– 8. Виды кредитования. Государственный кредит.

– 9. Понятие и виды ценных бумаг.

– 10. Понятие и функции фондового рынка.

– 11. Основные участники рынка ценных бумаг.

– 12. Рынок ссудных капиталов.

– 13. Межбанковские депозиты и сроки привлечения свободных денежных ресурсов.

– 14. Направления использования средств межбанковского рынка.

– 15. Основные операции на межбанковском рынке.

– 16. Значение и структура рынка капиталов.

– 17. Международный рынок драгоценных металлов: содержание и виды.

– 18. Участники международного рынка драгоценных металлов.

– 19. Ценообразование на рынке драгоценных металлов.

– 20. Понятие и виды финансовых рисков.

– 21. Взаимосвязь риска, доходности и ликвидности.

– 22. Сравнительная характеристика риска, доходности и ликвидности на различных видах финансовых рынков.

4 Методические материалы

Для обеспечения процесса обучения и решения задач обучения используются следующие материалы:

Согласована на портале № 20752

– методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы фор-мирования компетенций, согласно п. 12 рабочей программы.

4.1. Основная литература

1. Финансовые рынки: Учебно-методический комплекс / Цибульникова В. Ю., Буймов А. Г. - 2014. 396 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/6637, свободный.

4.2. Дополнительная литература

1. Финансовые рынки [Текст] : учебное пособие / Т. К. Блохина. - М. : Российский университет дружбы народов, 2009. - 199 с. (наличие в библиотеке ТУСУР - 6 экз.)
2. Суэтин А.А. Финансовые рынки в мировой экономике: учебник. — М.: ЭКОНОМИСТЪ, 2008. — 586 с. (наличие в библиотеке ТУСУР - 10 экз.)

4.3. Обязательные учебно-методические пособия

1. Финансовые рынки: Методические указания к практическим занятиям для студентов направления 080100.62 «Экономика» / Цибульникова В. Ю. - 2014. 66 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/3908, свободный.
2. Финансовые инструменты и институты: Методические указания к практическим занятиям и самостоятельной работе / Цибульникова В. Ю. - 2017. 21 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/6956, свободный.

4.4. Базы данных, информационно справочные и поисковые системы

1. Научно-образовательный портал университета, электронный каталог библиотеки ТУСУРа, электронная библиотечная система «ЛАНЬ», информационно-правовая система по законодательству Российской Федерации – «ГАРАНТ» (http://www.garant.ru), компьютерная справочно-правовая система по законодательству России — «Консультант Плюс» (http://www.consultant.ru/online/).

Согласована на портале № 20752