

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:

ФИО: Ашмарина Светлана Игоревна

Должность: Ректор ФГБОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 01.02.2020 09:46:51

Уникальный программный ключ:

59650034d6e3a6baac49b7bd0f8e79fea1433ff3e82f1fc7e9279a031181baba

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации  
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение

высшего образования

«Самарский государственный экономический университет»

Институт менеджмента

Кафедра Прикладного менеджмента

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета

(протокол № 10 от 29 апреля 2020 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Наименование дисциплины Б1.В.ДВ.07.02 Финансовые институты и рынки

Основная профессиональная образовательная программа Направление 38.03.02 МЕНЕДЖМЕНТ программа "Финансовый менеджмент"

Методический отдел УМУ

« 30 » 04 2020 г.

Ашмарина / Зубов

Научная библиотека СГЭУ

« 20 » 04 2020 г.

Гурьева / Зубов

Рассмотрено к утверждению

на заседании кафедры Прикладного менеджмента  
(протокол № 7 от 18.03.2020г.)

Зав. кафедрой /С.И. Ашмарина

Квалификация (степень) выпускника бакалавр

## Содержание (рабочая программа)

Стр.

- 1 Место дисциплины в структуре ОП
- 2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 3 Объем и виды учебной работы
- 4 Содержание дисциплины
- 5 Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины
- 6 Фонд оценочных средств по дисциплине

Целью изучения дисциплины является формирование результатов обучения, обеспечивающих достижение планируемых результатов освоения образовательной программы.

## 1. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Финансовые институты и рынки входит в вариативную часть (дисциплина по выбору) блока Б1. Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Финансовый менеджмент, Инвестиционный анализ, Бизнес-планирование, Финансовое прогнозирование, Финансы и кредит

Последующие дисциплины по связям компетенций: Финансовые инструменты корпоративного управления, Практики бизнеса

## 2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Изучение дисциплины Финансовые институты и рынки в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

### Профессиональные компетенции (ПК):

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

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
ПК-16	ПК16з1: основы функционирования финансовой системы, методы оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования	ПК16у1: принимать решения о выборе методов оценки, планирования и прогнозирования; оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов	ПК16в1: навыками анализа и оценки принимаемых управленческих решений; выполнения расчетов, необходимых для составления экономических планов; определения параметров финансовых операций
	ПК16з2: методологию проведения оценки инвестиционных проектов при различных условиях инвестирования и финансирования	ПК16у2: оценивать принимаемые финансовые решения с точки зрения их влияния на создание ценности (стоимости) компаний, разрабатывать инвестиционные проекты и производить их оценку	ПК16в2: методами и инструментами оценки инвестиционных проектов; различными финансовыми инструментами; методами анализа операционной деятельности

## 3. Объем и виды учебной работы

Учебным планом предусматриваются следующие виды учебной работы по дисциплине:

### Очная форма обучения

Виды учебной работы	Всего час/ з.е.
	Сем 7
Контактная работа, в том числе:	37.15/1.03
Занятия лекционного типа	18/0.5
Занятия семинарского типа	18/0.5
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.15/0

Групповая контактная работа (ГКР)	1/0.03
Самостоятельная работа, в том числе:	61.85/1.72
Промежуточная аттестация	9/0.25
Вид промежуточной аттестации: Зачет	Зач
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	108
Зачетные единицы	3

#### заочная форма

Виды учебной работы	Всего час/ з.е.
	Сем 8
Контактная работа, в том числе:	13.15/0.37
Занятия лекционного типа	4/0.11
Занятия семинарского типа	8/0.22
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.15/0
Групповая контактная работа (ГКР)	1/0.03
Самостоятельная работа, в том числе:	91.85/2.55
Промежуточная аттестация	3/0.08
Вид промежуточной аттестации: Зачет	Зач
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	108
Зачетные единицы	3

#### 4. Содержание дисциплины

##### 4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Финансовые институты и рынки представлен в таблице.

#### Разделы, темы дисциплины и виды занятий

##### Очная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контактная работа				Самостоятельная работа	Планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по образовательной программе
		Лекции	Занятия семинарского типа	ИКР	ГКР		
			Практич. занятия				
1.	Основы финансовых институтов и рынков	4	4			30,925	ПК16з1, ПК16з2, ПК16у1, ПК16у2, ПК16в1, ПК16в2
2.	Углубленное изучение финансовых институтов и рынков	14	14			30,925	ПК16з1, ПК16з2, ПК16у1, ПК16у2, ПК16в1, ПК16в2
	Контроль	9					
	<b>Итого</b>	<b>18</b>	<b>18</b>	<b>0.15</b>	<b>1</b>	<b>61.85</b>	

##### заочная форма

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контактная работа				Самостоятельная работа	Планируемые результаты обучения в соотношении с результатами
		Лекции	Занятия семинарского типа	ИКР	ГКР		
			Практич. занятия				

							<b>обучения по образовательной программе</b>	
1.	Основы финансовых институтов и рынков	1	2			45,85	ПК16з1, ПК16з2, ПК16у1, ПК16у2, ПК16в1, ПК16в2	
2.	Углубленное изучение финансовых институтов и рынков	3	6			46	ПК16з1, ПК16з2, ПК16у1, ПК16у2, ПК16в1, ПК16в2	
	Контроль	3						
	<b>Итого</b>	<b>4</b>	<b>8</b>	0.15	1	<b>91.85</b>		

## 4.2 Содержание разделов и тем

### 4.2.1 Контактная работа

#### Тематика занятий лекционного типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия лекционного типа*	Тематика занятия лекционного типа
1.	Основы финансовых институтов и рынков	лекция	Правовые основы финансовой системы Российской Федерации
		лекция	Финансовый рынок как механизм балансирования спроса и предложения денежных ресурсов
2.	Углубленное изучение финансовых институтов и рынков	лекция	Виды финансовых институтов
		лекция	Профессиональные участники на финансовом рынке
		лекция	Саморегулируемые организации на финансовом рынке
		лекция	Специализированные небанковские кредитно-финансовые институты

\*лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся

#### Тематика занятий семинарского типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия семинарского типа**	Тематика занятия семинарского типа
1.	Основы финансовых институтов и рынков	практическое занятие	Правовые основы финансовой системы Российской Федерации
		практическое занятие	Финансовый рынок как механизм балансирования спроса и предложения денежных ресурсов
2.	Углубленное изучение финансовых институтов и рынков	практическое занятие	Виды финансовых институтов
		практическое занятие	Профессиональные участники на финансовом рынке
		практическое занятие	Саморегулируемые организации на финансовом рынке
		практическое занятие	Специализированные небанковские кредитно-финансовые институты

\*\* семинары, практические занятия, практикумы, лабораторные работы, коллоквиумы и иные аналогичные занятия

#### Иная контактная работа

При проведении учебных занятий СГЭУ обеспечивает развитие у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств

(включая при необходимости проведение интерактивных лекций, групповых дискуссий, ролевых игр, тренингов, анализ ситуаций и имитационных моделей, преподавание дисциплин (модулей) в форме курсов, составленных на основе результатов научных исследований, проводимых организацией, в том числе с учетом региональных особенностей профессиональной деятельности выпускников и потребностей работодателей).

Формы и методы проведения иной контактной работы приведены в Методических указаниях по основной профессиональной образовательной программе.

#### 4.2.2 Самостоятельная работа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид самостоятельной работы ***
1.	Основы финансовых институтов и рынков	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование
2.	Углубленное изучение финансовых институтов и рынков	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование

\*\*\* самостоятельная работа в семестре, написание курсовых работ, докладов, выполнение контрольных работ

### 5. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

#### 5.1 Литература:

##### Основная литература

Никитина, Т. В. Финансовые рынки и институты : учебник и практикум для прикладного бакалавриата / Т. В. Никитина, А. В. Репета-Турсунова. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 139 с. — (Бакалавр. Прикладной курс). — ISBN 978-5-534-07121-4. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://biblio-online.ru/bcode/434392>

##### Дополнительная литература

Гусева, И. А. Финансовые рынки и институты : учебник и практикум для академического бакалавриата / И. А. Гусева. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 347 с. — (Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-00339-0. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://biblio-online.ru/bcode/433417>

##### Литература для самостоятельного изучения

1. Рынок ценных бумаг: учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям/ Под ред. Жукова Е.Ф. - 3-е изд., перераб. и доп.- М.: Юнити-Дана, 2009;
2. Евстигнеев В.Р. Прогнозирование доходности на рынке акций. Москва: Маросейка, 2009;
3. Ершов В.А. Рынок ценных бумаг: Юридический справочник. М.: ГроссМедиа, РОСБУХ, 2009. Пиняскина О.В. О правовой природе инвестиционной деятельности//Банковское право.- 2010.- №2;
4. Астапов К.Л. Фондовый рынок как механизм стимулирования развития российской экономики//Финансы.-2010.-№10;
5. Балкаров А.Б. Современные тенденции административно-правового регулирования рынка ценных бумаг//Банковское право.-2009.-№4;
6. Непомнящая О.В. Современные возможности для частных инвесторов в России//Организация продаж банковских продуктов.- 2009. -№3;
7. Ротко С.В. Непрофессиональные участники рынка ценных бумаг как субъекты инвестиционной деятельности // Безопасность бизнеса. - 2010. - N 3;
8. Смирнов И.Е. Модернизация российского фондового рынка // Управление в кредитной организации. - 2011. - N 1;
9. Вавулин Д.А., Федотов В.Н. Раскрытие информации профессиональными участниками рынка ценных бумаг // Право и экономика. - 2010. - N 9;
10. Теплова Т., Аршавский А. Берзон Н. «Финансы. Учебник для бакалавров» - М. Юрай-Издат, 2011г.;
11. Галочкин М.И. Экономическая сущность регулирования рынка производных

ценных бумаг//Вопросы экономики и права.-2010.-№7;

12. Дранев Ю.Я., Ананьев Н.С. Влияние изменения индикаторов фондового рынка на привлечение средств в российские паевые фонды акций//Корпоративные финансы.-2010.-№2(14);
13. Товмсян А.А. Основные тенденции эволюции фондовых бирж на мировом финансовом рынке// Международная экономика. - 2011. - N 2;
14. Иголина Л.Л. О современных тенденциях развития российских финансовых институтов// Финансы: планирование, управление, контроль. – 2011.-№1;
15. Окулов В.А., Пустовалова Т.А., «Финансовые институты и рынки –начальный курс».-Изд-во ВШМ СПбГУ, 2011г.;
16. Маренков Н.Л., Косаренко Н.Н. Рынок ценных бумаг в России.—М. : Флинта, 2011г.-240 с. –Электронное издание. –ISBN 978-5-89349-538-6;
17. <http://ibooks.ru/reading.php?producting=23530>.

### **5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения**

1. Microsoft Windows 10 Education / Microsoft Windows 7 / Windows Vista Business
2. Office 365 ProPlus, Microsoft Office 2019, Microsoft Office 2016 Professional Plus (Word, Excel, Access, PowerPoint, Outlook, OneNote, Publisher) / Microsoft Office 2007 (Word, Excel, Access, PowerPoint)

### **5.3 Современные профессиональные базы данных, к которым обеспечивается доступ обучающихся**

1. Профессиональная база данных «Информационные системы Министерства экономического развития Российской Федерации в сети Интернет» (Портал «Официальная Россия» - <http://www.gov.ru/>)
2. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/ru/>)
3. Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики - <http://www.gks.ru/>)

### **5.4. Информационно-справочные системы, к которым обеспечивается доступ обучающихся**

1. справочно-правовая система «Консультант Плюс»
2. справочно-правовая система «ГАРАНТ-Максимум»

### **5.5. Специальные помещения**

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран
Учебные аудитории для проведения практических занятий (занятий семинарского типа)	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор

	Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для самостоятельной работы	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для хранения и профилактического обслуживания оборудования	Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования

Для проведения занятий лекционного типа используются демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия в виде презентационных материалов, обеспечивающих тематические иллюстрации.

## 6. Фонд оценочных средств по дисциплине Финансовые институты и рынки:

### 6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

Вид контроля	Форма контроля	Отметить нужное знаком « + »
Текущий контроль	Оценка докладов	-
	Устный/письменный опрос	+
	Тестирование	+
	Практические задачи	-
	Оценка контрольных работ (для заочной формы обучения)	-
Промежуточный контроль	Зачет	+

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования, утвержденными Ученым советом ФГБОУ ВО СГЭУ №10 от 29.04.2020г.

### 6.2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

#### Профессиональные компетенции (ПК):

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

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
Пороговый	ПК16з1: основы функционирования финансовой системы, методы оценки инвестиционных	ПК16у1: принимать решения о выборе методов оценки, планирования и прогнозирования; оценки	ПК16в1: навыками анализа и оценки принимаемых управленческих решений; выполнения расчетов, необходимых для составления



	проектов, финансового планирования и прогнозирования	инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов	экономических планов; определения параметров финансовых операций
Повышенный	ПК16з2: методологию проведения оценки инвестиционных проектов при различных условиях инвестирования и финансирования	ПК16у2: оценивать принимаемые финансовые решения с точки зрения их влияния на создание ценности (стоимости) компаний, разрабатывать инвестиционные проекты и производить их оценку	ПК16в2: методами и инструментами оценки инвестиционных проектов; различными финансовыми инструментами; методами анализа операционной деятельности

### 6.3. Паспорт оценочных материалов

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контролируемые планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по программе	Вид контроля/используемые оценочные средства	
			Текущий	Промежуточный
1.	Основы финансовых институтов и рынков	ПК16з1, ПК16з2, ПК16у1, ПК16у2, ПК16в1, ПК16в2	Устный/письменный опрос Тестирование	Зачет
2.	Углубленное изучение финансовых институтов и рынков	ПК16з1, ПК16з2, ПК16у1, ПК16у2, ПК16в1, ПК16в2	Устный/письменный опрос Тестирование	Зачет

### 6.4. Оценочные материалы для текущего контроля

#### Вопросы для устного/письменного опроса

Раздел дисциплины	Вопросы
Основы финансовых институтов и рынков	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Финансовая система как совокупность финансов основных субъектов экономики (населения, предприятий, государства).</li> <li>2. Вспомогательные (обеспечивающие) подсистемы в финансовой сфере - банки, биржи, фонды, системы коммуникаций и т.п.</li> <li>3. Способы формирования финансовых ресурсов за счет операций на товарных и финансовых рынках, а также за счет безвозмездных (налоговых) платежей.</li> <li>4. Финансовая система Российской Федерации, ее правовые основы.</li> <li>5. Принцип самофинансирования участников рыночных отношений.</li> <li>6. Новые черты в финансовом устройстве России - новые субъекты, посредники, принципы, рычаги.</li> <li>7. Объективные основы управления финансами в условиях рынка: административные, правовые и экономические рычаги.</li> <li>8. Органы управления финансами различных уровней и их функции.</li> <li>9. Финансовый контроль, его цель, задачи, формы и методы.</li> <li>10. Место финансового рынка в общем потоке доходов и расходов экономических субъектов.</li> </ol>

	<ol style="list-style-type: none"> <li>11. Связь между денежными сбережениями субъектов, с одной стороны, и проблемами их мобилизации, концентрации, купли-продажи на финансовых рынках - с другой стороны.</li> <li>12. Роль государства в активизации этого процесса, в создании правовой защиты для инвесторов.</li> <li>13. Структура финансового рынка: рынок денег и рынок капитала.</li> <li>14. Субъекты финансового рынка: банки, финансово-кредитные институты, биржи, посредники на рынке ценных бумаг и распределение ролей между ними.</li> <li>15. Позитивное влияние рыночных отношений в финансовой сфере на экономику страны в целом.</li> <li>16. Становление финансового рынка в России, его регулирование со стороны законодательной и исполнительной власти.</li> <li>17. Рынок капитала - рынок инвестиций в экономику России.</li> <li>18. Его состояние на сегодняшний день: структура, удельный вес долгосрочных кредитов, степень их риска, динамика процентной ставки, купля-продажа ценных бумаг коммерческих структур.</li> <li>19. Регулирующие мероприятия государства на рынке капиталов.</li> <li>20. Сущность и место финансовых институтов в экономической системе.</li> <li>21. Основные теории взаимосвязи финансовых институтов и экономического роста.</li> <li>22. Классификация финансовых институтов.</li> <li>23. Виды финансовых институтов.</li> <li>24. Банковские и небанковские институты: сравнительная характеристика.</li> <li>25. Конвергенция финансовых институтов на международных рынках.</li> <li>26. Особенности становления и развития банковских и небанковских институтов в странах с переходной экономикой.</li> <li>27. Виды участников и их взаимодействие.</li> <li>28. Виды профессиональной деятельности на финансовом рынке.</li> <li>29. Требования, предъявляемые к профессиональным участникам финансового рынка, их организационно-правовые формы, учредители.</li> <li>30. Специфика выполняемых операций, оборота средств, структуры доходов и расходов.</li> </ol>
<p>Углубленное изучение финансовых институтов и рынков</p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Лицензирование, ограничения на деятельность, развитие сети.</li> <li>2. Сравнительная характеристика видов профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, правила совмещения видов деятельности и соответствующих лицензий.</li> <li>3. Брокерско-дилерские компании: статус, виды операций и продуктов, структура оборота средств, доходов и расходов, основные ограничения.</li> <li>4. Коммерческие банки и другие кредитные организации на рынке ценных бумаг: статус, операции, основные ограничения, сферы конкуренции с брокерско-дилерскими компаниями и другими небанковскими профессиональными участниками рынка ценных бумаг (российская и международная практика).</li> <li>5. Прочие финансовые институты, выполняющие операции с ценными бумагами.</li> <li>6. Профессиональная этика участников фондового рынка.</li> <li>7. Назначение саморегулируемых организаций (СРО) в деятельности профессиональных участников рынка, -регулирующие функции, роль третейского суда.</li> <li>8. Создание СРО, их полномочия, финансирование.</li> </ol>

	<ol style="list-style-type: none"> <li>9. Статус кредитных небанковских учреждений в соответствии с законодательствами РФ.</li> <li>10. Сберегательные, трастовые, ипотечные и другие операции, совершаемые кредитно - финансовыми учреждениями.</li> <li>11. Другие специализированные небанковские кредитно-финансовые институты и их роль в накоплении и мобилизации капитала.</li> <li>12. Деятельность пенсионных фондов, инвестиционных компаний и фондов, ссудосберегательных ассоциаций, финансово промышленных групп, холдингов, финансовых компаний, кредитных союзов и благотворительных фондов.</li> <li>13. Организационная структура инвестиционных банков в мировой практике и в России.</li> <li>14. Операции инвестиционных банков.</li> <li>15. Сущность и виды андеррайтинговых операций.</li> <li>16. Трастовое управление финансовыми активами.</li> <li>17. Практика регулирования деятельности инвестиционных банков в России.</li> <li>18. Вопросы типологии и классификации.</li> <li>19. Учреждение инвестиционного фонда и формирование его начального капитала.</li> <li>20. Размещение капитала и управление портфелем ценных бумаг.</li> <li>21. Выбор направления вложения средств.</li> <li>22. Категории инвестиционных фондов по характеру инвестиционной стратегии.</li> <li>23. Открытые и закрытые, обычные и паевые инвестиционные фонды.</li> <li>24. Операции с ценными бумагами инвестиционного фонда в целях сохранения качества портфеля ценных бумаг и обеспечения роста его текущей стоимости.</li> <li>25. Инвестиционная декларация инвестиционного фонда, ее содержание.</li> <li>26. Инвестиционный пай как именная ценная бумага.</li> <li>27. Порядок эмиссии и выкупа паев.</li> <li>28. Открытые и интервальные паевые инвестиционные фонды.</li> <li>29. Требования, предъявляемые к профессиональным участникам финансового рынка, их организационно-правовые формы, учредители.</li> <li>30. Специфика выполняемых операций, оборота средств, структуры доходов и расходов.</li> </ol>
--	--

**Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций (min 20, max 50 + ссылку на ЭИОС с тестами)**  
<https://lms2.sseu.ru/course/index.php?categoryid=514>

IRR означает - чистая приведённая стоимость

-Верно

-Не верно

VaR – это статистический финансовый показатель, характеризующий изменчивость цены на что-либо.

-Верно

-Не верно

Критерий гарантированного результата (максимальный критерий Вальда) является критерием наибольшего вреда;

- Верно
- Не верно

Графическое представление распределения вероятностей событий осуществляется посредством: гистограммы вероятностей

- Верно
- Не верно

Под показателем NW в риск-менеджменте понимаются чистые активы

- Верно
- Не верно

Под термином ALM в риск-менеджменте понимается управление жизненным циклом

- Верно
- Не верно

Дельта измеряет «течение времени» опциона

- Верно
- Не верно

$\rho$  измеряет степень чувствительность стоимость опциона к изменениям волатильности базового инструмента.

- Верно
- Не верно

Критерий максимакса соответствует оптимистической наступательной стратегии; здесь не принимается во внимание никакой возможный результат, кроме самого лучшего

- Верно
- Не верно

ЕБИТ – прибыль до выплаты процентов.

- Верно
- Не верно

VAR –это:

- парадигма стоимости риска (Value-at-Risk);
- показатель объемов потерь прибыли (VolumeatReduce);
- степень сопротивления персонала рискованным проектам(VolumeatResistance);
- объем риска(Volume of Accepted Risk).

Показатель НИ означает:

- чистый приведенный доход
- частые активы
- чистый процентный доход
- непроцентный доход

Какая из ставок учитывает фактор риска при финансовых расчтах?

- ставка дисконтирования;
- ставка налога на прибыль;
- ставка рефинансирования
- доходная ставка

Моделирование методом Монте-Карло предполагает

- 2 этапа
- 3 этапа
- 4 этапа
- 10 шагов

Если событие не может произойти ни при каких условиях, его вероятность равна:

- нулю
- одному
- меньше единицы
- больше единицы

Близкая к единице прогнозируемость событий соответствует:

- полной определенности
- полной неопределенности
- неизвестности
- нет правильных вариантов ответов

Снижение риска за счет увеличения количества поставщиков, позволяющего ослабить зависимость предприятия от конкретного поставщика - это:

- диверсификация рынка сбыта (развитие рынка);
- диверсификация видов хозяйственной деятельности;
- диверсификация закупок;
- диверсификация инвестиций.

Снижение риска за счет распределения готовой продукции предприятия между несколькими рынками или контрагентами - это:

- диверсификация рынка сбыта (развитие рынка);
- диверсификация видов хозяйственной деятельности;
- диверсификация закупок;
- диверсификация инвестиций.

Какой метод применяется для моделирования изменений факторов рыночного риска

- метод исторического моделирования
- метод наименьших чисел
- метод экспертных оценок
- метод Дельфи

Самым простым индикатором измерения рыночного риска называют

- VaR
- Нарисательная сумма
- BPV

- BPN

Какой показатель позволяет определить относительную прибыльность будущего предприятия?

- PP
- PI
- IRR
- NPV

Известный метод экспертных оценок для определения исходных данных предстоящего моделировании инвестиционной программы носит название:

- Паттерн
- метод Дельфи
- метод экспертных оценок
- метод тестирования

Негативное влияние финансового рычага заключается:

- в снижении платежеспособности предприятия;
- в снижении финансовой устойчивости;
- в увеличении валюты баланса
- в увеличении кредиторской задолженности

### 6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

#### Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме зачета

Раздел дисциплины	Вопросы
Основы финансовых институтов и рынков	<ol style="list-style-type: none"><li>1. Сущность и структура финансового рынка</li><li>2. Субъекты регулирования финансового рынка</li><li>3. Структура и функции финансового рынка</li><li>4. Роль ценных бумаг в привлечении инвестиций</li><li>5. Существующие проблемы привлечений инвестиций через механизм рынка ценных бумаг</li><li>6. Отношения собственности на финансовом рынке</li><li>7. Акции и облигации – основные инвестиционные ценные бумаги</li><li>8. Гражданский кодекс РФ о ценных бумагах</li><li>9. Классификация ценных бумаг</li><li>10. Корпоративные ценные бумаги</li><li>11. Государственные ценные бумаги</li><li>12. Регистраторская деятельность на рынке</li><li>13. Объективная необходимость государственного регулирования финансового рынка</li><li>14. Особенности саморегулирования на финансовом рынке, отечественный и зарубежный опыт</li><li>15. Структура системы государственного регулирования финансового рынка Задачи государственного регулирования рынка ценных бумаг</li><li>16. Нормативная база, регулирующая финансовый рынок</li><li>17. Методы государственного регулирования финансового рынка</li><li>18. Ответственность за нарушения законодательства на финансовом рынке</li></ol>

	<p>19. Государственная регистрация выпусков ценных бумаг (правовой режим)</p> <p>20. Риски, присущие финансовому рынку</p> <p>21. Производные ценные бумаги</p> <p>22. Регулирование размещения и обращения ценных бумаг</p> <p>23. Особенности эмиссии ценных бумаг, выпускаемых коммерческими банками</p> <p>24. Ценная бумага как особый товар</p> <p>25. Права владельцев обыкновенных и привилегированных акций</p> <p>26. Права владельцев корпоративных облигаций</p> <p>27. Правила внесения в реестр записи о переходе прав собственности на ценные бумаги регистратором</p> <p>28. Предоставление информации из реестра (эмитенту, акционеру, уполномоченным государственным органом)</p> <p>29. Основные этапы процедуры эмиссии дополнительных акций акционерного общества, размещаемых среди акционеров</p> <p>30. Основные этапы процедуры эмиссии облигаций, размещаемых путем подписки</p>
<p>Углубленное изучение финансовых институтов и рынков</p>	<p>1. Особенности эмиссии государственных и муниципальных ценных бумаг</p> <p>2. Основные разделы проспекта эмиссии акционерного общества</p> <p>3. Фондовые биржи</p> <p>4. Мировые фондовые рынки</p> <p>5. Фондовые индексы</p> <p>6. Выход компании на международный фондовый рынок</p> <p>7. Депозитарные расписки (правовой режим)</p> <p>8. Технология выпуска депозитарных расписок (правовой режим)</p> <p>9. Международный рынок инвестиций</p> <p>10. Международные инвестиционные компании</p> <p>11. Государственные ценные бумаги</p> <p>12. Регистраторская деятельность на рынке</p> <p>13. Объективная необходимость государственного регулирования финансового рынка</p> <p>14. Особенности саморегулирования на финансовом рынке, отечественный и зарубежный опыт</p> <p>15. Структура системы государственного регулирования финансового рынка</p> <p>Задачи государственного регулирования рынка ценных бумаг</p> <p>16. Нормативная база, регулирующая финансовый рынок</p> <p>17. Методы государственного регулирования финансового рынка</p> <p>18. Ответственность за нарушения законодательства на финансовом рынке</p> <p>19. Государственная регистрация выпусков ценных бумаг (правовой режим)</p> <p>20. Риски, присущие финансовому рынку</p> <p>21. Производные ценные бумаги</p> <p>22. Регулирование размещения и обращения ценных бумаг</p> <p>23. Особенности эмиссии ценных бумаг, выпускаемых коммерческими банками</p> <p>24. Ценная бумага как особый товар</p> <p>25. Права владельцев обыкновенных и привилегированных акций</p> <p>26. Права владельцев корпоративных облигаций</p> <p>27. Правила внесения в реестр записи о переходе прав собственности на ценные бумаги регистратором</p> <p>28. Предоставление информации из реестра (эмитенту, акционеру,</p>

	уполномоченным государственным органом) 29. Основные этапы процедуры эмиссии дополнительных акций акционерного общества, размещаемых среди акционеров 30. Основные этапы процедуры эмиссии облигаций, размещаемых путем подписки
--	--

**6.6. Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации**

**Шкала и критерии оценивания**

<b>Оценка</b>	<b>Критерии оценивания для мероприятий контроля с применением 2-х балльной системы</b>
<b>«зачтено»</b>	ПК16з1, ПК16у1, ПК16в1
<b>«не зачтено»</b>	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне