

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ  
Федеральное государственное автономное учреждение  
высшего профессионального образования  
"Казанский (Приволжский) федеральный университет"  
Центр заочного и дистанционного обучения



**УТВЕРЖДАЮ**

Проректор  
по образовательной деятельности КФУ  
Проф. Таюрский Д.А.

\_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

**Программа дисциплины**

Финансовые рынки и институты Б1.В.ОД.18

Направление подготовки: 38.03.02 - Менеджмент

Профиль подготовки: Менеджмент организации

Квалификация выпускника: бакалавр

Форма обучения: заочное

Язык обучения: русский

**Автор(ы):**

Мишакин Т.С.

**Рецензент(ы):**

Разумовская Е.М. , Аюпов А.А.

**СОГЛАСОВАНО:**

Заведующий(ая) кафедрой: Разумовская Е. М.

Протокол заседания кафедры No \_\_\_\_ от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 201\_\_ г

Учебно-методическая комиссия Института управления, экономики и финансов (центр заочного и дистанционного обучения):

Протокол заседания УМК No \_\_\_\_ от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 201\_\_ г

Регистрационный No

Казань  
2016

## Содержание

1. Цели освоения дисциплины
2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы
3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля
4. Структура и содержание дисциплины/ модуля
5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения
6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов
7. Литература
8. Интернет-ресурсы
9. Материально-техническое обеспечение дисциплины/модуля согласно утвержденному учебному плану

Программу дисциплины разработал(а)(и) доцент, к.н. Мишакин Т.С. кафедра менеджмента в социальной сфере Институт управления, экономики и финансов , Timur.Mishakin@kpfu.ru

### 1. Цели освоения дисциплины

В результате изучения дисциплины студент должен:

- знать состав и структуру финансового рынка;
- уметь оценивать риск и доходность ценных бумаг, определять стоимость, действующих на рынке финансовых инструментов;
- обладать навыками определения цен купонных и бескупонных облигаций;
- иметь четкое представление о структуре банковского баланса и взаимосвязи его основных статей, источниках доходов и расходах банка и методах оценки его эффективности;
- дать характеристику основных видов банковских операций и услуг, методов управления активами и пассивами, способов защиты от рисков при проведении кредитной и инвестиционной политики;
- уметь выявлять методические проблемы управления рисками в рамках индивидуального финансового планирования;
- знать особенности применения различных инструментов управления финансовыми рисками;
- иметь представление о современном рынке страхования и его основных тенденциях и об основных аспектах деятельности страховых компаний.

### 2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы высшего профессионального образования

Данная учебная дисциплина включена в раздел " Б1.В.ОД.18 Дисциплины (модули)" основной образовательной программы 38.03.02 Менеджмент и относится к обязательным дисциплинам. Осваивается на 3 курсе, 5 семестр.

5

### 3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля

В результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции:

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
пк-4	умением применять основные методы финансового менеджмента для оценки активов, управления оборотным капиталом, принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала, в том числе, при принятии решений, связанных с операциями на мировых рынках в условиях глобализации

В результате освоения дисциплины студент:

1. должен знать:

: основные понятия, категории и инструменты экономической теории и прикладных экономических дисциплин; ОК-1

основы построения, расчета и анализа современной системы показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов на микро- и макроуровне; ОК-9

основные особенности российской экономики, ее институциональную структуру, направления экономической политики государства; ОК-11

## 2. 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

## 3. 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.

применять знания на практике

## 4. Структура и содержание дисциплины/ модуля

Общая трудоемкость дисциплины составляет 2 зачетных(ые) единиц(ы) 72 часа(ов).

Форма промежуточного контроля дисциплины зачет в 5 семестре.

Суммарно по дисциплине можно получить 100 баллов, из них текущая работа оценивается в 50 баллов, итоговая форма контроля - в 50 баллов. Минимальное количество для допуска к зачету 28 баллов.

86 баллов и более - "отлично" (отл.);

71-85 баллов - "хорошо" (хор.);

55-70 баллов - "удовлетворительно" (удов.);

54 балла и менее - "неудовлетворительно" (неуд.).

### 4.1 Структура и содержание аудиторной работы по дисциплине/ модулю

#### Тематический план дисциплины/модуля

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
1.	Тема 1. Дисциплина состоит из трех разделов: фондовый рынок, банковское дело и управление рисками и страхование. Дисциплина ?Финансовые рынки и институты ? изучается на _2_ курсе бакалавриата по направлению ?__ Менеджмент__? и читается кафедрой менеджмента. Данная дисциплина опирается на знания, полученными студентами в процессе базовых общеэкономических курсов.	5		4	6	0	контрольная точка
	Тема . Итоговая форма контроля	5		0	0	0	зачет
	Итого			4	6	0	

#### 4.2 Содержание дисциплины

**Тема 1. Дисциплина состоит из трех разделов: фондовый рынок, банковское дело и управление рисками и страхование. Дисциплина ?Финансовые рынки и институты ? изучается на \_2\_ курсе бакалавриата по направлению ?\_\_ Менеджмент\_\_? и читается кафедрой менеджмента. Данная дисциплина опирается на знания, полученными студентами в процессе базовых общеэкономических курсов.**

**лекционное занятие (4 часа(ов)):**

**практическое занятие (6 часа(ов)):**

#### 4.3 Структура и содержание самостоятельной работы дисциплины (модуля)

N	Раздел Дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудоемкость (в часах)	Формы контроля самостоятельной работы
1.	Тема 1. Дисциплина состоит из трех разделов: фондовый рынок, банковское дело и управление рисками и страхование. Дисциплина ?Финансовые рынки и институты ? изучается на _2_ курсе бакалавриата по направлению ?__ Менеджмент__ ? и читается кафедрой менеджмента. Данная дисциплина опирается на знания, полученными студентами в процессе базовых общеэкономических курсов.	5		подготовка к контрольной точке	58	контрольная точка
	Итого				58	

### 5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения

При изучении данной дисциплины предусматривается:

- проведение лекционных занятий в соответствии с сеткой часов, приведенной далее по тексту;
- проведение семинарских занятий;
- самостоятельное изучение литературы, освоение теоретического материала и написание контрольной работы и реферата по одной из рекомендуемых тем, указанных в данной программе;
- проведение итоговой контрольной работы в виде тестов и решения задач по изучаемым темам.

### 6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов

**Тема 1. Дисциплина состоит из трех разделов: фондовый рынок, банковское дело и управление рисками и страхование. Дисциплина ?Финансовые рынки и институты ? изучается на \_2\_ курсе бакалавриата по направлению ?\_\_ Менеджмент\_\_ ? и читается кафедрой менеджмента. Данная дисциплина опирается на знания, полученными студентами в процессе базовых общеэкономических курсов.**

контрольная точка , примерные вопросы:

#### Тема . Итоговая форма контроля

Примерные вопросы к зачету:

Понятие и структура финансового рынка.  
Тенденции развития финансовых рынков.  
Валютный рынок: понятие и функции.  
Участники валютного рынка.  
Сделки на валютном рынке.  
Финансовый рынок и его структура.  
Денежный рынок.  
Форвардный рынок.  
Понятие и структура рынка ценных бумаг.  
Функции рынка ценных бумаг.  
Участники рынка ценных бумаг.  
Профессиональные участники рынка ценных бумаг.  
Ценные бумаги как экономическая категория.  
Классификация ценных бумаг.  
Характеристика первичного рынка ценных бумаг.  
Особенности вторичного рынка ценных бумаг.  
Опцион.  
Фьючерский контракт.  
Виды ценных бумаг.  
Акции: свойства, виды.  
Облигации: свойства, виды.  
Вексель: свойства, виды.  
Государственные ценные бумаги.  
Современное состояние и проблемы развития рынка ценных бумаг в РФ.  
Понятие механизма биржевых операций.  
Фондовая биржа: структура, задачи, функции.  
Система управления рынком ценных бумаг.  
Инвестиционные фонды и компании как участники рынка ценных бумаг.  
Фондовые операции банков.

### **7.1. Основная литература:**

Фондовый рынок. Под ред. Н.И. Берзона - М.: Вита-Пресс, 2008, гл.1,2  
Рынок ценных бумаг. Под ред. В.А.Галанова, А.И.Басова - М.: Финансы и статистика, 2001, гл.9-10.

### **7.2. Дополнительная литература:**

Алехин Б.И. "Рынок ценных бумаг". М.: "ЮНИТИ-ДАНА", 2004, гл.1.  
Миркин Я.М. Рынок ценных бумаг России: взаимодействие фундаментальных факторов, прогноз и политика развития. - М.: Альпина Паблишер, 2002.  
Колб Р., Родригес Р. Финансовые институты и рынки: Учебник. Пер. с англ. - М.: Издательство "Дело и сервис", 2003, гл.12.  
Шарп У., Александер Г., Бэйли Дж. Инвестиции. Пер. с англ. - М.: ИНФРА - М, 1997, гл. 1,6

- Гитман Л.Дж., Джонк М.Д. Основы инвестирования. М.: Дело, 1997, гл.1,5.
- Тьюлз Р., Брэдли Э., Тьюлз Т. Фондовый рынок. Пер. с англ. - М.: Инфра-М, 1997 г., гл. 1.
- Фабоцци Ф. Управление инвестициями: Пер. с англ.- М.: Ифра-М, 2000, гл.2,4
- Боди З., Кейн А., Маркус А. Принципы инвестиций: Пер. с англ.- М.: Из-во "Вильямс", 2002, гл.1,2,5,6
- Кохен Д. Психология фондового рынка: Страх, алчность и паника. Пер с англ. - М.: Итернет-трейдинг, 2004.
- Гибсон Р. Формирование инвестиционного портфеля: управление финансовыми рисками. Пер. с англ. - М.: Альпина Бизнес Букс, 2005.
- Тьюлз Р., Брэдли Э., Тьюлз Т. Фондовый рынок. Пер. с англ. - М.: Инфра-М, 1997 г., гл.2,3.
- Фабоцци Ф. Управление инвестициями: Пер. с англ.- М.: Ифра-М, 2000, гл.2.
- Кохен Д. Психология фондового рынка: Страх, алчность и паника. Пер с англ. - М.: Итернет-трейдинг, 2004.
- Алехин Б.И. "Рынок ценных бумаг". М.: "ЮНИТИ-ДАНА", 2004, гл.2.
- Колб Р., Родригес Р. Финансовые институты и рынки: Учебник. Пер. с англ. - М.: Издательство "Дело и сервис", 2003, гл.7.
- Краев А.О. и другие. Рынок долговых ценных бумаг: Учебное пособие для вузов. - М.: Издательство "Экзамен", 2002, гл. 2, 11.
- Лялин С.В. Корпоративные облигации: мировой опыт и российские перспективы. - М.: ООО "ДЭКС-ПРЕСС", 2002.
- Шарп У., Александер Г., Бэйли Дж. Инвестиции. Пер. с англ. - М.: ИНФРА - М, 1997, гл. 15.
- Гитман Л.Дж., Джонк М.Д. Основы инвестирования. М.: Дело, 1997, гл.9.
- Фабоцци Ф. Управление инвестициями: Пер. с англ.- М.: Ифра-М, 2000, гл.19-22.
- Боди З., Кейн А., Маркус А. Принципы инвестиций: Пер. с англ.- М.: Из-во "Вильямс", 2002, гл.10,11.
- Уилсон Р., Фабоцци Ф. Корпоративные облигации: структура и анализ: Пер. с англ.- М.: Альпина Бизнес Букс, 2005, гл.1-5, 7-10.
- Фабоцци Ф. Рынок облигаций: анализ и стратегии. Пер. с англ.- М.: Альпина Бизнес Букс, 2005, гл.1-5. Миркин Я.М. Рынок ценных бумаг России: взаимодействие фундаментальных факторов, прогноз и политика развития. - М.: Альпина Паблишер, 2002.
- Миркин Я.М. Рынок ценных бумаг России: взаимодействие фундаментальных факторов, прогноз и политика развития. - М.: Альпина Паблишер, 2002.
- Кохен Д. Психология фондового рынка: Страх, алчность и паника. Пер с англ. - М.: Итернет-трейдинг, 2004.
- Матросов С.В. Европейский фондовый рынок. - М.: Экзамен, 2002.
- Четыркин Е.М. Облигации: теория и таблицы доходности. - М
- Алехин Б.И. "Рынок ценных бумаг". М.: "ЮНИТИ-ДАНА", 2004, гл.3.
- Колб Р., Родригес Р. Финансовые институты и рынки: Учебник. Пер. с англ. - М.: Издательство "Дело и сервис", 2003, гл.9-10.
- Шарп У., Александер Г., Бэйли Дж. Инвестиции. Пер. с англ. - М.: ИНФРА - М, 1997, гл. 17.1-17.4, 18.
- Гитман Л.Дж., Джонк М.Д. Основы инвестирования. М.: Дело, 1997, гл.6-8.
- Тьюлз Р., Брэдли Э., Тьюлз Т. Фондовый рынок. Пер. с англ. - М.: Инфра-М, 1997 г., гл.19.
- Боди З., Кейн А., Маркус А. Принципы инвестиций: Пер. с англ.- М.: Из-во "Вильямс", 2002, гл.12,13.
- Российский фондовый рынок 2007 . - М.: Антанта - Капитал, 2007.
- Гитман Л.Дж., Джонк М.Д. Основы инвестирования. М.: Дело, 1997, гл.10.
- Тьюлз Р., Брэдли Э., Тьюлз Т. Фондовый рынок. Пер. с англ. - М.: Инфра-М, 1997 г., гл.24.
- Фабоцци Ф. Управление инвестициями: Пер. с англ.- М.: Ифра-М, 2000, гл.23.

- Уилсон Р., Фабоцци Ф. Корпоративные облигации: структура и анализ: Пер. с англ.- М.: Альпина Бизнес Букс, 2005, гл.6.
- Фабоцци Ф. Рынок облигаций: анализ и стратегии. Пер. с англ.- М.: Альпина Бизнес Букс, 2005, гл.18.
- Гитман Л.Дж., Джонк М.Д. Основы инвестирования. М.: Дело, 1997, гл.11.
- Тьюлз Р., Брэдли Э., Тьюлз Т. Фондовый рынок. Пер. с англ. - М.: Инфра-М, 1997 г., гл.24.
- Ратников К.Ю. Новый способ приватизации и продажи акций российских компаний и банков за рубежом. Американские и глобальные депозитарные расписки. - М.: Статут, 2001.
- Вавилов А. Государственный долг: уроки кризиса и принципы управления. - М.: Городец-издат, 2001.
- Данилов Ю.А. Рынки государственного долга: Мировые тенденции и мировая практика. - М.: ГУ-ВШЭ, 2002.
- Никифорова В.Д., Островская В.Ю. Государственные и муниципальные ценные бумаги. - СПб.: Питер, 2004.
- Миркин Я.М. и другие. Руководство по организации эмиссии и обращения корпоративных облигаций. - М.: Альпина Бизнес Букс, 2004.
- Монтес М.Ф., Попоа В.В. "Азиатский вирус" или "голландская болезнь"? Теории и история валютных кризисов в России и других странах. Пер. с англ. - М.: Дело, 1999.
- Алехин Б.И. "Рынок ценных бумаг". М.: "ЮНИТИ-ДАНА", 2004.
- Краев А.О. и другие. Рынок долговых ценных бумаг: Учебное пособие для вузов. - М.: Издательство "Экзамен", 2002, гл. 4,6.
- Шарп У., Александер Г., Бэйли Дж. Инвестиции. Пер. с англ. - М.: Инфра - М, 1997, гл. 14.3-14.5.
- Тьюлз Р., Брэдли Э., Тьюлз Т. Фондовый рынок. Пер. с англ. - М.: Инфра-М, 1997 г., гл.3.
- Фабоцци Ф. Управление инвестициями: Пер. с англ.- М.: Инфра-М, 2000, гл.19.
- Фабоцци Ф. Рынок облигаций: анализ и стратегии. Пер. с англ.- М.: Альпина Бизнес Букс, 2005, гл.6,8.

### **7.3. Интернет-ресурсы:**

учебное пособие - [www.bibliofond.ru/view.aspx?id=482956](http://www.bibliofond.ru/view.aspx?id=482956)

1 - [www.myfins.ru](http://www.myfins.ru)

2 - [www.minfin.ru](http://www.minfin.ru)

3 - [www.finansy.ru](http://www.finansy.ru)

4 - [www.finance-journal.ru](http://www.finance-journal.ru)

5 - [www.rbc.ru](http://www.rbc.ru)

### **8. Материально-техническое обеспечение дисциплины(модуля)**

Освоение дисциплины "Финансовые рынки и институты" предполагает использование следующего материально-технического обеспечения:

Мультимедийная аудитория, вместимостью более 60 человек. Мультимедийная аудитория состоит из интегрированных инженерных систем с единой системой управления, оснащенная современными средствами воспроизведения и визуализации любой видео и аудио информации, получения и передачи электронных документов. Типовая комплектация мультимедийной аудитории состоит из: мультимедийного проектора, автоматизированного проекционного экрана, акустической системы, а также интерактивной трибуны преподавателя, включающей тач-скрин монитор с диагональю не менее 22 дюймов, персональный компьютер (с техническими характеристиками не ниже Intel Core i3-2100, DDR3 4096Mb, 500Gb), конференц-микрофон, беспроводной микрофон, блок управления оборудованием, интерфейсы подключения: USB, audio, HDMI. Интерактивная трибуна преподавателя является ключевым элементом управления, объединяющим все устройства в единую систему, и служит полноценным рабочим местом преподавателя. Преподаватель имеет возможность легко управлять всей системой, не отходя от трибуны, что позволяет проводить лекции, практические занятия, презентации, вебинары, конференции и другие виды аудиторной нагрузки обучающихся в удобной и доступной для них форме с применением современных интерактивных средств обучения, в том числе с использованием в процессе обучения всех корпоративных ресурсов. Мультимедийная аудитория также оснащена широкополосным доступом в сеть интернет. Компьютерное оборудование имеет соответствующее лицензионное программное обеспечение.

Учебно-методическая литература для данной дисциплины имеется в наличии в электронно-библиотечной системе "КнигаФонд", доступ к которой предоставлен студентам. Электронно-библиотечная система "КнигаФонд" реализует легальное хранение, распространение и защиту цифрового контента учебно-методической литературы для вузов с условием обязательного соблюдения авторских и смежных прав. КнигаФонд обеспечивает широкий законный доступ к необходимым для образовательного процесса изданиям с использованием инновационных технологий и соответствует всем требованиям новых ФГОС ВПО.

прочее

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВПО и учебным планом по направлению 38.03.02 "Менеджмент" и профилю подготовки Менеджмент организации .

Автор(ы):

Мишакин Т.С. \_\_\_\_\_

"\_\_" \_\_\_\_\_ 201\_\_ г.

Рецензент(ы):

Разумовская Е.М. \_\_\_\_\_

Аюпов А.А. \_\_\_\_\_

"\_\_" \_\_\_\_\_ 201\_\_ г.