

УТВЕРЖДЕНА:  
решением Учёного совета СамГУПС  
протокол № 15 от 25.02.2016г.  
в составе основной профессиональной  
образовательной программы

АКТУАЛИЗИРОВАНА:  
решением Учёного совета СамГУПС  
протокол Учёного совета СамГУПС №27 от 22.02.2017г.  
решением Учёного совета СамГУПС  
протокол Учёного совета СамГУПС №39 от 05.03.2018г.  
решением Учёного совета СамГУПС  
протокол Учёного совета СамГУПС №50 от 27.03.2019г.  
решением Учёного совета СамГУПС  
протокол Учёного совета СамГУПС №59 от 25.02.2020г.

## **Финансовые рынки (ФР)**

рабочая программа дисциплины

Направление подготовки: **38.03.01 «Экономика»**  
Направленность (профиль): **«Финансы и кредит»**  
Квалификация: **бакалавр**  
Форма обучения: **очная**  
Объем дисциплины: **4 ЗЕТ**

# 1. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ), СООТНЕСЕННЫЕ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

## 1.1. Цели освоения дисциплины (модуля)

Целью дисциплины является формирование профессиональных компетенций (ПК-22), согласно ФГОС ВО, в части представленных ниже знаний, умений и навыков.

Задачами дисциплины является изучение понятийного аппарата дисциплины, основных теоретических положений и методов, развитие навыков применения теоретических знаний для решения практических задач.

## 1.2 Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины (модуля)

**ПК-22: способностью применять нормы, регулирующие бюджетные, налоговые, валютные отношения в области страховой, банковской деятельности, учета и контроля**

<b>Знать:</b>	
<b>Уровень 1 (базовый)</b>	Возможности применения норм, регулирующих отношения в области страховой, банковской деятельности, учета и контроля
<b>Уровень 2 (продвинутый)</b>	Принципы и особенности применения норм, регулирующих отношения в области страховой, банковской деятельности, учета и контроля
<b>Уровень 3 (высокий)</b>	Весь спектр возможностей, принципов и особенностей применения норм, регулирующих отношения в области страховой, банковской деятельности, учета и контроля
<b>Уметь:</b>	
<b>Уровень 1 (базовый)</b>	Администрировать бюджетные, налоговые, валютные отношения в области финансовой деятельности
<b>Уровень 2 (продвинутый)</b>	Анализировать бюджетные, налоговые, валютные отношения в области финансовой деятельности
<b>Уровень 3 (высокий)</b>	Администрировать и анализировать бюджетные, налоговые, валютные отношения в области финансовой деятельности
<b>Владеть:</b>	
<b>Уровень 1 (базовый)</b>	Приемами применения норм, регулирующих бюджетные, налоговые, валютные отношения в области страховой, банковской деятельности, учета и контроля
<b>Уровень 2 (продвинутый)</b>	Способами применения норм, регулирующих бюджетные, налоговые, валютные отношения в области страховой, банковской деятельности, учета и контроля
<b>Уровень 3 (высокий)</b>	Методами применения норм, регулирующих бюджетные, налоговые, валютные отношения в области страховой, банковской деятельности, учета и контроля

## 1.3. Результаты обучения по дисциплине (модулю)

**В результате освоения дисциплины обучающийся должен:**

<b>Знать:</b>	
<ul style="list-style-type: none"> <li>- понятие и структуру финансовых рынков</li> <li>- основные инструменты финансовых рынков</li> <li>- ценообразование на финансовых рынках</li> <li>- функции профессиональных участников финансовых рынков</li> </ul>	
<b>Уметь:</b>	
<ul style="list-style-type: none"> <li>- осуществлять расчеты текущих и будущих значений стоимостных показателей финансовых инструментов</li> <li>- исчислять значения обобщающих финансовых индикаторов (фондовых индексов и пр.)</li> </ul>	
<b>Владеть:</b>	
<ul style="list-style-type: none"> <li>- владеть методами фундаментального и технического анализа инструментов финансовых рынков с целью применения норм, регулирующих бюджетные, налоговые, валютные отношения в области страховой, банковской деятельности, учета и контроля</li> </ul>	

## 2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Код дисциплины	Наименование дисциплины	Коды формируемых компетенций
<b>2.1 Осваиваемая дисциплина</b>		
Б1.В.ОД.8	Финансовые рынки	ПК-22
<b>2.2 Предшествующие дисциплины</b>		
-	-	-
<b>2.3 Осваиваемые параллельно дисциплины</b>		
Б1.В.ДВ.13	Банковский менеджмент	ПК-22
<b>2.4 Последующие дисциплины</b>		
Б1.В.ОД.14	Банковское дело	ПК-22
Б1.В.ДВ.17	Основы страхования и предпринимательства	ПК-22

**3. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) В ЗАЧЕТНЫХ ЕДИНИЦАХ С УКАЗАНИЕМ КОЛИЧЕСТВА АКАДЕМИЧЕСКИХ ЧАСОВ, ВЫДЕЛЕННЫХ НА КОНТАКТНУЮ РАБОТУ ОБУЧАЮЩИХСЯ С ПРЕПОДАВАТЕЛЕМ (ПО ВИДАМ УЧЕБНЫХ ЗАНЯТИЙ) И НА САМОСТОЯТЕЛЬНУЮ РАБОТУ ОБУЧАЮЩИХСЯ**

<b>3.1 Объем дисциплины (модуля)</b>	<b>4 ЗЕТ</b>
--------------------------------------	--------------

**3.2 Распределение академических часов по семестрам (для офо)/курсам( для зфо) и видам учебных занятий**

Вид занятий	№ семестра (для офо) / курса ( для зфо)																						
	1		2		3		4		5		6		7		8		9		10		Итого		
	УП	РПД	УП	РПД	УП	РПД	УП	РПД	УП	РПД	УП	РП	УП	РПД	УП	РПД	УП	РП	УП	РПД	УП	РПД	
<b>Контактная работа:</b>														56,35	56,35							56,35	56,35
<i>Лекции</i>														18	18							18	18
<i>Лабораторные</i>																							
<i>Практические</i>														36	36							36	36
<i>Контакт.часы на аттестацию</i>																							
<i>Контакт.часы на аттест. в период экзам. сессии</i>														2,35	2,35							2,35	2,35
<b>Контроль</b>														33,65	33,65							33,65	33,65
<b>Сам. работа</b>														54	54							54	54
<b>ИТОГО</b>														144	144							144	144

**3.3. Формы контроля и виды самостоятельной работы обучающегося**

Форма контроля	Семестр (офо)/ курс(зфо)	Нормы времени на самостоятельную работу обучающегося	
		Вид работы	Нормы времени, час
<b>Экзамен</b>	7	Подготовка к лекциям	0,5 часа на 1 час аудиторных занятий
		Подготовка к практическим/ лабораторным занятиям	1 час на 1 час аудиторных занятий
<b>Зачет</b>		Подготовка к зачету	9 часов (офо)
<b>Курсовой проект</b>		Выполнение курсового проекта	72 часа
<b>Курсовая работа</b>		Выполнение курсовой работы	36 часов
<b>Контрольная работа</b>		Выполнение контрольной работы	9 часов
<b>РГР</b>		Выполнение РГР	18 часов
<b>Реферат/эссе</b>		Выполнение реферата/эссе	9 часов

**4. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ), СТРУКТУРИРОВАННОЕ ПО ТЕМАМ (РАЗДЕЛАМ) С УКАЗАНИЕМ ОТВЕДЕННОГО НА НИХ КОЛИЧЕСТВА АКАДЕМИЧЕСКИХ ЧАСОВ И ВИДОВ УЧЕБНЫХ ЗАНЯТИЙ**

Код занятия	Наименование разделов и тем	Вид занятия	Семестр / курс	К-во ак.часов	Компетенции	Литература	Часы в интерактивной форме	
							К-во ак.часов	Форма занятия
	<b>Раздел 1 Финансовые рынки</b>							
1.1	Понятие финансовых рынков	Лек.	7	4	ПК-22	Л1.1		
1.2	Классификация видов финансовых рынков	Пр.	7	8	ПК-22	Л2.1, Л2.2		
1.3	Причины формирования финансовых рынков	Ср.	7	1	ПК-22	Л2.1, Л2.2		
1.4	Структура финансовых рынков	Лек.	7	2	ПК-22	Л1.1	2	дискуссия
1.5	Виды финансовых рынков	Пр.	7	4	ПК-22	Л2.1, Л2.2		
1.6	Региональные особенности финансовых рынков	Ср.	7	1	ПК-22	Л2.1, Л2.2		
1.7	Секьюритизация на финансовых рынках	Лек.	7	2	ПК-22	Л1.1	2	дискуссия

1.8	Задачи и методы проведения секьюритизации	Пр.	7	4	ПК-22	Л2.1, Л2.2		
1.9	Основные виды секьюритизации	Ср.	7	1	ПК-22	Л2.1, Л2.2		
1.10	Профессиональные участники финансовых рынков	Лек.	7	2	ПК-22	Л1.1	2	дискуссия
1.11	Виды профессиональных услуг на финансовых рынках	Пр.	7	4	ПК-22	Л2.1, Л2.2		
1.12	Отличительные черты видов профессиональной деятельности	Ср.	7	1	ПК-22	Л2.1, Л2.2		
	<b>Раздел 2. Финансовые инструменты</b>							
2.1	Классификация видов финансовых инструментов	Лек.	7	2	ПК-22	Л1.1	2	дискуссия
2.2	Основные различия в ценообразовании финансовых инструментов	Пр.	7	4	ПК-22	Л2.1, Л2.2		
2.3	Факторы ценообразования финансовых инструментов	Ср.	7	1	ПК-22	Л2.1, Л2.2		
2.4	Инструменты банковского сектора: депозиты и векселя	Лек.	7	2	ПК-22	Л1.1	2	дискуссия
2.5	Методы определения стоимости финансовых инструментов банковского сектора	Пр.	7	4	ПК-22	Л2.1, Л2.2		
2.6	Особенности определения стоимости банковских финансовых инструментов	Ср.	7	1	ПК-22	Л2.1, Л2.2		
2.7	Основные инструменты рынка ценных бумаг (фондового рынка): акции и облигации	Лек.	7	2	ПК-22	Л1.1		
2.8	Методы ценообразования по акциям и облигациям	Пр.	7	4	ПК-22	Л2.1, Л2.2		
2.9	Особенности ценообразования по акциям и облигациям	Ср.	7	1	ПК-22	Л2.1, Л2.2		
2.10	Производные инструменты рынка ценных бумаг (фондового рынка): фьючерсы и опционы	Лек.	7	2	ПК-22	Л1.1		
2.11	Методы ценообразования по фьючерсам и опционам	Пр.	7	4	ПК-22	Л2.1, Л2.2		
2.12	Особенности ценообразования по фьючерсам и опционам	Ср.	7	2	ПК-22	Л2.1, Л2.2		
2.13	Контактные часы на аттестацию в период экзаменационной сессии	КЭ	7	2,35	ПК-22			
	<b>Раздел 3. Самостоятельная работа обучающихся</b>							
3.1	Подготовка к лекциям	Ср.	7	9	ПК-22	Л1.1		
3.2	Подготовка к лабораторным работам	Ср.	7	36	ПК-22	Л2.1, Л2.2		

**5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)**

**5.1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы**

ПК-22: способностью применять нормы, регулирующие бюджетные, налоговые, валютные отношения в области страховой, банковской деятельности, учета и контроля

**Матрица оценки результатов обучения по дисциплине**

Код компетенции	Планируемые результаты обучения (показатели освоения компетенций)	Оценочные средства/формы контроля		
		Дискуссия	Тестовое задание	Экзамен
ПК-22	Знает	+	+	+
	Умеет	+	+	+
	Владеет	+	+	+

## 5.2 Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

### Критерии формирования оценок по выполнению тестовых заданий

«Отлично» (5 баллов) – получают обучающиеся с правильным количеством ответов на тестовые вопросы – 100 – 90% от общего объема заданных тестовых вопросов.

«Хорошо» (4 балла) – получают обучающиеся с правильным количеством ответов на тестовые вопросы – 89 – 70% от общего объема заданных тестовых вопросов.

«Удовлетворительно» (3 балла) – получают обучающиеся с правильным количеством ответов на тестовые вопросы – 69 – 40% от общего объема заданных тестовых вопросов.

«Неудовлетворительно» (0 баллов) – получают обучающиеся с правильным количеством ответов на тестовые вопросы – менее 39% от общего объема заданных тестовых вопросов.

### Критерии формирования оценок по результатам дискуссии

«Отлично» (5 баллов) – обучающийся показал глубокие знания материала по поставленным вопросам, грамотно, логично его излагает, структурировал и детализировал информацию, информация представлена в переработанном виде.

«Хорошо» (4 балла) – обучающийся твердо знает материал, грамотно его излагает, не допускает существенных неточностей в ответ на вопросы, представляет наглядный материал, помогающий слушателям запомнить основные пункты выступления.

«Удовлетворительно» (3 балла) – обучающийся имеет знания основного материала по поставленным вопросам, но не усвоил его деталей, допускает отдельные неточности.

«Неудовлетворительно» (0 баллов) – обучающийся допускает грубые ошибки в ответе на поставленные вопросы демонстрирует отсутствие необходимой информации в презентации

### Критерии формирования оценок по экзамену

К экзамену допускаются студенты, выполнившие более 60% заданий по самостоятельной работе в 5 семестре.

«Отлично» (5 баллов) – студент демонстрирует знание всех разделов изучаемой дисциплины: содержание базовых понятий и фундаментальных проблем; умение излагать программный материал с демонстрацией конкретных примеров. Свободное владение материалом должно характеризоваться логической ясностью и четким видением путей применения полученных знаний в практической деятельности, умением связать материал с другими отраслями знания.

«Хорошо» (4 балла) – студент демонстрирует знания всех разделов изучаемой дисциплины: содержание базовых понятий и фундаментальных проблем; приобрел необходимые умения и навыки, освоил вопросы практического применения полученных знаний, не допустил фактических ошибок при ответе, достаточно последовательно и логично излагает теоретический материал, допуская лишь незначительные нарушения последовательности изложения и некоторые неточности. Таким образом данная оценка выставляется за правильный, но недостаточно полный ответ.

«Удовлетворительно» (3 балла) – студент демонстрирует знание основных разделов программы изучаемого курса: его базовых понятий и фундаментальных проблем. Однако знание основных проблем курса не подкрепляются конкретными практическими примерами, не полностью раскрыта сущность вопросов, ответ недостаточно логичен и не всегда последователен, допущены ошибки и неточности.

«Неудовлетворительно» (0 баллов) – выставляется в том случае, когда студент демонстрирует фрагментарные знания основных разделов программы изучаемого курса: его базовых понятий и фундаментальных проблем. У экзаменуемого слабо выражена способность к самостоятельному аналитическому мышлению, имеются затруднения в изложении материала, отсутствуют необходимые умения и навыки, допущены грубые ошибки и незнание терминологии, отказ отвечать на дополнительные вопросы, знание которых необходимо для получения положительной оценки.

## 5.3 Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций

### Вопросы к экзамену

1. Понятие о финансовых рынках
2. Основные виды финансовых рынков
3. Банковский сектор финансовых рынков
4. Рынок ценных бумаг как сектор финансовых рынков
5. Секьюритизация финансовых рынков
6. Финансовые институты
7. Финансовые инструменты
8. Виды профессиональной деятельности на финансовых рынках
9. Брокерская деятельность
10. Дилерская деятельность
11. Регистрационная деятельность
12. Депозитарная деятельность
13. Клиринговая деятельность
14. Деятельность по организации торгов ценными бумагами
15. Доверительное управление ценными бумагами
16. Доходность и риск в финансовом инвестировании
17. Портфельное инвестирование
18. Диверсификация финансовых активов

19. Виды ценных бумаг
20. Акции и другие виды долевых ценных бумаг
21. Облигации и другие виды долговых ценных бумаг
22. Производные финансовые инструменты (фьючерсы и опционы)
23. Методы определения стоимостных оценок акций
24. Методы определения стоимостных оценок облигаций
25. Методы определения доходности инвестиций в акции
26. Методы определения доходности инвестиций в облигации
27. Методы фундаментального анализа финансовых инструментов
28. Методы технического анализа финансовых инструментов
29. Паевые инвестиционные фонды
30. Фондовые индексы

#### 5.4 Методические материалы, определяющие процедуры оценивания

Критерием успешности освоения учебного материала обучающимся является экспертная оценка преподавателя регулярности посещения учебных занятий, результатов работы на практических занятиях, а так же тестовых заданий.

Оценочные средства для текущего контроля успеваемости включают в себя вопросы к теоретическим занятиям для участия в дискуссии; практические задания, контрольные тесты.

Промежуточная аттестация основывается на оценке знаний при ответе на контрольные вопросы и (или) выполнении итоговых тестовых заданий (в системе «Moodle»: режим доступа: <http://do.samgups.ru/moodle/>).

#### Порядок проведения экзамена:

Экзамен проводится по итогам текущей успеваемости и других видов работ, предусмотренных программой дисциплины и (или) путем организации специального опроса, проводимого в устной и (или) письменной форме.

### 6. ПЕРЕЧЕНЬ УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ ДЛЯ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

#### 6.1 Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

##### 6.1.1. Основная литература

	Авторы,	Заглавие	Издательство, год	Кол-во
Л1.1	Брюховецкая С.В., под ред., Рубцов Б.Б. ред.	Финансовые рынки. + eПриложение : учебник (бакалавриат)	Москва : КноРус, 2019. — 462 с.	URL: <a href="https://book.ru/book/931930">https://book.ru/book/931930</a>

##### 6.1.2 Дополнительная литература

	Авторы,	Заглавие	Издательство, год	Кол-во
Л2.1	В.А. Зверев, А.В. Зверева, С.Г. Евсюков, Д.П. Никитина	Азбука частного инвестора: Путеводитель по финансовому рынку — 3-е изд.	Москва : Дашков и К, 2018. — 248 с.	URL: <a href="https://e.lanbook.com/book/103738">https://e.lanbook.com/book/103738</a>
Л2.2	Лаврушин О.И., Халилова М.Х.	Финансовые рынки и банки-2018 : монография	Москва : КноРус, 2019. — 199 с.	URL: <a href="https://book.ru/book/934585">https://book.ru/book/934585</a>

#### 6.2 Методические разработки

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Кол-во
М 1	Карышев М.Ю., Жаркова К.С.	Практикум по дисциплине «Финансовые рынки» для бакалавров направления подготовки 38.03.01 (080100) «Финансы и кредит» очной и заочной форм обучения	Самара: СамГУПС, 2015. – 26 с.	<a href="http://www.edd.lib@samgups.ru">www.edd.lib@samgups.ru</a>

#### 6.3. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"

	Наименование ресурса	Эл.адрес
Э1	Дистанционные образовательные ресурсы СамГУПС	<a href="http://do.samgups.ru/moodle/course/view.php?id=2078">http://do.samgups.ru/moodle/course/view.php?id=2078</a>
Э2	Образовательно-справочный сайт по экономике	<a href="http://www.economicus.ru/">http://www.economicus.ru/</a>
Э3	Экономика и финансы – публикации, статьи, обзоры, аналитика	<a href="http://www.finansy.ru/">http://www.finansy.ru/</a>
Э4	Федеральный образовательный портал – Экономика, Социология, Менеджмент	<a href="http://www.ecsocman.edu.ru/">http://www.ecsocman.edu.ru/</a>

### 7. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Для освоения дисциплины обучающемуся необходимо: систематически посещать лекционные занятия; активно участвовать в обсуждении предложенных вопросов и выполнять практические задания; выполнить курсовую работу; успешно пройти все формы текущего контроля; сдать зачет.

Для подготовки к итоговым испытаниям по дисциплине необходимо использовать: материалы лекций, рекомендуемой основной и дополнительной литературой; методические материалы.

Для теоретического и практического усвоения дисциплины большое значение имеет самостоятельная работа обучающихся, которая может осуществляться как индивидуально, так и под руководством обучающего. Данная работа предполагает самостоятельное изучение обучающимся отдельных тем, дополнительную подготовку к каждому лекционному и практическому занятию.

Самостоятельная работа обучающихся является важной формой образовательного процесса. Она реализуется вне рамок расписания, а также в библиотеке, дома, при выполнении учебных и творческих задач.

Цель самостоятельной работы - научить обучающегося осмысленно и самостоятельно работать сначала с учебным материалом, затем с научной информацией, заложить основы самоорганизации и самовоспитания с тем, чтобы повысить уровень освоения компетенций, а так же привить умение в дальнейшем непрерывно повышать свою квалификацию.

## **8. ИНФОРМАЦИОННЫЕ ТЕХНОЛОГИИ, ИСПОЛЬЗУЕМЫЕ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)**

Размещение учебных материалов в разделе «Финансовые рынки» системы обучения Moodle:

<http://do.samgups.ru/moodle/course/view.php?id=2078>

### **8.1 Перечень программного обеспечения**

Microsoft Office

### **8.2 Перечень информационных справочных систем**

8.2.1 Гарант

8.2.2 Консультант плюс

**8.3. Современные профессиональные базы данных:** База данных «Макроэкономика» - информационно- аналитический раздел официального сайта Министерства финансов РФ - [http://info.minfin.ru/prices\\_index.ph](http://info.minfin.ru/prices_index.ph)

## **9. ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)**

Лекционная аудитория (9207, 9211, 9213, 9215) или любая другая учебная аудитория, оборудованная учебной мебелью, на 30 и более посадочных мест в соответствии с расписанием занятий.

Учебная аудитория для проведения практических занятий (9206, 9208, 9209, 9210, 9212, 9214, 9224, 9225) или любая другая учебная аудитория, оборудованная учебной мебелью, на 30 и более посадочных мест в соответствии с расписанием занятий.

Аудитория для проведения самостоятельной работы обучающихся, имеющая неограниченный доступ к электронно-библиотечным системам (через ресурсы библиотеки СамГУПС), к электронной информационно-образовательной среде moodle и к информационно-телекоммуникационной сети «Интернет».