

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ
ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«КУБАНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»
Факультет - экономический

УТВЕРЖДАЮ:

Проректор по учебной работе,
качеству образования – первый
проректор



Т.А. Хагуров

«31» мая 2024 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)
Б1.В.13 ПЛАНИРОВАНИЕ И БИЗНЕС-МОДЕЛИРОВАНИЕ НА
ФИНАНСОВЫХ РЫНКАХ

Направление подготовки/специальность 38.04.08 Финансы и кредит

Направленность (профиль) / специализация Финансовые рынки и банки

Форма обучения очная, заочная

Квалификация Магистр

Краснодар 2024

Рабочая программа дисциплины «Современная практика риск-менеджмента» составлена в соответствии с федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования (ФГОС ВО) по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит

Программу составил (и):
В.А. Тюфанов, канд. экон. наук, доцент



Рабочая программа дисциплины «Современная практика риск - менеджмента» утверждена на заседании кафедры экономического анализа, статистики и финансов протокол № 8 от 7 мая 2024 г.

И.о. заведующего кафедрой экономического анализа, статистики и финансов

Л.Н. Дробышевская, доктор экон. наук, профессор



Утверждена на заседании учебно-методической комиссии экономического факультета протокол № 10 от 17 мая 2024 г.

Председатель УМК факультета
Л.Н. Дробышевская
доктор экон. наук, профессор



Рецензенты:

Захарова Л.Н., канд. экон. наук, доцент кафедры экономики предприятия, регионального и кадрового менеджмента ФГБОУ ВО «Кубанский государственный университет»

Коржевский А.Ю., генеральный директор ООО «ЗВСК - Инвест»

1 Цели и задачи изучения дисциплины

1.1 Цель дисциплины

Формирование у обучающихся профессиональных компетенций, позволяющих на основе современных аналитических инструментов исследовать различные сегменты рынка финансовых услуг для решения прикладных инвестиционных задач.

1.2 Задачи дисциплины

1. Усвоение понятийно-категориального аппарата, характеризующего процессы и явления финансового рынка;
2. Раскрыть инструментально-институциональную составляющую функционирования финансового рынка;
3. Обозначить взаимосвязи и взаимозависимости между финансовым и реальным сектором экономики;
4. Развить способности обучающихся в применении современных количественных методов познания процессов, происходящих на рынке финансовых услуг;
5. Познакомить с особенностями управления портфелем финансовых активов на примере реального рынка;
6. Обозначить роль и место государства в регулировании финансового рынка.

1.3 Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Дисциплина «Планирование и бизнес-моделирование на финансовых рынках» является базовой дисциплиной Блока 1 «Дисциплины (модули)» учебного плана. Дисциплина предназначена для магистрантов второго года обучения направления «Финансы и кредит», читается в 3 семестре 2 курса. Дисциплина читается после ряда гуманитарных, математических, общеэкономических и специальных дисциплин, позволяющих наиболее эффективно усваивать учебный материал в рамках данного курса. Предполагается также, что студенты обладают базовыми знаниями и навыками в области «Финансов и кредита», «Экономического анализа», «Финансовой математики».

Знания, полученные в ходе изучения дисциплины, дополняют набор компетенций, приобретаемых на дисциплинах «Конкуренция на финансовых рынках», «Портфельные теории и управление активами».

1.4 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Изучение данной учебной дисциплины направлено на формирование у обучающихся профессиональных компетенций

Код и наименование индикатора достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине
ПК-1 Способен осуществлять самостоятельные научные исследования по перспективным направлениям финансов	
ИПК-1.1 Выявляет перспективные направления исследования, обосновывает ее актуальность, составляет программу исследований	Знает основные направления развития дистанционного банковского обслуживания; Знает методы консультационного обслуживания клиентов в финансово-кредитной сфере
	Умеет проводить исследования, посвященные цифровой трансформации финансовой сферы; Умеет презентовать результаты исследований в виде научных публикаций и докладов
	Управляет портфелем финансовых активов банковских институций; Совершенствует корпоративные процессы

	управления кредитными ресурсами коммерческих банков
ИПК-1.2 Выполняет самостоятельные научные исследования в соответствии с разработанной программой	Знает основные направления развития дистанционного банковского обслуживания; Знает методы консультационного обслуживания клиентов в финансово-кредитной сфере
	Умеет проводить исследования, посвященные цифровой трансформации финансовой сферы; Умеет презентовать результаты исследований в виде научных публикаций и докладов
	Управляет портфелем финансовых активов банковских институций; Совершенствует корпоративные процессы управления кредитными ресурсами коммерческих банков
ИПК-1.3 Представляет результаты проведенного исследования научному сообществу в виде статьи или доклада	Знает основные направления развития дистанционного банковского обслуживания; Знает методы консультационного обслуживания клиентов в финансово-кредитной сфере
	Умеет проводить исследования, посвященные цифровой трансформации финансовой сферы; Умеет презентовать результаты исследований в виде научных публикаций и докладов
	Управляет портфелем финансовых активов банковских институций; Совершенствует корпоративные процессы управления кредитными ресурсами коммерческих банков
ПК-2 Способен разрабатывать стратегии развития дистанционного банковского обслуживания	
ИПК-2.1 Анализирует и определяет перспективные направления развития дистанционного банковского обслуживания	Знает основные направления развития дистанционного банковского обслуживания; Знает методы консультационного обслуживания клиентов в финансово-кредитной сфере
	Умеет проводить исследования, посвященные цифровой трансформации финансовой сферы; Умеет презентовать результаты исследований в виде научных публикаций и докладов
	Управляет портфелем финансовых активов банковских институций; Совершенствует корпоративные процессы управления кредитными ресурсами коммерческих банков
ИПК-2.2 Демонстрирует способность разрабатывать аналитическое обоснование и план стратегического развития дистанционного банковского	Знает основные направления развития дистанционного банковского обслуживания; Знает методы консультационного обслуживания клиентов в финансово-

обслуживания	кредитной сфере
	Умеет проводить исследования, посвященные цифровой трансформации финансовой сферы; Умеет презентовать результаты исследований в виде научных публикаций и докладов
	Управляет портфелем финансовых активов банковских институций; Совершенствует корпоративные процессы управления кредитными ресурсами коммерческих банков
ПК-3 Способен консультировать партнеров, клиентов и контрагентов при проведении кредитных сделок	
ИПК-3.1 Демонстрирует способность проводить аналитическое обоснование сделок корпоративного кредитования и консультирование государственных и муниципальных органов, руководителей корпораций и финансовых компаний	Знает основные направления развития дистанционного банковского обслуживания; Знает методы консультационного обслуживания клиентов в финансово-кредитной сфере
	Умеет проводить исследования, посвященные цифровой трансформации финансовой сферы; Умеет презентовать результаты исследований в виде научных публикаций и докладов
	Управляет портфелем финансовых активов банковских институций; Совершенствует корпоративные процессы управления кредитными ресурсами коммерческих банков
ПК-4 Способен управлять корпоративным кредитным портфелем	
ИПК-4.2 Демонстрирует способность разрабатывать предложения по совершенствованию бизнес-процессов по корпоративному кредитованию	Знает основные направления развития дистанционного банковского обслуживания; Знает методы консультационного обслуживания клиентов в финансово-кредитной сфере
	Умеет проводить исследования, посвященные цифровой трансформации финансовой сферы; Умеет презентовать результаты исследований в виде научных публикаций и докладов
	Управляет портфелем финансовых активов банковских институций; Совершенствует корпоративные процессы управления кредитными ресурсами коммерческих банков

2. Структура и содержание дисциплины

2.1 Распределение трудоёмкости дисциплины по видам работ

Общая трудоёмкость дисциплины составляет 3 зач.ед. (108 часов), их распределение по видам работ представлено в таблице

Вид учебной работы	Всего часов	Форма обучения		
		ОФО	ЗФО	
		Семестр	Курс	
		3	2	
Контактные часы, в том числе	24,2	24,2	12,2	
Аудиторные занятия (всего)	24	24	12	
Занятия лекционного типа	6	6	4	
Занятия семинарского типа (семинары, практические занятия)	18	18	8	
Иная контактная работа:	0,2	0,2	0,2	
Контролируемая самостоятельная работа (КСР)				
Промежуточная аттестация (ИКР)	0,2	0,2	0,2	
Самостоятельная работа, в том числе	83,8	83,8	92	
Проработка учебного теоретического материала (Самостоятельное изучение разделов)	40	40	40	
Подготовка к текущему контролю	43,8	43,8	52	
Контроль:			3,8	
Подготовка к зачету			3,8	
Общая трудоемкость	час	108	108	108
	в том числе контактная работа	24,2	24,2	12,2
	зач. ед	3	3	3

2.2 Структура дисциплины:

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины.

Разделы (темы) дисциплины, изучаемые в 3 семестре (ОФО)

№ раздела	Наименование тем	Количество часов				
		Всего	Аудиторная работа			Внеаудиторная работа
			Л	ПЗ	ЛР	
1	2	3	4	5	6	7
1.	Финансовый рынок в воспроизводственных процессах	12	2	2		8
2.	Институциональное обеспечение финансовых рынков	12	2	2		8
3.	Государственное регулирование финансового рынка	12	2	2		8
4.	Классические и современные инструменты финансового рынка	11,3		2		9,3
5.	Анализ межсегментного взаимодействия институтов финансового рынка	14		2		12
6.	Аналитические инструменты портфельного инвестирования	18		4		14

7.	Анализ взаимодействия институтов финансового рынка и реального сектора экономики	14		2		12
8.	Экономико-математические методы анализа финансового рынка	14		2		12
<i>Итого по дисциплине:</i>			6	18		83,8

Примечание: Л – лекции, ПЗ – практические занятия / семинары, ЛР – лабораторные занятия, СРС – самостоятельная работа студента

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины.
Разделы (темы) дисциплины, изучаемые на втором курсе (ЗФО)

№ раздела	Наименование тем	Количество часов				
		Всего	Аудиторная работа			Внеаудиторная работа
			Л	ПЗ	ЛР	СРС
1	2	3	4	5	6	7
1.	Финансовый рынок в воспроизводственных процессах	13	2	2		9
2.	Институциональное обеспечение финансовых рынков	13	2	2		9
3.	Государственное регулирование финансового рынка	13		2		11
4.	Классические и современные инструменты финансового рынка	13		2		11
5.	Анализ межсегментного взаимодействия институтов финансового рынка	13				13
6.	Аналитические инструменты портфельного инвестирования	13				13
7.	Анализ взаимодействия институтов финансового рынка и реального сектора экономики	13				13
8.	Экономико-математические методы анализа финансового рынка	13				13
<i>Итого по дисциплине:</i>			4	8		92

Примечание: Л – лекции, ПЗ – практические занятия / семинары, ЛР – лабораторные занятия, СРС – самостоятельная работа студента

2.3 Содержание разделов(тем) дисциплины:

2.3.1 Занятия лекционного типа

№	Наименование раздела(темы)	Содержание раздела (темы)	Форма текущего контроля
1	2	3	4
1.	Финансовый рынок в воспроизводственных процессах	1. Понятие финансового рынка 2. Сегменты финансового рынка и их взаимодействие	Контрольные вопросы

		3. Историческая типизация финансового капитала 4. Взаимосвязь современного типа производства и финансов 5. Глобализация финансовых рынков	
2.	Институциональное обеспечение финансовых рынков	1. Основные инфраструктурные институты финансового рынка 2. Информационные потоки на финансовом рынке 3. Роль саморегулируемых организаций в рыночном ценообразовании 4. Глобальные финансовые институты и их взаимодействие с российским рынком	Контрольные вопросы
3.	Государственное регулирование финансового рынка	1. Эволюция форм и методов государственного регулирования финансового рынка 2. Становление института мегарегулирования 3. Законодательные и монетарные методы воздействия государства на финансовый рынок 4. Постмонетарные концепции развития взаимодействия государства и институтов рынка финансовых услуг	Контрольные вопросы
4.	Классические и современные инструменты финансового рынка	1. Долевые инструменты (акции, паи) 2. Долговые инструменты (облигации, векселя) 3. Ссудо-сберегательные инструменты (депозиты, сертификаты) 4. Страхование на финансовом рынке	Контрольные вопросы
5.	Анализ межсегментного взаимодействия институтов финансового рынка	1. Принципы сегментации финансового рынка 2. Рынок капиталов 3. Валютный рынок 4. Рынок золота 5. Денежный рынок	Контрольные вопросы
6.	Аналитические инструменты портфельного инвестирования	1. Расчет риска и ликвидности портфеля 2. Бета и Альфа коэффициенты 3. Инструменты фундаментального анализа 4. Хеджирование портфеля	Контрольные вопросы
7.	Анализ взаимодействия институтов финансового рынка и реального сектора экономики	1. Взаимосвязь процентных ставок и денежного предложения 2. Отраслевая и региональная дифференциация взаимодействия институтов рынка финансовых услуг и субъектов реальной экономики в России	Контрольные вопросы
8.	Экономико-математические методы анализа финансового рынка	1. Модель У. Шарпа 2. САРМ – модель 3. Регрессионный анализ ценообразования на финансовом рынке	Контрольные вопросы

2.3.2 Занятия семинарского типа

№	Наименование раздела	Тематика практических занятий	Форма текущего контроля
1	2	3	4
1.	Финансовый рынок в воспроизводственных процессах	1. Понятие финансового рынка 2. Сегменты финансового рынка и их взаимодействие 3. Историческая типизация финансового капитала 4. Взаимосвязь современного типа производства и финансов 5. Глобализация финансовых рынков	О
2.	Институциональное обеспечение финансовых рынков	1. Основные инфраструктурные институты финансового рынка 2. Информационные потоки на финансовом рынке 3. Роль саморегулируемых организаций в рыночном ценообразовании 4. Глобальные финансовые институты и их взаимодействие с российским рынком	О
3.	Государственное регулирование финансового рынка	1. Эволюция форм и методов государственного регулирования финансового рынка 2. Становление института мегарегулирования 3. Законодательные и монетарные методы воздействия государства на финансовый рынок 4. Постмонетарные концепции развития взаимодействия государства и институтов рынка финансовых услуг	О
4.	Классические и современные инструменты финансового рынка	1. Долевые инструменты (акции, паи) 2. Долговые инструменты (облигации, векселя) 3. Ссудо-сберегательные инструменты (депозиты, сертификаты) 4. Страхование на финансовом рынке 5. Производные финансовые инструменты (форварды, фьючерсы, опционы, депозитарные расписки) 6. Операции РЕПО, валютные и процентные свопы 7. Сделки с драгоценными металлами 8. Валютные операции на финансовом рынке	О
5.	Анализ	1. Принципы сегментации	К

	межсегментного взаимодействия институтов финансового рынка	финансового рынка 2. Рынок капиталов 3. Валютный рынок 4. Рынок золота 5. Денежный рынок 6. Страховой рынок 7. Переливы капиталов внутри сегментов финансового рынка	
6.	Аналитические инструменты портфельного инвестирования	1. Классификация инвестиционных портфелей 2. Определение доходности портфеля 3. Расчет риска и ликвидности портфеля 4. Бета и Альфа коэффициенты 5. Инструменты фундаментального анализа 6. Хеджирование портфеля	К
7.	Анализ взаимодействия институтов финансового рынка и реального сектора экономики	1. Взаимосвязь процентных ставок и денежного предложения 2. Отраслевая и региональная дифференциация взаимодействия институтов рынка финансовых услуг и субъектов реальной экономики в России	К
8.	Экономико-математические методы анализа финансового рынка	1. Модель У. Шарпа 2. САРМ – модель 3. Регрессионный анализ ценообразования на финансовом рынке	К

О-устный опрос, К- кейс

2.3.3 Лабораторные занятия

Лабораторные занятия - не предусмотрены

2.3.4 Примерная тематика курсовых работ (проектов)

Курсовая работа (проект) – не предусмотрены.

2.4 Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

№	Вид СР	Перечень учебно-методического обеспечения дисциплины по выполнению самостоятельной работы
1	2	3
1.	Занятия лекционного и семинарского типа	Методические указания для подготовки к занятиям лекционного и семинарского типа. Утверждены на заседании Совета экономического факультета ФГБОУ ВО «КубГУ». Протокол № 1 от 30 августа 2018 года. Режим доступа: https://www.kubsu.ru/ru/econ/metodicheskie-ukazaniya
2.	Подготовка эссе, рефератов	Методические указания для подготовки эссе, рефератов, курсовых работ. Утверждены на заседании Совета экономического факультета ФГБОУ ВО «КубГУ». Протокол № 1 от 30 августа 2018 года. Режим доступа:

		https://www.kubsu.ru/ru/econ/metodicheskie-ukazaniya
3.	Выполнение лабораторных работ	Методические указания по выполнению лабораторных работ. Утверждены на заседании Совета экономического факультета ФГБОУ ВО «КубГУ». Протокол № 1 от 30 августа 2018 года. Режим доступа: https://www.kubsu.ru/ru/econ/metodicheskie-ukazaniya
4.	Выполнение самостоятельной работы обучающихся	Методические указания по выполнению самостоятельной работы обучающихся. Утверждены на заседании Совета экономического факультета ФГБОУ ВО «КубГУ». Протокол № 1 от 30 августа 2018 года. Режим доступа: https://www.kubsu.ru/ru/econ/metodicheskie-ukazaniya
5.	Выполнение расчетно-графических заданий	Методические указания по выполнению расчетно-графических заданий. Утверждены на заседании Совета экономического факультета ФГБОУ ВО «КубГУ». Протокол № 1 от 30 августа 2018 года. Режим доступа: https://www.kubsu.ru/ru/econ/metodicheskie-ukazaniya
6.	Интерактивные методы обучения	Методические указания по интерактивным методам обучения. Утверждены на заседании Совета экономического факультета ФГБОУ ВО «КубГУ». Протокол № 1 от 30 августа 2018 года. Режим доступа: https://www.kubsu.ru/ru/econ/metodicheskie-ukazaniya

Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся из числа инвалидов и лиц с инвалидностью (ОВЗ) предоставляются в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

Для лиц с нарушениями зрения:

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

Для лиц с нарушениями слуха:

- в печатной форме,
- в форме электронного документа.

Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

- в печатной форме,
- в форме электронного документа.

Данный перечень может быть конкретизирован в зависимости от контингента обучающихся.

3. Образовательные технологии

В процессе изучения дисциплины лекции, семинары, практические занятия, консультации являются ведущими формами обучения в рамках лекционно-семинарской образовательной технологии.

Лекции излагаются в виде презентации с использованием мультимедийной аппаратуры. Данные материалы в электронной форме передаются студентам.

Основной целью практических занятий является разбор практических ситуаций. Дополнительной целью практических занятий является контроль усвоения пройденного материала. На практических занятиях также осуществляется проверка выполнения заданий.

В соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки используются при освоении дисциплины в учебном процессе активные и интерактивные (взаимодействующие) формы проведения занятий. При реализации различных видов

учебной работы (лекций и практических занятий) используются следующие образовательные технологии:

- лекция-визуализация;
- опрос;
- дискуссия;

В сочетании с внеаудиторной работой они создают дополнительные условия формирования и развития требуемых компетенций обучающихся, поскольку позволяют обеспечить активное взаимодействие всех участников. Эти методы способствуют личностно-ориентированному подходу.

Для лиц с ограниченными возможностями здоровья предусмотрена организация консультаций с использованием электронных личных кабинетов.

Семестр	Вид занятия (Л, ПР, ЛР)	Используемые интерактивные образовательные технологии	Количество часов
1	<i>ПР</i>	Дискуссии	8
<i>Итого:</i>			8

4. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации

4.1 Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля

Пример вопросов к устному опросу

Тема: Финансовый рынок в воспроизводственных процессах

1. Понятие финансового рынка
 2. Сегменты финансового рынка и их взаимодействие
 3. Историческая типизация финансового капитала
 4. Взаимосвязь современного типа производства и финансов
- Глобализация финансовых рынков

Пример кейсов

На основе данных Московской биржи необходимо скорректировать инвестиционный портфель, используя модель ценообразования активов (CAPM)

Инструменты	Eg		Ro	Rm-Ro	коэф.В	B*(Rm-Ro)	Ru
	Последняя дох-ть						
1.ФосАгро ОАО ао	Последняя дох-ть	26%	2,00		1,76		
	Срд.ожид.дох-ть	6%					
2."Магнит" ОАО ао	Последняя дох-ть	20%	2,00		1,78		
	Срд.ожид.дох-ть	7%					
3.РДР Юнайтед Компани РУСАЛ Плс	Последняя дох-ть	58%	2,00		5,26		
	Срд.ожид.дох-ть	-1%					
4.Polymetal International plc	Последняя дох-ть	49%	2,00		3,92		
	Срд.ожид.дох-ть	7%					
5.МегаФон ОАО ао	Последняя дох-ть	-2%	2,00		0,12		
	Срд.ожид.дох-ть	-1%					
6.АЛРОСА ОАО ао	Последняя дох-ть	31%	2,00		2,07		
	Срд.ожид.дох-ть	7%					
7.НК ЛУКОЙЛ (ОАО) - ао	Последняя дох-ть	6%	2,00		1,33		

	Срд.ожд.дох-ть	-6%					
8.Сбербанк России ОАО ап	Последняя дох-ть	-11%	2,00		-0,45		
	Срд.ожд.дох-ть	-4%					
9.Фьючерсный контракт RTS-6.15	Последняя дох-ть	-18%	2,00		-1,08		
	Срд.ожд.дох-ть	-8%					
10. "Газпром" (ОАО) ао	Последняя дох-ть	5%	2,00		0,65		
	Срд.ожд.дох-ть	1%					

4.2 Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации Примерные вопросы для подготовки к зачету

1. Понятие финансового рынка
2. Сегменты финансового рынка и их взаимодействие
3. Историческая типизация финансового капитала
4. Взаимосвязь современного типа производства и финансов
5. Глобализация финансовых рынков
6. Основные инфраструктурные институты финансового рынка
7. Информационные потоки на финансовом рынке
8. Роль саморегулируемых организаций в рыночном ценообразовании
9. Глобальные финансовые институты и их взаимодействие с российским рынком
10. Эволюция форм и методов государственного регулирования финансового рынка
11. Становление института мегарегулирования
12. Законодательные и монетарные методы воздействия государства на финансовый рынок
13. Постмонетарные концепции развития взаимодействия государства и институтов рынка финансовых услуг
14. Долевые инструменты (акции, паи)
15. Долговые инструменты (облигации, векселя)
16. Ссудо-сберегательные инструменты (депозиты, сертификаты)
17. Страхование на финансовом рынке
18. Производные финансовые инструменты (форварды, фьючерсы, опционы, депозитарные расписки)
19. Операции РЕПО, валютные и процентные свопы
20. Сделки с драгоценными металлами
21. Валютные операции на финансовом рынке
22. Принципы сегментации финансового рынка
23. Рынок капиталов
24. Валютный рынок
25. Рынок золота
26. Денежный рынок
27. Страховой рынок
28. Переливы капиталов внутри сегментов финансового рынка
29. Классификация инвестиционных портфелей
30. Определение доходности портфеля
31. Расчет риска и ликвидности портфеля
32. Бета и Альфа коэффициенты
33. Инструменты фундаментального анализа
34. Хеджирование портфеля
35. Экономический рост и финансовый рынок

36. Взаимосвязь процентных ставок и денежного предложения
37. Отраслевая и региональная дифференциация взаимодействия институтов рынка финансовых услуг и субъектов реальной экономики в России
38. Модель У. Шарпа
39. CAPM – модель
40. Регрессионный анализ ценообразования на финансовом рынке

Оценочные средства для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья выбираются с учетом их индивидуальных психофизических особенностей.

– при необходимости инвалидам и лицам с ограниченными возможностями здоровья предоставляется дополнительное время для подготовки ответа на зачете;

– при проведении процедуры оценивания результатов обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья предусматривается использование технических средств, необходимых им в связи с их индивидуальными особенностями;

– при необходимости для обучающихся с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов процедура оценивания результатов обучения по дисциплине может проводиться в несколько этапов.

Процедура оценивания результатов обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья по дисциплине (модулю) предусматривает предоставление информации в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

Для лиц с нарушениями зрения:

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

Для лиц с нарушениями слуха:

- в печатной форме,
- в форме электронного документа.

Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

- в печатной форме,
- в форме электронного документа.

Данный перечень может быть конкретизирован в зависимости от контингента обучающихся.

5. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

5.1 Основная литература:

1. Гусева, И. А. Финансовые рынки и институты: учебник и практикум для вузов / И. А. Гусева. — Москва: Издательство Юрайт, 2022. — 347 с. // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/489743>.

2. Международный финансовый рынок: учебник и практикум для вузов / М. А. Эскиндаров [и др.]; под общей редакцией М. А. Эскиндарова, Е. А. Звоновой. — Москва: Издательство Юрайт, 2022. — 453 с. // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/490108>.

3. Финансовые рынки и институты: учебник и практикум для вузов / Н. Б. Болдырева [и др.]; под редакцией Н. Б. Болдыревой, Г. В. Черновой. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2022. — 379 с. // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/490173>.

4. Михайленко, М. Н. Финансовые рынки и институты: учебник для вузов / М. Н. Михайленко. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2022. — 336 с. // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/489000>.

5.2 Дополнительная литература:

1. Саввина, О.В. Регулирование финансовых рынков: Учебное пособие [Электронный ресурс] : учеб. пособие — Электрон. дан. — Москва: Дашков и К, 2012. — 204 с. — Режим доступа: <https://e.lanbook.com/book/5668>.
2. Незамайкин, В. Н. Финансовый менеджмент: учебник для бакалавров / В. Н. Незамайкин, И. Л. Юрзинова. — М.: Издательство Юрайт, 2017. — 467 с. — (Серия: Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-9916-3638-4. — Режим доступа: www.biblio-online.ru/book/4EEA768F-331A-4E5F-9999-72AC59AECE08.
3. Караев, А.К. Финансовая неустойчивость и макроэкономическая нестабильность: агентно ориентированное моделирование [Электронный ресурс] : монография / А.К. Караев, М.В. Мельничук. — Электрон. дан. — Москва: Дашков и К, 2014. — 158 с. — Режим доступа: <https://e.lanbook.com/book/70597>.
4. Международные валютно-кредитные и финансовые отношения: учебник для вузов / Л. Н. Красавина [и др.]; ответственный редактор Л. Н. Красавина. — 5-е изд., перераб. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2022. — 534 с. // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/488867>.

Для освоения дисциплины инвалидами и лицами с ограниченными возможностями здоровья имеются издания в электронном виде в электронно-библиотечных системах.

Для лиц с ограниченными возможностями электронные базы предлагают технологии масштабирования и аудиопрослушивание.

4.3 Периодические издания:

1. Национальные интересы: приоритеты и безопасность
2. Финансы и кредит
3. Вопрос экономики
4. Финансовая аналитика: проблемы и решения
5. Экономист

6. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины (модуля)

1. Официальный сайт Банка России - <http://www.cbr.ru/>
2. Официальный сайт Московской биржи - <http://www.moex.com/>
3. Официальный сайт издания The New Times - <https://newtimes.ru/>
4. Интернет-проект Информационного Агентства Финмаркет – RusBonds - <http://www.rusbonds.ru/about.asp>
5. Официальный сайт издания «Уолл Стрит Джорнал» - <https://www.wsj.com/>

7. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

Курс состоит из 8 тем. Основной теоретический материал дается студентам в виде лекций, с включением тематических презентаций.

Для закрепления теоретического материала и формирования практических навыков риск менеджмента на фондовом рынке со студентами проводятся практические занятия, включающие устные ответы, тематические дискуссии и кейс-заданий.

Целью проведения практических занятий является закрепление полученных студентами на лекциях и в процессе самостоятельного изучения теоретических знаний, моделирование практических ситуаций, а также проверка эффективности самостоятельной работы студента.

Курс рассчитан на проведение практических работ, на которых бакалавры занимаются управлением инвестиционным портфелем (работа в форме кейсов). Осуществляется сбор, обработка и анализ биржевой информации. Строятся экономико-математические модели и принимаются соответствующие управленческие решения.

Подготовку к занятию целесообразно начинать с повторения материала лекций, изучения литературы из основного и дополнительного списков. При этом следует учитывать, что лекционный курс ограничен по времени и не позволяет лектору детально рассмотреть все аспекты изучаемого вопроса. Следовательно, требуется самостоятельно расширять познания как теоретического, так и практического характера. Тем не менее, лекции дают хороший ориентир студенту для поиска дополнительных материалов.

В ходе самостоятельной подготовки студенту необходимо изучить, прежде всего, ту учебную литературу и прочие источники информации, которые рекомендованы преподавателем.

Научные и аналитические статьи, публикуемые в специализированных периодических изданиях, позволяют расширить кругозор и получить представление об актуальных проблемах, возможных путях их решения и или тенденциях в исследуемой области.

Посещение лекционных и практических занятий является необходимым, но недостаточным условием для усвоения необходимых знаний по курсу. Каждый студент должен индивидуально готовиться по темам дисциплины, читая конспекты лекций и рекомендуемую литературу, заучивая базовые определения, классификации, схемы и типологии. Самостоятельная работа позволяет студенту в спокойной обстановке обдумать, разобраться с информацией по теме, при необходимости обратиться к справочной литературе. Внимательное чтение и повторение прочитанного помогает в полном объеме усвоить содержание темы, структурировать знания.

Самостоятельная работа студента в процессе освоения дисциплины включает в себя:

- изучение основной и дополнительной литературы по курсу;
- работу с электронными учебными ресурсами;
- изучение материалов периодической печати, Интернет - ресурсов;
- подготовку к зачету;
- индивидуальные и групповые консультации.

При необходимости в процессе работы над заданием студент может получить индивидуальную консультацию у преподавателя.

В освоении дисциплины инвалидами и лицами с ограниченными возможностями здоровья большое значение имеет индивидуальная учебная работа (консультации) – дополнительное разъяснение учебного материала.

Индивидуальные консультации по предмету являются важным фактором, способствующим индивидуализации обучения и установлению воспитательного контакта между преподавателем и обучающимся инвалидом или лицом с ограниченными возможностями здоровья.

8. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю) (при необходимости)

8.1 Перечень информационных технологий

На лекциях используется мультимедийная презентация в формате Power Point по всем темам курса. Проводится проверка домашних заданий и консультирование посредством электронной почты. Осуществляется использование электронных презентаций при проведении практических занятий.

8.2 Перечень необходимого программного обеспечения

Для успешного освоения дисциплины, студент использует такие программные средства как Microsoft Windows 8, 10, Microsoft Office Professional Plus.

8.3 Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы

1. Электронный каталог научной библиотеки КубГУ - <http://megapro.kubsu.ru/MegaPro/Web>
2. Электронная научная библиотеке - Университетская библиоткеа Online - <https://biblioclub.ru/>
3. Электронная библиотечная система издательства «Лань» - <https://e.lanbook.com/>
4. Электронная библиотечная система «Юрайт» - <https://www.biblio-online.ru/>
5. Базы данных компании «Иствью» - <http://dlib.eastview.com>
6. Справочно-правовая система «Консультант Плюс» (<http://www.consultant.ru>)

9. Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)

По всем видам учебной деятельности в рамках дисциплины используются аудитории, кабинеты и лаборатории, оснащенные необходимым специализированным и лабораторным оборудованием.

Наименование специальных помещений	Оснащенность специальных помещений	Перечень лицензионного программного обеспечения
Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Мебель: учебная мебель Технические средства обучения: экран, проектор, ноутбук	Microsoft Windows 8, 10, Microsoft Office Professional Plus
Учебные аудитории для проведения занятий семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации	Мебель: учебная мебель Технические средства обучения: экран, проектор, ноутбук	Microsoft Windows 8, 10, Microsoft Office Professional Plus
Учебные аудитории для проведения лабораторных работ Лаборатория информационных и управляющих систем 201Н Лаборатория экономической информатики 202Н	Мебель: учебная мебель Технические средства обучения: экран, проектор, компьютеры, ноутбуки Оборудование: ПК, Терминальные станции, Усилитель автономный беспроводной	Microsoft Windows 8, 10, Microsoft Office Professional Plus 1С: Предприятие 8 SPSS Statistics
Лаборатория управления в технических системах 207Н	Типовой комплект учебного оборудования "Теория автоматического управления", Презентации и плакаты Усилитель автономный беспроводной с микрофоном	Microsoft Windows 8, 10, Microsoft Office Professional Plus
Лаборатория организационно-технологического обеспечения торговой и маркетинговой деятельности 201А	Панель интерактивная, Конференц-система, Микшер-усилитель, Подавитель акустической обратной связи, Настенный громкоговоритель, Радиосистема, Микрофон на гибком держателе, Моноблок НР, Документ-камера, Беспроводная точка доступа, Система видеотображения, ЖК панель, Сплитер, Мультимедийная трибуна лектор, Система видеоконференцсвязи, Плакаты	Microsoft Windows 8, 10, Microsoft Office Professional Plus 1С: Предприятие 8

Лаборатория экономики и управления 212Н	Презентации и плакаты, Многофункциональный профессиональный видео детектор банкнот и ценных бумаг, Счетчики банкнот, Инфракрасный детектор банкнот и ценных бумаг, Универсальный детектор банкнот и ценных бумаг, Детектор подлинности банкнот, Ящик денежный, Планшетный импринтер, Усилитель автономный беспроводной	Microsoft Windows 8, 10, Microsoft Office Professional Plus
Лаборатория безопасности жизнедеятельности 105А	Лабораторные стенды, Типовой комплект учебного оборудования, Стенды-тренажеры, Стенд-планшет, Тренажерный комплекс по применению первичных средств пожаротушения, Комплекс – тренажер по оказанию первой доврачебной помощи, Робот-тренажер, Комплект плакатов, Комплект демонстрационных пособий, Комплект аудиовизуальных пособий	Microsoft Windows 8, 10, Microsoft Office Professional Plus
Учебные аудитории для курсового проектирования (выполнения курсовых работ)	Мебель: учебная мебель Технические средства обучения: экран, проектор, компьютер	Microsoft Windows 8, 10, Microsoft Office Professional Plus

Для самостоятельной работы обучающихся предусмотрены помещения, укомплектованные специализированной мебелью, оснащенные компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду университета.

Наименование помещений для самостоятельной работы обучающихся	Оснащенность помещений для самостоятельной работы обучающихся	Перечень лицензионного программного обеспечения
Помещение для самостоятельной работы обучающихся (читальный зал Научной библиотеки)	Мебель: учебная мебель Комплект специализированной мебели: компьютерные столы Оборудование: компьютерная техника с подключением к информационно-коммуникационной сети «Интернет» и доступом в электронную информационно-образовательную среду образовательной организации, веб-камеры, коммуникационное оборудование, обеспечивающее доступ к сети интернет (проводное соединение и беспроводное соединение по технологии Wi-Fi)	Microsoft Windows 8, 10, Microsoft Office Professional Plus
Помещение для самостоятельной работы	Мебель: учебная мебель Комплект специализированной мебели:	Microsoft Windows 8, 10, Microsoft Office

<p>обучающихся (ауд.213 А, 218 А)</p>	<p>компьютерные столы Оборудование: компьютерная техника с подключением к информационно-коммуникационной сети «Интернет» и доступом в электронную информационно-образовательную среду образовательной организации, веб-камеры, коммуникационное оборудование, обеспечивающее доступ к сети интернет (проводное соединение и беспроводное соединение по технологии Wi-Fi)</p>	<p>Professional Plus</p>
---	--	--------------------------