

**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ  
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
СТАВРОПОЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АГРАРНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ**

**УТВЕРЖДАЮ**

Директор/Декан  
института экономики, финансов и  
управления в АПК  
Гулько Юлия Александровна

«\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ (ОЦЕНОЧНЫХ МАТЕРИАЛОВ)**

**Б1.В.ДВ.01.02 Деятельность банка на фондовом рынке**

**38.04.08 Финансы и кредит**

**Корпоративный и банковский менеджмент**

магистр

очная

# 1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций ОП ВО и овладение следующими результатами обучения по дисциплине:

| Код и наименование компетенции                                                                                                                                             | Код и наименование индикатора достижения                                                                                                                                                                                                      | Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| ПК-3 Способен систематизировать бизнес-процессы, формировать методологию финансового планирования и прогнозирования, моделировать денежные потоки субъектов хозяйствования | ПК-3.2 Формирует методологию финансового планирования и прогнозирования и на этой основе моделирует финансовую стратегию развития бизнеса                                                                                                     | <b>знает</b><br>- методики оценки деятельности в соответствии с разработанными показателями (08.037 F/01.7 Зн.1)<br>- сбора, анализа, систематизации, хранения и поддержания в актуальном состоянии информации бизнес-анализа (08.037 F/01.7 Зн.2)<br>- предметной области и специфики деятельности организации в объеме, достаточном для решения задач бизнес-анализа (08.037 F/01.7 Зн.3)                                                                           |
|                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                               | <b>умеет</b><br>- проводить анализ деятельности организации (08.037 F/01.7 У.11)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                               | <b>владеет навыками</b><br>- оценка текущего состояния организации (08.037 F/01.7 ТД.1)<br>- оценка бизнес-возможностей организации, необходимых для проведения стратегических изменений в организации (08.037 F/01.7 ТД.4)<br>- определение цели и задач стратегических изменений в организации (08.037 F/02.7 ТД.1)                                                                                                                                                 |
| ПК-4 Способен применять методы и механизмы построения системы управления казначейством банка с риском ликвидности, процентным и валютным рисками                           | ПК-4.2 Демонстрирует умение применять казначейством банка с его подразделениями механизмы построения системы управления рисками, а также формирования стратегии и политики в области управления рисками (ликвидности, процентного и валютного | <b>знает</b><br>Знания:<br>- текущей ситуации на денежном и фондовом рынках (08.007 D/01.7 Зн.3)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                               | <b>умеет</b><br>- составлять и разрабатывать формы управленческой отчетности (08.007 D/03.7 У.2)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                               | <b>владеет навыками</b><br>- определение казначейством банка потребности в привлечении (размещении) средств на короткий и средний сроки (08.007 D/01.7 ТД.11)<br>- разработка документов, определяющих срок и полноту информации, предоставляемой в казначейство подразделениями банка (08.007 D/01.7 ТД.4)<br>- сбор казначейством банка ежедневной информации о поступлениях и платежах и занесение ее в автоматизированную банковскую систему (08.007 D/01.7 ТД.5) |

## 2. Перечень оценочных средств по дисциплине

| №     | Наименование раздела/темы                                                         | Семестр | Код индикаторов достижения компетенций | Оценочное средство проверки результатов достижения индикаторов компетенций |
|-------|-----------------------------------------------------------------------------------|---------|----------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------|
| 1.    | 1 раздел. Содержание дисциплины                                                   |         |                                        |                                                                            |
| 1.1.  | Особенности функционирования фондового рынка                                      | 3       | ПК-3.2, ПК-4.2                         | Собеседование                                                              |
| 1.2.  | Государственное и право-вое регулирование фондо-вого рынка в Российской Федерации | 3       | ПК-3.2                                 | Реферат                                                                    |
| 1.3.  | Операции банка с ценными бумагами                                                 | 3       | ПК-3.2, ПК-4.2                         | Устный опрос                                                               |
| 1.4.  | Контрольная точка 1                                                               | 3       | ПК-3.2, ПК-4.2                         | Контрольная работа                                                         |
| 1.5.  | Виды операций коммерческих банков на фондовом рынке                               | 3       | ПК-3.2, ПК-4.2                         | Контрольная работа                                                         |
| 1.6.  | Деятельность банков на фондовом рынке как эмитентов                               | 3       | ПК-3.2, ПК-4.2                         | Доклад                                                                     |
| 1.7.  | Деятельность банков на фондовом рынке как инвесторов                              | 3       | ПК-3.2, ПК-4.2                         | Рабочая тетрадь                                                            |
| 1.8.  | Контрольная точка 2                                                               | 3       | ПК-3.2, ПК-4.2                         | Контрольная работа                                                         |
| 1.9.  | Профессиональная дея-тельность банков на фон-довом рынке                          | 3       | ПК-3.2, ПК-4.2                         | Тест                                                                       |
| 1.10. | Формирование политики коммерческого банка на фондовом рынке                       | 3       | ПК-3.2, ПК-4.2                         | Устный опрос                                                               |
| 1.11. | Контрольная точка 3                                                               | 3       |                                        | Тест                                                                       |
|       | Промежуточная аттестация                                                          |         |                                        | За                                                                         |

## 3. Оценочные средства (оценочные материалы)

Примерный перечень оценочных средств для текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации

| № п/п            | Наименование оценочного средства | Краткая характеристика оценочного средства | Представление оценочного средства в фонде (Оценочные материалы) |
|------------------|----------------------------------|--------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|
| Текущий контроль |                                  |                                            |                                                                 |
|                  | Для оценки знаний                |                                            |                                                                 |

|                   |                    |                                                                                                                                                                                                                                                                              |                                           |
|-------------------|--------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------|
| 1                 | Собеседование      | Средство контроля, организованное как специальная беседа преподавателя с обучающимся на темы, связанные с изучаемой дисциплиной, и рассчитанное на выяснение объема знаний обучающегося по определенному разделу, теме, проблеме и т.п.                                      | Вопросы по темам/разделам дисциплины      |
| 2                 | Устный опрос       | Средство контроля знаний студентов, способствующее установлению непосредственного контакта между преподавателем и студентом, в процессе которого преподаватель получает широкие возможности для изучения индивидуальных особенностей усвоения студентами учебного материала. | Перечень вопросов для устного опроса      |
| 3                 | Тест               | Система стандартизированных заданий, позволяющая автоматизировать процедуру измерения уровня знаний и умений обучающегося.                                                                                                                                                   | Фонд тестовых заданий                     |
| Для оценки умений |                    |                                                                                                                                                                                                                                                                              |                                           |
| 4                 | Контрольная работа | Средство проверки умений применять полученные знания для решения задач определенного типа по теме или разделу                                                                                                                                                                | Комплект контрольных заданий по вариантам |
| 5                 | Рабочая тетрадь    | Дидактический комплекс, предназначенный для самостоятельной работы обучающегося и позволяющий оценивать уровень усвоения им учебного материала.                                                                                                                              | Образец рабочей тетради                   |

|                          |                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                            |
|--------------------------|-------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|
| 6                        | Реферат           | Реферат – Продукт самостоятельной работы студента, представляющий собой краткое изложение в письменном виде полученных результатов теоретического анализа определенной научной (учебно-исследовательской) темы, где автор раскрывает суть исследуемой проблемы, приводит различные точки зрения, а также собственные взгляды на нее. | Темы рефератов             |
| 7                        | Доклад, сообщение | Продукт самостоятельной работы студента, представляющий собой публичное выступление по представлению полученных результатов решения определенной учебно-практической, учебно-исследовательской или научной темы                                                                                                                      | Темы докладов, сообщений   |
| Для оценки навыков       |                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                            |
| Промежуточная аттестация |                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                            |
| 8                        | Зачет             | Средство контроля усвоения учебного материала практических и семинарских занятий, успешного прохождения практик и выполнения в процессе этих практик всех учебных поручений в соответствии с утвержденной программой с выставлением оценки в виде «зачтено», «незачтено».                                                            | Перечень вопросов к зачету |

**4. Примерный фонд оценочных средств для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине (модулю) "Деятельность банка на фондовом рынке"**

***Примерные оценочные материалы для текущего контроля успеваемости***

**Контрольная точка 1**

1. Что является основной целью деятельности банка на фондовом рынке?
  - а) Увеличение клиентской базы
  - б) Управление рисками
  - с) Максимизация прибыли
  - д) Содействие развитию экономики
2. Какие ценные бумаги чаще всего приобретаются банками для управления ликвидностью?
  - а) Акции

- b) Облигации
- c) Деривативы
- d) Фонды прямых инвестиций

3. Что такое доходность к погашению (YTM)?

- a) Текущая доходность облигации
- b) Доходность облигации, учитывающая все будущие купонные платежи и погашение номинала

- c) Доходность облигации, учитывающая только купонные платежи
- d) Доходность облигации за определённый период

4. Что такое бета-коэффициент в контексте фондового рынка?

- a) Мера риска отдельной акции
- b) Мера доходности акции
- c) Мера чувствительности доходности акции к изменениям рынка
- d) Мера ликвидности акции

5. Что такое диверсификация инвестиционного портфеля?

- a) Вложение всех средств в одну компанию
- b) Вложение средств в различные активы для снижения риска
- c) Вложение средств только в высокодоходные активы
- d) Вложение средств только в низкорисковые активы

6. Какой тип риска связан с возможностью невозврата займа?

- a) Рыночный риск
- b) Кредитный риск
- c) Валютный риск
- d) Операционный риск

7. Что такое хеджирование?

- a) Увеличение риска
- b) Стратегия снижения риска
- c) Вложение средств в высокорисковые активы
- d) Вложение средств в низколиквидные активы

8. Что такое финансовый леверидж?

- a) Использование заемных средств для увеличения доходности
- b) Диверсификация инвестиционного портфеля
- c) Хеджирование валютных рисков
- d) Управление ликвидностью

9. Какой метод оценки компании использует прогноз будущих денежных потоков?

- a) Метод сравнительной оценки
- b) Метод дисконтированных денежных потоков (DCF)
- c) Метод чистых активов
- d) Метод рыночной капитализации

10. Что такое арбитраж?

- a) Спекулятивная торговля
- b) Извлечение прибыли из разницы цен на один и тот же актив на разных рынках
- c) Хеджирование валютных рисков
- d) Управление ликвидностью

Контрольная точка 1

1. Что такое опцион?

- a) Долговое обязательство
- b) Договор, дающий право, но не обязывающий, купить или продать актив по определенной цене в определенный срок

- c) Договор купли-продажи актива
- d) Договор займа

2. Что такое фьючерсный контракт?

- a) Договор купли-продажи актива в будущем по цене, установленной сегодня
- b) Договор на покупку акции

- с) Договор на продажу акции
- д) Договор займа
- 3. Что такое дериватив?
  - а) Базовый актив
  - б) Финансовый инструмент, чья стоимость зависит от стоимости другого актива
  - с) Финансовый инструмент, не зависящий от стоимости другого актива
  - д) Финансовый инструмент, используемый для управления ликвидностью
- 4. Какой риск связан с изменением валютных курсов?
  - а) Кредитный риск
  - б) Валютный риск
  - с) Рыночный риск
  - д) Операционный риск
- 5. Что такое репо-сделка?
  - а) Долгосрочный кредит
  - б) Краткосрочный кредит под залог ценных бумаг
  - с) Покупка акций
  - д) Продажа акций
- 6. Что такое IPO (Initial Public Offering)?
  - а) Первичное размещение акций
  - б) Вторичное размещение акций
  - с) Выкуп акций
  - д) Объявление о банкротстве
- 7. Что такое маржинальная торговля?
  - а) Торговля без использования заемных средств
  - б) Торговля с использованием заемных средств
  - с) Торговля только акциями
  - д) Торговля только облигациями
- 8. Что такое портфельный риск?
  - а) Риск, связанный с конкретной компанией
  - б) Риск, связанный с рынком в целом
  - с) Риск, связанный с инвестиционным портфелем в целом
  - д) Риск, связанный с ликвидностью
- 9. Какой показатель используется для измерения волатильности актива?
  - а) Бета-коэффициент
  - б) Стандартное отклонение
  - с) Доходность к погашению
  - д) Коэффициент Шарпа
- 10. Что такое бенчмарк в контексте инвестирования?
  - а) Инвестиционный портфель
  - б) Эталонный индекс или портфель, используемый для сравнения доходности
  - с) Стратегия инвестирования
  - д) Риск-менеджмент

#### Вопросы для собеседования

1. Финансовый рынок и его структура, место финансового рынка в общей экономической структуре государства.
2. Общая характеристика и виды операций, совершаемых на денежном рынке.
3. Общая характеристика и виды операций, совершаемых на рынке капиталов.
4. Понятие и структура рынка ценных бумаг, его роль и значение в общей структуре рынка.
5. Функции рынка ценных бумаг (общерыночные и специфические).
6. Составные части рынка ценных бумаг по способу торговли, их краткая характеристика.
7. Государство как эмитент ценных бумаг, виды государственных обязательств.

#### Тестовые задания

1. Функции финансового рынка.
  - а) равновесие спроса и предложения финансовых активов, внедрение механизма выкупа фи-

нансовых активов, уменьшение расходов по проведению операций.

б) контрольная, распределительная, равновесие спроса и предложения, внедрение механизма выкупа финансовых активов.

в) регулирующая, контрольная, распределительная, равновесие спроса и предложения.

г) внедрение механизма выкупа финансовых активов, уменьшение расходов по проведению операций.

2. Структура финансового рынка.

а) государство, финансовые институты, институты инфраструктуры.

б) государство, институты нефинансовой сферы, население, иностранные участники рынка.

в) НБУ, финансовые институты, институты инфраструктуры, институты нефинансовой сферы, иностранные участники рынка.

г) государство, финансовые институты, институты инфраструктуры, институты нефинансовой сферы, население, иностранные участники рынка.

3 Представители финансовых институтов.

а) биржи, предприятия, населения, коммерческие банки, пенсионные фонды, страховые и инвестиционные компании.

б) коммерческие банки, кредитные союзы, инвестиционные банковские фирмы, пенсионные фонды, страховые и инвестиционные компании.

в) коммерческие банки, кредитные союзы, пенсионные фонды, страховые и инвестиционные компании, население.

г) коммерческие банки, кредитные союзы, инвестиционные банковские фирмы, пенсионные фонды, страховые и инвестиционные компании, предприятия, населения.

4. Источники финансовых ресурсов, депозитных и недепозитных институтов.

а) депозиты, страховые взносы, акции, инвестиционные сертификаты, взносы участников.

б) кредиты, депозиты, акции, взносы участников, страховые взносы, инвестиционные сертификаты.

в) ценные бумаги, кредиты, депозиты, взносы участников, страховые взносы.

г) ценные бумаги, кредиты, депозиты, взносы.

5. Структура финансового рынка.

а) денежный рынок, кредитный рынок, фондовый рынок.

б) рынок капиталов, денежный рынок, фондовый рынок.

в) кредитный рынок, фондовый рынок, валютный рынок.

г) национальный рынок, международный рынок.

6. Основные категории финансовых инструментов.

а) основные финансовые инструменты, производные финансовые документы.

б) акции, облигации, сберегательные сертификаты, векселя.

в) основные финансовые документы, инструменты собственности, инструменты займа.

г) инструменты собственности, инструменты займа.

7. Особенности финансовых активов.

а) срок оборота, ликвидность, доходность, рисковость, делимость, конвертируемость, возвратность.

б) кредитоспособность, ликвидность, доходность, рисковость, конвертируемость, возвратность.

в) реальная доходность, ликвидность, рисковость, конвертируемость, возвратность, срок оборота.

г) действительная стоимость, ликвидность, доходность, рисковость, конвертируемость, возвратность.

8. Ценные бумаги первого рода.

а) акции, облигации, казначейские обязательства, сберегательные сертификаты, инвестиционные сертификаты, векселя.

б) именные, на предъявителя.

в) фьючерсы, форварды, опционы, свопы.

г) акции, облигации, векселя.

9. Банковские операции с векселями.

а) индоссамент, аваль векселя, акцепт векселя.

б) выпуск векселей, учет векселей, участие в опротестовании векселей.

в) учет векселей, кредит под залог векселей акцепт векселя, аваль векселя, инкосация, домицияция, участие в опротестовании векселей.

г) выпуск коммерческих, финансовых, фиктивных векселей.

10. Особенности использования и обращения приватизационных бумаг.

а) используется для расчетов, свободно обращаются, предусматривают выплату дивидендов.

б) посредническая, представительская, коммерческая деятельность.

в) не подлежат свободному обращению, предусматривают выплату дивидендов, используется для расчетов.

г) не подлежат свободному обращению, дивиденды и проценты не выплачиваются, не могут использоваться для расчетов, используются в целях предусмотренных законодательством.

11. В зависимости от уровня и характера обеспечения облигации предприятий делятся на:

а) обеспеченные, не обеспеченные, конвертируемые, обмениваемые.

б) обеспеченные, не обеспеченные, целевые, с дисконтом, государственные.

в) залоговые, ипотечные, под оборудование, с добавочным обеспечением, гарантированные, совместные, не обеспеченные.

г) муниципальные облигации, республиканские займы, ОГВЗ, ОВГЗ.

12. Цели эмитирования государственных облигаций, казначейских обязательств, казначейских векселей и других государственных долговых обязательств.

а) финансирование бюджетного дефицита, финансирование целевых программ, эмиссия денег, размещение в инвестиционные проекты.

б) финансирование бюджетного дефицита, погашение размещенных ранее займов, финансирование целевых программ, размещение в инвестиционные проекты.

в) финансирование бюджетного дефицита, добавочные поступления в бюджет, эмиссия денег, обеспечение кассового исполнения государственного бюджета.

г) финансирование бюджетного дефицита, погашение размещенных ранее займов, финансирование целевых программ, сглаживание неравномерностей поступления налоговых платежей, обеспечение кассового исполнения государственного бюджета.

13. Виды привилегированных акций.

а) доходные, конвертируемые, кумулятивные, со ставкой дивидендов, отзывные, рекреативные.

б) конвертируемые, кумулятивные, с долей участия, со ставкой дивидендов, отзывные, ретрекативные.

в) роста, доходные, конвертируемые, кумулятивные, с долей участия, отзывные, рекреативные.

г) спекулятивные, роста, конвертируемые, с долей участия, со ставкой дивидендов.

**Примерные оценочные материалы  
для проведения промежуточной аттестации (зачет, экзамен)  
по итогам освоения дисциплины (модуля)**

Вопросы к зачету

1. Финансовый рынок и его структура, место финансового рынка в общей экономической структуре государства.

2. Общая характеристика и виды операций, совершаемых на денежном рынке.

3. Общая характеристика и виды операций, совершаемых на рынке капиталов.

4. Понятие и структура рынка ценных бумаг, его роль и значение в общей структуре рынка.

5. Функции рынка ценных бумаг (общерыночные и специфические).

6. Составные части рынка ценных бумаг по способу торговли, их краткая характеристика.

7. Государство как эмитент ценных бумаг, виды государственных обязательств.

8. Хозяйствующие субъекты как эмитенты ценных бумаг, их организационно-правовая форма.

9. Инвестиционные компании, их роль и значение на рынке ценных бумаг.

10. Инвестиционные фонды, их назначение и особенности функционирования на фондовом рынке.

11. Основные функции коммерческих банков на рынке ценных бумаг.

12. Порядок выпуска ценных бумаг торговыми и промышленными компаниями при первом варианте акционирования.

13. Сущность второго варианта акционирования предприятий, преобразованных в акционерные общества.
14. Особенности третьего варианта акционирования промышленных и торговых компаний.
15. Инвестиционная привлекательность эмитентов. Классификация ценных бумаг, принятая на западных фондовых рынках.
16. Регулирующая роль Федеральной комиссии по финансовым рынкам, ее роль и значение в современных российских условиях.
17. Инвесторы, их общая характеристика и классификация в зависимости от цели инвестирования (стратегические и портфельные инвесторы).
18. Права инвесторов, в зависимости от вклада в уставный капитал.
19. Индивидуальные инвесторы, их права и обязанности по приобретению ценных бумаг.
20. Институциональные инвесторы и их роль на рынке ценных бумаг.
21. Общая характеристика профессионалов фондового рынка.
22. Брокерская деятельность на рынке ценных бумаг.
23. Дилерская деятельность на рынке ценных бумаг.
24. Деятельность по управлению ценными бумагами. Экономический смысл функционирования управляющих компаний и управляющего.
25. Клиринговая деятельность на рынке ценных бумаг.
26. Депозитарная деятельность на рынке ценных бумаг.
27. Система ведения реестра владельцев ценных бумаг.
28. Организация торговли ценными бумагами на российской фондовой бирже.
29. Регулирование рынка ценных бумаг и его виды. Принципы регулирования.
30. Прямое государственное регулирование российского рынка ценных бумаг.

#### Типовые задания к зачету

1. Оценка инвестиционной привлекательности облигаций: Банк рассматривает возможность инвестирования в облигации компании X. У вас есть информация о купонной ставке, сроке погашения, рейтинге эмитента и текущей рыночной цене. Проведите оценку доходности к погашению (YTM) и сравните её с доходностью аналогичных облигаций. Дайте рекомендации по инвестированию, обосновав их.
2. Управление портфелем ценных бумаг: Банк владеет портфелем акций, состоящим из акций компаний A, B и C. У вас есть данные о текущей рыночной цене акций, их исторической волатильности и корреляции между ними. Разработайте стратегию управления рисками портфеля, используя методы диверсификации и хеджирования.
3. Анализ финансового состояния эмитента: Перед инвестированием в акции компании Y, проведите анализ её финансового состояния, используя данные финансовой отчетности (отчет о прибылях и убытках, баланс, отчет о движении денежных средств). Оцените ключевые финансовые показатели (рентабельность, ликвидность, финансовая устойчивость) и дайте заключение о финансовом здоровье компании.
4. Оценка стоимости компании методом дисконтированных денежных потоков (DCF): Оцените стоимость компании Z методом DCF, используя прогноз её свободного денежного потока (FCF) на ближайшие 5 лет и ставку дисконтирования. Учтите риски и неопределенность прогноза.
5. Выявление арбитражных возможностей: На рынке наблюдается разница в цене акций компании W на разных биржах. Определите, существует ли арбитражная возможность и как банк может на ней заработать. Рассмотрите возможные риски.
6. Разработка стратегии хеджирования валютных рисков: Банк планирует инвестировать в акции иностранной компании. Разработайте стратегию хеджирования валютных рисков, используя валютные фьючерсы или опционы. Оцените затраты на хеджирование.
7. Анализ влияния макроэкономических факторов: Проанализируйте влияние изменения ключевой ставки центрального банка на цены облигаций и акций. Как банк может использовать эту информацию для принятия инвестиционных решений?
8. Оценка риска дефолта эмитента: Используя доступные данные (финансовая отчетность, кредитный рейтинг), оцените вероятность дефолта компании по облигациям. Как эта оценка влияет на инвестиционное решение банка?
9. Выбор стратегии инвестирования: Разработайте долгосрочную стратегию инвестирования банка на фондовом рынке, учитывая его риск-профиль, инвестиционные цели и горизонт

инвестирования. Обоснуйте свой выбор.

10. Оценка эффективности инвестиционной стратегии: Проанализируйте результаты инвестиционной деятельности банка за прошлый год. Оцените эффективность различных инвестиционных стратегий, используя соответствующие показатели (например, альфа, бета, Шарпа). Сделайте выводы и предложите корректировки стратегии.

**Темы письменных работ (эссе, рефераты, курсовые работы и др.)**

Темы рефератов

Финансовые риски эмитентов, связанные с выпуском и обращением ценных бумаг

Финансовые риски финансовых посредников – профессиональных участников рынка ценных бумаг

Права, удостоверяемые ценными бумагами, и права на ценные бумаги

Приватизационные ценные бумаги Российской Федерации и стран СНГ

Определения ценных бумаг в законодательстве и экономических теориях разных стран

Суррогаты ценных бумаг, их экономическая сущность и формы проявления в российской эмиссионной практике

Финансовые риски частных и институциональных инвесторов, связанные с ценными бумагами

Фиктивный капитал: теория и практика

Теория финансового рынка в трудах российских и зарубежных экономистов

Объективные основы и направления глобализации рынка ценных бумаг

Виды технологий торговли ценными бумагами и их использование на российском фондовом рынке

Оценка капитализации российского рынка ценных бумаг и перспективы ее роста

Виды манипулирования на российском фондовом рынке и методы их предотвращения

Перспективы участия российского фондового рынка в финансировании производства

Защита прав инвесторов на развитых и развивающихся рынках ценных бумаг

Роль рынка ценных бумаг в накоплении капитала и перераспределении финансовых ресурсов в различных странах

Структура, инструменты, участники, инфраструктура и механизм эмиссии евробумаг

Виды акций, выпускаемых в Российской Федерации

Разновидности производных ценных бумаг, связанных с акциями, в мировой и российской практике

Условия выпуска и обращения депозитарных расписок

Показатели доходности инвестиций в акции: дивиденд, рост курсовой стоимости, совокупная доходность

Анализ российского рынка акций

Акционерное общество и проблемы управления акционерным капиталом

Российский рынок облигаций частных эмитентов

Составные компоненты рынка ценных бумаг и их количественные параметры: рынок акций, рынок облигаций, рынок производных финансовых инструментов

Принципы оценки ценных бумаг. Оценка облигаций

Расчет показателей доходности к погашению, текущей доходности, купонной доходности облигаций.

Государственное регулирование на рынке долговых обязательств

Технология регистрации и размещения еврооблигаций частных эмитентов

Конвертируемые облигации

Качественная и количественная характеристика состояния рынка ценных бумаг в РФ

Ключевые проблемы развития рынка ценных бумаг в РФ

Влияние традиционных ценностей населения на рынок ценных бумаг. Примеры из мировой и российской практики

Модели рыночной экономики и структура собственности. Структура собственности в России: количественная и качественная характеристика

Системный риск: характеристика, факторы снижения

Теория эффективного рынка ценных бумаг

Меры по защите прав инвесторов на развитых рынках ценных бумаг

Коммерциализация организаторов торговли на рынке ценных бумаг: тенденции и формы проявления

Новые биржевые технологии: мировой и российский опыт. Альтернативные торговые системы

Количественная и качественная характеристика корпоративных эмитентов в России

Количественная и качественная характеристика инвесторов: российская и мировая практика

Рынки ценных бумаг стран СНГ

Финансовая глобализация: определение, формы проявления, тенденции

Секьюритизация долгов: мировая и российская практика

Дезинтермедиация: понятие, формы проявления, тенденции

Подходы к понятию "финансовый рынок" и "ценная бумага" в зарубежной и российской научной литературе

Соотношение рынка ценных бумаг, кредитного рынка и бюджета в перераспределении

денежных ресурсов

Региональные рынки ценных бумаг: определение, характеристика, тенденции развития

Рынок евробумаг: история, участники, инструменты, система регулирования. Современное состояние рынка евробумаг: количественная и качественная характеристика

Еврооблигации российских эмитентов: цели, параметры, выпусков, кредитная история

Биржевые аукционы

Интернет-услуги на рынке ценных бумаг: международный и российский опыт. Состояние, тенденции, проблемы развития

Привилегированные акции, их разновидности. Примеры использования в международной и российской практике

Разновидности обыкновенных акций в международной практике

Конвертируемые акции: практика использования в России и за рубежом

Производные инструменты, связанные с акциями (подписные права и варранты) и примеры их использования

Понятие "депозитарных расписок". История формирования рынка ADR и GDR

Рынок ADR и GDR российских эмитентов; история, количественная и качественная характеристика, тенденции и проблемы развития

Количественная и качественная характеристика российского рынка акций. Проблемы и тенденции развития

Биржевой рынок акций в России

Внебиржевой рынок акций в России

Рынок корпоративных облигаций в России: история, количественная и качественная характеристика современного состояния, проблемы и тенденции развития

Облигации, обеспеченные залогом имущества. Примеры выпуска в мировой и российской практике

Облигации, не обеспеченные залогом имущества. Примеры выпуска в мировой и российской практике

Рынок "мусорных" облигаций: история, современное состояние

Конвертируемые облигации: стратегии и примеры использования в мировой и российской практике

История, количественные параметры и качественная характеристика государственного долга РФ

История, количественная и качественная характеристика рынка государственных ценных бумаг в России. Инфраструктура, профессиональные участники, инвесторы

Государственные ценные бумаги субъектов РФ: история, количественная и качественная характеристика рынка

Рынок муниципальных ценных бумаг в России: история, количественная и качественная характеристика

Цели выпуска государственных и муниципальных ценных бумаг: международная и российская практика

Характеристика векселя в системе англо-американского вексельного права

Коммерческие бумаги, их использование в международной и российской практике

История, состояние, проблемы и тенденции развития вексельного рынка в России

История, состояние, проблемы и тенденции развития рынка депозитных и сберегательных сертификатов в мировой и российской практике

Банковская сберегательная книжка на предъявителя - ценная бумага?

Чеки: история возникновения, современная практика использования. Условия расчета чеками в России

Коносамент: условия использования в мировой и российской практике

Складские свидетельства, возможности и перспективы применения в народнохозяйственном обороте

Закладная. Ипотечные ценные бумаги в мировой и российской практике

Количественная и качественная характеристика профессиональных участников рынка ценных бумаг в России: брокерско-дилерские компании. Сравнительная характеристика с мировой практикой

Управляющие ценными бумагами в России: количественная и качественная характеристика

Крупнейшие депозитарно-клиринговые системы в мире. Клиринговые организации в России

Депозитарная инфраструктура рынка ценных бумаг: международный и российский опыт

Сеть регистраторов ценных бумаг в России: количественная и качественная характеристика. Проблемы нарушения прав акционеров, связанные с ведением реестра акционеров

Международная федерация фондовых бирж: история создания. Круг участников (членов), порядок регулирования деятельности

Инвестиционное консультирование: международный опыт и российская практика

Банковская модель рынка ценных бумаг: плюсы и минусы. Проблемы и тенденции развития

Небанковская модель рынка ценных бумаг: плюсы и минусы. Проблемы и тенденции развития

Смешанная модель рынка ценных бумаг: плюсы и минусы. Проблемы и тенденции развития

Система аттестации персонала профессиональных участников рынка ценных бумаг: мировая и российская практика

Биржевой рынок ценных бумаг: количественная и качественная характеристика (мировая и российская практика)

Наиболее значимые биржевые площадки России

Виды членства и требования, предъявляемые к членам фондовой биржи: мировая и российская практика

ММВБ: история, современное состояние и перспективы развития

РТС: история, современное состояние и перспективы развития

Нью-йоркская фондовая биржа: история, современное состояние и перспективы развития

Лондонская фондовая биржа: история, современное состояние и перспективы развития

Фондовая биржа в Токио: история, современное состояние и перспективы развития

Характеристика биржевого рынка Китая

Фондовые биржи стран Восточной Европы

Тенденция к объединению крупнейших фондовых бирж. Новые биржи

Процедура листинга. Требования к ценным бумагам на российских биржах

Порядок осуществления надзорной функции фондовой биржи по отношению к ее членам: мировая и российская практика

Система торговли, основанная на специалистах и маркет-мейкерах: сравнительная характеристика. Примеры из мировой и российской практики

Дилерские рынки

Виды сделок, совершаемых через фондовую биржу. Проблемы и тенденции развития биржевого рынка ценных бумаг в России

Характеристика организованного внебиржевого рынка ценных бумаг: Мировой и российский опыт

Организованный внебиржевой и биржевой рынок ценных бумаг: сравнительная характеристика (набор услуг, требования к ценным бумагам, к участникам, функции надзора, организация торговли, виды сделок)

История биржевых кризисов в мире и в России (дореволюционной и современной)

Электронные сети коммуникаций и альтернативные торговые системы прямого доступа на организованные рынки ценных бумаг: международная и российская практика

Проблемы и тенденции развития внебиржевого рынка ценных бумаг в мире и в России

Классификация акционеров и их экономических интересов

Конфликты интересов в управлении акционерным обществом

Концепция защиты прав акционеров. Виды нарушений и защита прав акционеров в

международной и российской практике. Совершенствование корпоративного управления как средство защиты прав акционеров