

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Силин Яков Петрович
Должность: Ректор
Дата подписания: 08.06.2026 13:04:05
Уникальный программный идентификатор:
24f866be2aca164840368c1b3509a9531e605f

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФГБОУ ВО «Уральский государственный экономический университет»

Одобрена
24.11.2025 г.
протокол № 5
Зав. кафедрой Юзвович Л.И.

Утверждена
Советом по учебно-методическим
вопросам и качеству образования

16 декабря 2025 г.
протокол № 4
Председатель Карх Д.А.



РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Наименование дисциплины	Финансовые инструменты цифровизации
Направление подготовки	38.04.08 Финансы и кредит
Профиль	Финансовые рынки и инвестиции
Форма обучения	очно-заочная
Год набора	2026

Разработана:
Доцент, к.э.н.
Татьянников В.А.

Екатеринбург
2025 г.

СОДЕРЖАНИЕ

ВВЕДЕНИЕ	3
1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ	3
2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП	3
3. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ	3
4. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ОПОП	3
5. ТЕМАТИЧЕСКИЙ ПЛАН	5
6. ФОРМЫ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ШКАЛЫ ОЦЕНИВАНИЯ	6
7. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ	8
8. ОСОБЕННОСТИ ОРГАНИЗАЦИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ ДЛЯ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ	11
9. ПЕРЕЧЕНЬ ОСНОВНОЙ И ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ УЧЕБНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ	11
10. ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ЛИЦЕНЗИОННОГО ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ИНФОРМАЦИОННЫХ СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ, ОНЛАЙН КУРСОВ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ	11
11. ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ	12

ВВЕДЕНИЕ

Рабочая программа дисциплины является частью основной профессиональной образовательной программы высшего образования - программы магистратуры, разработанной в соответствии с ФГОС ВО

ФГОС ВО	Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - магистратура по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (приказ Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 991)
---------	--

1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Формирование компетенций, направленных на получение системы знаний о современных базовых и производных финансовых инструментах, их роли в цифровизации экономики.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП

Дисциплина относится к части, формируемой участниками образовательных отношений.

3. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ

Промежуточная аттестация	Часов					З.е.
	Всего за семестр	Контактная работа (по уч.зан.)			Самостоятельная работа в том числе подготовка контрольных и курсовых	
		Всего	Лекции	Практические занятия, включая курсовое проектирование		
Семестр 3						
Зачет с оценкой	144	16	4	12	128	4

4. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ОПОП

В результате освоения ОПОП у выпускника должны быть сформированы компетенции, установленные в соответствии ФГОС ВО.

Шифр и наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенций
аналитический	

<p>ПК-3 Разработка финансового плана для клиента и целевого инвестиционного портфеля</p>	<p>ИД-1.ПК-3 Знать: Принципы формирования стоимости денег во времени; Принципы дисконтирования денежного потока; Принципы начисления сложных процентов; Принципы расчета приведенной и будущей стоимости; Принципы расчета доходности активов; Методы дисконтирования денежных потоков, методы многовариантности расчетов, методы математического моделирования и количественной оптимизации; Отечественные и международные стандарты в области финансового планирования; Методику финансового анализа состояния клиента; Принципы портфельного управления инвестированием; Принципы подбора и распределения активов; Принципы соотношения риска и доходности; Понятия безрискового актива; Способы управления финансовыми рисками; Методы количественного и качественного анализа, финансовых показателей; Порядок и принципы составления финансовых планов; Методики и инструментарий финансового планирования; Методики инвестиционного профилирования клиентов (риск-профилирование).</p>
	<p>ИД-2.ПК-3 Уметь: Проводить структурированное интервью и анкетирование клиента на предмет инвестиционного профиля; Получать, интерпретировать и документировать результаты исследований; Использовать расчетные таблицы и калькуляторы; Оценивать затраты на проведение финансовых операций; Рассчитывать величину портфеля, достаточную для покрытия финансовых целей; Выявлять соответствие/несоответствие инвестиционного профиля клиента параметрам инвестиционного портфеля; Рассчитывать размер инвестиций, необходимый для достижения целей клиента; Рассчитывать целевую доходность в зависимости от финансовых целей и начального капитала; Определять порядок проведения финансовых операций в зависимости от вида финансовых продуктов.</p>

<p>ПК-3 Разработка финансового плана для клиента и целевого инвестиционного портфеля</p>	<p>ИД-3.ПК-3 Иметь практический опыт: Составление перечня рекомендаций по управлению инвестиционным риском; Составление инвестиционного портфеля; Выявление качественных и количественных свойств рисков в предполагаемых к использованию финансовых продуктах; Привлечение к решению задач финансового планирования независимых внешних консультантов и экспертов в области финансовых рынков; Согласование условий инвестиционного портфеля с клиентом; Регулярный пересмотр качества инвестиционного портфеля клиента (селекция и аллокация активов); Проведение расчетов величины портфеля, достаточной для покрытия финансовых целей; Расчет размера инвестиций, необходимого для достижения целей клиента; Расчет целевой доходности в зависимости от финансовых целей и начального капитала; Анализ финансового положения клиента; Выявление несоответствий текущего финансового состояния клиента его финансовым целям; Подбор классов активов и финансовых продуктов в соответствии с потребностями клиента; Проведение стресс-тестов и сценарного анализа; Моделирование целевого портфеля клиента; Расчет параметров целевого инвестиционного портфеля; Формирование финансового плана и критериев мониторинга его выполнения; Определение и согласование правил информирования клиента; Установление критериев оценки показателей инвестиционного портфеля; Пересмотр (ребалансировка) состава активов клиентского портфеля; Мониторинг финансового плана, определение критериев эффективности финансового плана и качества инвестиционного портфеля клиента; Анализ изменения стоимости капитала инвестиционного портфеля; Составление прогноза денежного потока; Оптимизация финансового плана; Анализ использования заемных средств (кредитные продукты); Моделирование целевого портфеля; Презентация согласованных финансовых решений клиенту; Определение критериев взаимодействия с клиентом.</p>
--	--

5. ТЕМАТИЧЕСКИЙ ПЛАН

Тема	Часов						
	Наименование темы	Всего часов	Контактная работа (по уч.зан.)			Самост. работа	Контроль самостоятельной работы
			Лекции	Лабораторные	Практические занятия		
Семестр 3		21					
Тема 1.	Основные (базовые) и производные финансовые инструменты, эволюция их роли в мировой экономике (ПК-3)	21	1		2	18	
Семестр 3		40					
Тема 2.	Валютные инструменты в цифровой экономике (ПК-3)	40	1		2	37	
Семестр 3		30					
Тема 3.	Кредитные и инвестиционные инструменты в цифровой экономике (ПК-3)	30	1		2	27	
Семестр 3		21					
Тема 4.	Цифровизация биржевого рынка (ПК-3)	21	1		2	18	
Семестр 3		10					

Тема 5.	Интернет-технологии на рынке финансовых услуг (ПК-3)	10			2	8	
Семестр 3		22					
Тема 6.	Структурированные (структурные) финансовые инструменты (ПК-3)	22			2	20	

6. ФОРМЫ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ШКАЛЫ ОЦЕНИВАНИЯ

Раздел/Тема	Вид оценочного средства	Описание оценочного средства	Критерии оценивания
Текущий контроль (Приложение 4)			
Тема 1,2,4	Коллоквиум (Приложение 4)	Владение понятийным аппаратом, умение вести аргументированное обсуждение вопросов темы.	10 баллов
Тема 5	Тест (Приложение 4)	Количество вопросов -10. По 1 баллу за каждый правильный ответ.	10 баллов
Тема 3,6	Проект (Приложение 4)	Проект оценивается по следующим критериям: - актуальность материала; - логика, четкость изложения; - обоснованность сформулированных выводов.	10 баллов
Промежуточная аттестация (Приложение 5)			
3 семестр (ЗаО)	Билет для зачета с оценкой (Приложение 5)	Билет включает два теоретических вопроса и практическое задание	Используется балльно-рейтинговая система 85-100% - отлично 71-84% - хорошо 50-70% - удовлетворительно

ОПИСАНИЕ ШКАЛ ОЦЕНИВАНИЯ

Показатель оценки освоения ОПОП формируется на основе объединения текущего контроля и промежуточной аттестации обучающегося.

Показатель рейтинга по каждой дисциплине выражается в процентах, который показывает уровень подготовки студента.

Текущий контроль. Используется 100-балльная система оценивания. Оценка работы студента в течение семестра осуществляется преподавателем в соответствии с разработанной им системой оценки учебных достижений в процессе обучения по данной дисциплине.

В рабочих программах дисциплин и практик закреплены виды текущего контроля, планируемые результаты контрольных мероприятий и критерии оценки учебных достижений.

В течение семестра преподавателем проводится не менее 3-х контрольных мероприятий, по оценке деятельности студента. Если посещения занятий по дисциплине включены в рейтинг, то данный показатель составляет не более 20% от максимального количества баллов по дисциплине.

Промежуточная аттестация. Используется 5-балльная система оценивания. Оценка работы студента по окончании дисциплины (части дисциплины) осуществляется преподавателем в соответствии с разработанной им системой оценки достижений студента в процессе обучения по данной дисциплине. Промежуточная аттестация также проводится по окончании формирования компетенций.

Порядок перевода рейтинга, предусмотренных системой оценивания, по дисциплине, в пятибалльную систему.

Высокий уровень – 100% - 70% - отлично, хорошо.

Средний уровень – 69% - 50% - удовлетворительно.

Показатель оценки	По 5-балльной системе	Характеристика показателя
100% - 85%	отлично	обладают теоретическими знаниями в полном объеме, понимают, самостоятельно умеют применять, исследовать, идентифицировать, анализировать, систематизировать, распределять по категориям, рассчитать показатели, классифицировать, разрабатывать модели, алгоритмизировать, управлять, организовать, планировать процессы исследования, осуществлять оценку результатов на высоком уровне
84% - 70%	хорошо	обладают теоретическими знаниями в полном объеме, понимают, самостоятельно умеют применять, исследовать, идентифицировать, анализировать, систематизировать, распределять по категориям, рассчитать показатели, классифицировать, разрабатывать модели, алгоритмизировать, управлять, организовать, планировать процессы исследования, осуществлять оценку результатов. Могут быть допущены недочеты, исправленные студентом самостоятельно в процессе работы (ответа и т.д.)
69% - 50%	удовлетворительно	обладают общими теоретическими знаниями, умеют применять, исследовать, идентифицировать, анализировать, систематизировать, распределять по категориям, рассчитать показатели, классифицировать, разрабатывать модели, алгоритмизировать, управлять, организовать, планировать процессы исследования, осуществлять оценку результатов на среднем уровне. Допускаются ошибки, которые студент затрудняется исправить самостоятельно.
49 % и менее	неудовлетворительно	обладают не полным объемом общих теоретическими знаниями, не умеют самостоятельно применять, исследовать, идентифицировать, анализировать, систематизировать, распределять по категориям, рассчитать показатели, классифицировать, разрабатывать модели, алгоритмизировать, управлять, организовать, планировать процессы исследования, осуществлять оценку результатов. Не сформированы умения и навыки для решения профессиональных задач
100% - 50%	зачтено	характеристика показателя соответствует «отлично», «хорошо», «удовлетворительно»
49 % и менее	не зачтено	характеристика показателя соответствует «неудовлетворительно»

7. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

7.1. Содержание лекций

<p>Тема 1. Основные (базовые) и производные финансовые инструменты, эволюция их роли в мировой экономике (ПК-3)</p> <p>Основные (базовые) финансовые инструменты: акция, облигация, сертификат участия (клиринговый, ипотечный), инвестиционный пай,</p> <p>Производные финансовые инструменты: форвардные , фьючерсные , опционные контракты, свопы, депозитарные расписки</p>
<p>Тема 2. Валютные инструменты в цифровой экономике (ПК-3)</p> <p>Резервные валюты, криптовалюты. Инструменты спот и срочного рынка.</p>
<p>Тема 3. Кредитные и инвестиционные инструменты в цифровой экономике (ПК-3)</p> <p>Кредитный дефолтный своп. Биржевой фонд, индивидуальный инвестиционный счет, ипотечный сертификат участия. Мобильные приложения на рынке инвестиционных услуг. Интернет-трейдинговые системы для совершения операций с финансовыми инструментами.</p>
<p>Тема 4. Цифровизация биржевого рынка (ПК-3)</p> <p>Биржа - основной финансовый институт в условиях цифровизации экономики. Индексы российских бирж. Котировальные списки ценных бумаг. Биржевые облигации. Биржевые фонды (ETF, ПИФ).</p>

7.2 Содержание практических занятий и лабораторных работ

<p>Тема 2. Валютные инструменты в цифровой экономике (ПК-3)</p> <p>Форма проведения семинара - дискуссия</p>
<p>Тема 3. Кредитные и инвестиционные инструменты в цифровой экономике (ПК-3)</p> <p>Форма проведения занятия - презентация. Обсуждение презентаций по заданным инвестиционным продуктам и финансовым технологиям на примере российских банков и инвестиционных компаний.</p>
<p>Тема 4. Цифровизация биржевого рынка (ПК-3)</p> <p>Форма проведения занятия - дискуссия.</p>
<p>Тема 5. Интернет-технологии на рынке финансовых услуг (ПК-3)</p> <p>Изучение понятийного аппарата темы, лекционного материала, глав рекомендованных учебников и дополнительных электронных ресурсов.</p>
<p>Тема 6. Структурированные (структурные) финансовые инструменты (ПК-3)</p> <p>Форма проведения занятия - презентация. Обсуждение презентаций по заданным структурным (структурированным) продуктам на примере российских банков и инвестиционных компаний.</p>

7.3. Содержание самостоятельной работы

<p>Тема 2. Валютные инструменты в цифровой экономике (ПК-3) Изучение понятийного аппарата темы, лекционного материала, глав рекомендованных учебников и дополнительных электронных ресурсов.</p>
<p>Тема 3. Кредитные и инвестиционные инструменты в цифровой экономике (ПК-3) Изучение понятийного аппарата темы, лекционного материала, глав рекомендованных учебников и дополнительных электронных ресурсов. Подготовка презентации.</p>
<p>Тема 4. Цифровизация биржевого рынка (ПК-3) Изучение понятийного аппарата темы, лекционного материала, глав рекомендованных учебников и дополнительных электронных ресурсов.</p>
<p>Тема 5. Интернет-технологии на рынке финансовых услуг (ПК-3) Интернет технологии на валютном рынке (форекс-диллинг, кассовый и срочный рынок). Интернет-трейдинг на фондовом рынке (торговая система QUIK, мобильное приложение). Мобильные приложения на страховом рынке. Маркетплейс на рынке финансовых услуг (деPOSITный вклад, брокерский счет и др.). Личный кабинет как технология управления активами клиента. Контрольная работа по проблемным вопросам интернет-технологий на валютном рынке</p>
<p>Тема 6. Структурированные (структурные) финансовые инструменты (ПК-3) Понятие структурного (структурированного) продукта как гибридного финансового инструмента. Условия выплат дохода и возврата инвестированного капитала по структурным продуктам. Безрисковая и доходная часть структурного продукта. Опцион как инструмент, генерирующий доходную часть структурного продукта. Полная и неполная защита инвестированного капитала. Коэффициент участия инвестора в потенциальной доходности структурного продукта. Изучение понятийного аппарата темы, лекционного материала, глав рекомендованных учебников и дополнительных электронных ресурсов. Подготовка презентации.</p>

7.3.1. Примерные вопросы для самостоятельной подготовки к зачету/экзамену
Приложение 1

7.3.2. Практические задания по дисциплине для самостоятельной подготовки к зачету/экзамену
Приложение 2

7.3.3. Перечень курсовых работ
Не предусмотрено

7.4. Электронное портфолио обучающегося
Не размещается

7.5. Методические рекомендации по выполнению контрольной работы
Контрольная работа не предусмотрена

7.6 Методические рекомендации по выполнению курсовой работы
Курсовая работа не предусмотрена

8. ОСОБЕННОСТИ ОРГАНИЗАЦИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ ДЛЯ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ

По заявлению студента

В целях доступности освоения программы для лиц с ограниченными возможностями здоровья при необходимости кафедра обеспечивает следующие условия:

- особый порядок освоения дисциплины, с учетом состояния их здоровья;
- электронные образовательные ресурсы по дисциплине в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья;
- изучение дисциплины по индивидуальному учебному плану (вне зависимости от формы обучения);
- электронное обучение и дистанционные образовательные технологии, которые предусматривают возможности приема-передачи информации в доступных для них формах.
- доступ (удаленный доступ), к современным профессиональным базам данных и информационным справочным системам, состав которых определен РПД.

9. ПЕРЕЧЕНЬ ОСНОВНОЙ И ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ УЧЕБНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Сайт библиотеки УрГЭУ

<http://lib.usue.ru/>

Основная литература:

2. Вяткин В. Н., Гамза В. А., Маевский Ф. В. Риск-менеджмент [Электронный ресурс]: учебник. - Москва: Юрайт, 2024. - 365 – Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/536005>

3. Сергеев Л. И., Сергеев Д. Л., Юданова А. Л. Цифровая экономика [Электронный ресурс]: учебник для вузов. - Москва: Юрайт, 2024. - 437 – Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/543648>

4. Вяткин В. Н., Гамза В. А., Хэмптон Д. Д. Финансовые решения в управлении бизнесом [Электронный ресурс]: учебно-практическое пособие для вузов. - Москва: Юрайт, 2024. - 325 – Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/537984>

Дополнительная литература:

10. ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ЛИЦЕНЗИОННОГО ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ИНФОРМАЦИОННЫХ СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ, ОНЛАЙН КУРСОВ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Перечень лицензионного программного обеспечения:

Astra Linux Common Edition. Договор №0417-ПО/2019 от 08.05.2019, Акт №Sk000343 от 24.05.2019 и Контракт № 35-У/2018 от 13.06.2018, Акт № УТ213 от 17.12.2018. Срок действия лицензии - без ограничения срока.

МойОфис стандартный. Соглашение № СК-281 от 7 июня 2017. Дата заключения - 07.06.2017. Срок действия лицензии - без ограничения срока.

Перечень информационных справочных систем, ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:

Справочно-правовая система Гарант. Договор № 58419 от 22 декабря 2015. Срок действия лицензии - без ограничения срока

Справочно-правовая система Консультант+. Договор № 143/223-У/2025 от 02.12.2025 Срок действия лицензии до 31.12.2026

11. ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Реализация учебной дисциплины осуществляется с использованием материально-технической базы УрГЭУ, обеспечивающей проведение всех видов учебных занятий и научно-исследовательской и самостоятельной работы обучающихся:

Специальные помещения представляют собой учебные аудитории для проведения всех видов занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду УрГЭУ.

Все помещения укомплектованы специализированной мебелью и оснащены мультимедийным оборудованием спецоборудованием (информационно-телекоммуникационным, иным компьютерным), доступом к информационно-поисковым, справочно-правовым системам, электронным библиотечным системам, базам данных действующего законодательства, иным информационным ресурсам служащими для представления учебной информации большой аудитории.

Для проведения занятий лекционного типа презентации и другие учебно-наглядные пособия, обеспечивающие тематические иллюстрации.

7.3.1. Примерные вопросы для самостоятельной подготовки к зачету с оценкой

1. Основные финансовые инструменты
2. Производные финансовые инструменты
3. Резервные валюты
4. Криптовалюты
5. Валютные инструменты спот рынка
6. Валютные инструменты срочного рынка
7. Кредитный дефолтный своп
8. Биржевые фонды: ETF и ПИФ
9. Индивидуальный инвестиционный счет
10. Ипотечный сертификат участия
11. Клиринговый сертификат участия
12. Мобильные приложения на рынке инвестиционных услуг
13. Интернет-трейдинговая система QUIK
14. Интернет-трейдинговая система МЕТА-ТРЕЙД
15. Индекс Мосбиржа
16. Индекс РТС
17. Маркет-мейкеры как институты биржевой торговли
18. Котировальные списки ценных бумаг (российская практика)
19. Особенности выпуска и обращения биржевых облигаций
20. Маржируемый опционный контракт
21. Опцион на фьючерсный контракт
22. Мобильное приложение ПАО Сбербанк
23. Мобильное приложение Банка ВТБ (ПАО)
24. Мобильное приложение Альфа-Банка (АО)
25. Мобильное приложение АО «Тинькофф Банк»
26. Мобильные приложения на страховом рынке (ОСАГО)
27. Маркетплейс как универсальная торговая площадка для инвесторов
28. Валютно-процентный своп
29. Фондовый своп
30. Коэффициент хеджирования дельта
31. Структурный (структурированный) финансовый продукт
32. Структурный продукт с полной защитой капитала
33. Структурный продукт с неполной защитой капитала
34. Безрисковая и доходная часть структурного продукта
35. Коэффициент участия инвестора в доходности структурного продукта
36. Спецификация фьючерсного контракта
37. Спецификация опционного контракта
38. Ковариация активов, коэффициент корреляции
39. Маржа по операциям с фьючерсными контрактами, ее виды и функциональные особенности
40. Премия, внутренняя и временная стоимость опциона
41. Автоследование на финансовом рынке
42. Алгоритмическая торговля на фондовом рынке
43. Покрытые и непокрытые опционы
44. Индексный портфель ценных бумаг
45. Личный кабинет как технология управления активами клиента
46. Процентный своп
47. Виды финансовых активов

48. Товарный своп
49. Зависимость премии опциона от процентных ставок
50. Структурированные финансовые продукты, причины их появления

7.3.2. Практические задания по дисциплине для самостоятельной подготовки к зачету с оценкой

Примерные практические задания к зачету с оценкой

Открытые вопросы

Задание 1 (ПК-3).

Какие ценные бумаги относятся как к денежному рынку, так и к рынку капиталов?

Задание 2 (ПК-3).

Как называется процентное изменение цен на акции к процентному изменению индекса цен на акции?

Задание 3 (ПК-3).

Охарактеризовать структурный (структурированный) финансовый продукт.

Задание 4 (ПК-3).

Как называется риск, который не устраняется снижением риска по портфелю путем распределения средств портфеля по широкой группе ценных бумаг?

Задание 5 (ПК-3).

Что такое опцион «вне денег»?

Закрытые вопросы

Задание 1 (ПК-3).

Инвестор владеет акцией компании и открывает короткую позицию по фьючерсному контракту на акцию по цене X . К моменту исполнения контракта спот-цена акции составила 120 руб. Укажите цену исполнения фьючерсного контракта, если прибыль по контракту, предполагающему только денежные взаиморасчеты, составила 30 руб.

A) 90 руб.

B) 150 руб.

C) 180 руб.

D) 120 руб.

Задание 2 (ПК-3).

Рассчитать коэффициент Шарпа при условии, что инвестиционный портфель показал доходность 25% годовых, его стандартное отклонение составило – 10%. Депозитный вклад в банке обеспечивает 5% годовых.

A) 1,5

B) 2,0

C) 2,5

D) 1.0

Задание 3 (ПК-3).

Среди перечисленных ниже укажите основной постулат параметрической модели "Стоимостной меры риска" (VAR)

A) Относительное изменение рыночной цены ценной бумаги подчиняется логнормальному закону распределения случайной величины

В) Относительное изменение рыночной цены ценной бумаги измеряется стандартным ее отклонением

С) Изучение относительных изменений рыночной цены равносильно изучению изменения логарифма рыночной цены

Д) Относительное изменение рыночной цены ценной бумаги измеряется коэффициентом бета

Задание 4 (ПК-3).

Коэффициент бета для акции меньше 1. За неделю курсовая стоимость акции поднялась на 15%. За эту неделю рынок акций в целом:

А) Упал на 15%

В) Вырос на 15%

С) Вырос более, чем на 15%

Д) Вырос менее чем на 15%.

Задание 5 (ПК-3).

Какому из перечисленных терминов наиболее близко понятие "индоссамент"?

А) Аваль

В) Акцепт

С) Цессия

Д) Аллонж