

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Ставропольский государственный аграрный университет»



**Методические указания для выполнения контрольной
работы по дисциплине
«Обеспечение экономической безопасности операций на
финансовом рынке»**

для обучающихся заочной и очно-заочной форм обучения (специальности 38.05.01 –
«Экономическая безопасность»)

Ставрополь, 2018

УДК 336:338 (076)

ББК 65.9я73

М 545

Методические указания для выполнения контрольной работы по дисциплине «Обеспечение экономической безопасности операций на финансовом рынке» для обучающихся заочной (специальности 38.05.01 – «Экономическая безопасность») одобрены и рекомендованы к печати кафедрой финансов, кредита и страхового дела (протокол № 4 от 1 октября 2018 г.) и учебно-методической комиссией учетно-финансового факультета (протокол № 3 от 19 октября 2018 г.).

М 545 **Методические указания** по выполнению контрольной работы по дисциплине **«Обеспечение экономической безопасности операций на финансовом рынке»** для обучающихся заочной форм обучения (специальности 38.05.01 – «Экономическая безопасность») / О. Н. Углицких, И. И. Глотова, Е. П. Томилина, Ю. Е. Клишина, И. М. Подколзина, А. А. Смагин. Ставрополь : АГРУС Ставропольского гос. аграрного ун-та., 2018. 16 с.

В методических указаниях освещены требования к написанию контрольной работы: выбор темы контрольной работы, структура, содержание контрольной работы, подбор и изучение литературы, порядок оформления и выполнения контрольной работы, роль руководителя контрольной работы, порядок собеседования контрольной работы, тематика, рекомендуемая литература и приложения.

Введение

Обеспечение безопасности операций, проводимых на финансовом рынке в рамках рыночной экономики является важным инструментом достижения макроэкономического равновесия. Как центр принятия наиболее эффективных инвестиционных решений он может обеспечить мобилизацию совокупных накоплений и их трансформацию в инвестиции. Целью изучения дисциплины «Обеспечение экономической безопасности операций на финансовом рынке» является формирование у студентов системы знаний о взаимосвязях и функционировании современных финансовых рынков – рынка капитала, денежного рынка, валютного рынка и рынка производных ценных бумаг.

По учебному плану дисциплина «Обеспечение экономической безопасности операций на финансовом рынке» относится к циклу дисциплин вариативной части.

Дисциплина «Обеспечение экономической безопасности операций на финансовом рынке» базируется на ранее изученных дисциплинах - «Макроэкономика» и «Микроэкономика», в результате освоения которых закладываются знания по теории финансовых рынков.

Дисциплина «Обеспечение экономической безопасности операций на финансовом рынке» позволяет проследить логическую связь и взаимообусловленность основных типов финансовых рынков как с точки зрения их исторического развития, так с учетом их возможных тенденций и перспективы.

Формой промежуточного контроля по дисциплине «Обеспечение экономической безопасности операций на финансовом рынке» является экзамен.

В соответствии с учебным планом специальности 38.05.01 «Экономическая безопасность» на изучение дисциплины «Обеспечение экономической безопасности операций на финансовом рынке» выделено 144 часа, включающих аудиторную и самостоятельную работу.

Самостоятельная работа студентов в ходе семестра является важной составной частью учебного процесса и необходима для закрепления и углубления знаний, полученных в период сессии на лекциях, практических и интерактивных занятиях, а также для индивидуального изучения дисциплины в соответствии с программой и рекомендованной литературой. Самостоятельная работа выполняется в виде подготовки домашнего задания или сообщения по отдельным вопросам, реферативного обзора.

Контроль качества самостоятельной работы может осуществляться с помощью устного опроса на лекциях или практических занятиях, у студентов заочно и очно-заочной форм обучения проверки контрольных работ и тестирования.

Контрольная работа представляет собой один из видов самостоятельной работы обучающихся заочной и очно-заочной форм обучения. Контрольная работа по дисциплине «Обеспечение экономической безопасности операций на финансовом рынке» является составной частью учебного процесса, способствует более глубокому изучению дисциплины, позволяет обучающимся научиться использовать на практике теоретические знания и выполняется с целью приобретения обучающимися практических навыков расчета и анализа показателей, применяемых при разработке финансовой политики корпорации.

Цель контрольной работы – самостоятельное решение обучающимся поставленного вопроса на основе изучения рекомендованной и дополнительной специальной учебной и научной литературы. Контрольная работа выполняется обучающимся на основе индивидуального задания.

1. Методические указания к выполнению контрольной работы

Целью выполнения контрольной работы является более глубокое усвоение студентом данной дисциплины и выработка практических навыков в ходе самостоятельного изучения специальной литературы по темам дисциплины. Задачами выполнения контрольной работы является детальное исследование двух теоретических вопросов, изучаемых в дисциплине «Обеспечение экономической безопасности операций на финансовом рынке», и решение двух практических задач в соответствии с предложенным вариантом.

Тема теоретической части должна быть раскрыта достаточно полно, с использованием законодательной базы, регулирующей деятельность финансовых рынков, и с приведением примеров из практики или специальной литературы. Решение практического задания должно сопровождаться необходимыми пояснениями и выводами.

Контрольная работа является частью учебного процесса. Получение зачета по контрольной работе является обязательным условием для допуска к экзамену по данной дисциплине.

Студент сдает контрольную работу на кафедру финансов, кредита и страхового дела в отпечатанном виде лично или направляет ее по почте не позднее 14 дней до начала экзаменационной сессии.

Прежде чем приступить к выполнению контрольной работы, обучающийся должен внимательно ознакомиться с методическими рекомендациями, изучить необходимую литературу, а также публикации периодических изданий по вопросам варианта контрольной работы. Рекомендуется следить за изменениями в области финансового и законодательства, которые обучающийся использует при написании контрольной работы.

Обучающийся подбирает необходимую литературу для написания контрольной работы из различных общедоступных источников, в том числе и в библиотеке Ставропольского государственного аграрного университета, справочно-правовой системе и электронно-библиотечной системе.

Выполнение контрольной работы начинается с общего ознакомления с основными литературными источниками (монографиями, статьями, информационно-справочной литературой).

Для изучения периодических изданий обучающемуся необходимо вначале использовать последние в году номера журналов, где помещается указатель статей, опубликованных за год.

При выполнении работы рекомендуется воспользоваться следующими ресурсами информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:

1. Министерства экономического развития и торговли РФ
<http://www.economy.gov.ru>
2. Госкомстат России <http://www.gks.ru/>
3. Центр макроэкономического анализа <http://www.forecast.ru/>
4. Бюджетно-финансовый аналитический центр
<http://www.olap.ru/catalog/bfac.asp>
5. Корпоративный Менеджмент <http://www.cfin.ru>
6. Эксперт <http://www.expert.ru>
7. Финансовое моделирование, бюджетирование, планирование
<http://www.finmodeling.ru/>
8. <http://elibrary.ru/> – крупнейший российский информационный портал, содержащий рефераты и полные тексты более 14 млн научных статей и публикаций.

При выполнении контрольной работы следует использовать учебную и научную литературу, которой не более 5 лет.

Рекомендуется знакомиться с источниками в порядке, обратном хронологическому, т.е. вначале следует изучить самые свежие публикации, а затем прошлогодние, двухгодичной давности и т.д.

При использовании источников статистических данных необходимо также начинать изучение с данных за последние 3 года.

Список использованной литературы составляется в следующем порядке:

1. Законы Российской Федерации (причем сначала – конституционные, затем – кодифицированные, а уж после них – все остальные);
2. Указы Президента Российской Федерации;
3. Постановления Правительства Российской Федерации;
4. Нормативные акты, инструкции.
5. Монографическая и учебная литература.
6. Периодические издания.
7. Интернет-ресурсы.

Годовые отчеты, бизнес – планы и другая первичная бухгалтерская, статистическая и финансовая документация в список литературы не включается.

2. Контрольные задания

Номера теоретических вопросов и вариантов практических заданий контрольной работы определяются по последней цифре номера зачетной книжки (Таблица 1).

Таблица 1 - Выбор заданий контрольной работы

Последняя цифра номера зачетной книжки	Номера теоретических вопросов	Номера практических задач
1	1,11	1,11
2	2,12	2,12
3	3,13	3,13
4	4,14	4,14
5	5,15	5,15
6	6,16	6,16
7	7,17	7,17
8	8,18	8,18
9	9,19	9,19
0	10,20	10,20

Теоретические вопросы контрольной работы

1. Отличительные особенности и черты современного финансового рынка России.
2. Формирование и эволюция российской кредитной системы.
3. Становление российского рынка ценных бумаг
4. Роль финансового рынка в национальной экономике.
5. Основные черты современного денежного рынка.
6. Классификация основных видов финансовых инструментов рынка долгосрочного капитала.
7. Рынок заемного капитала и рынок инструментов собственности (акций).
8. Виды облигаций в соответствии с российским законодательством.
9. Рейтинг облигаций – балльная оценка облигаций в соответствии с инвестиционными качествами.
10. Основные виды российских государственных ценных бумаг.
11. Особенности выпуска и размещения муниципальных долгосрочных облигаций.

12. Причины возникновения, развития и основные черты рынка еврооблигаций.

13. Характеристика инвестиционных качеств обыкновенных акций: грошовые акции, первоклассные акции, акции второго эшелона, акции роста, спекулятивные акции, циклические акции, оборонительные акции.

14. Преимущества и недостатки покупки привилегированных акций для инвестора.

15. Объем, ликвидность и тенденции развития рынка производных финансовых инструментов в Российской Федерации.

16. Особенности регулирования рынка производных финансовых инструментов в Российской Федерации.

17. Интегральные показатели рынка ценных бумаг - индексы рынков акций и индексы облигаций.

18. Особенности и инструменты регулирования валютного рынка.

19. Структура государственных органов и институтов, осуществляющих регулирование финансовых рынков в разных странах.

20. Типология участников финансовых рынков.

Практические задачи контрольной работы

Задача 1.

Определите проценты и сумму накопленного долга, если ссуда равна 9000 долларов США, срок долга 5 лет при ставке простого процента равной 12 % годовых.

Задача 2.

Определите, какую сумму должен выплатить заемщик при наступлении даты погашения кредита, если первоначальная сумма кредита составляла 50000 руб., срок – 180 дней, ставка процента 6% годовых (начисляются простые проценты, периодичность начисления – один раз в конце срока кредита); $K=360$. Проценты подлежат погашению вместе с суммой основного долга.

Задача 3.

Кредит для покупки дома выдан на сумму 4000000 рублей сроком на 5 лет. Процентная ставка составляет 14 % годовых. Погашение кредита производится в конце каждого месяца. Определить сумму, которая должна быть выплачена за все пять лет и ежемесячный погасительный платеж.

Задача 4.

Выдан кредит в сумме 2000000 рублей сроком на 0,5 года. Плата за кредит составила 1200000 рублей. Рассчитать ставку кредита.

Задача 5.

Кредит в размере 5000000 рублей выдан на срок 5 лет и 180 дней под простую процентную ставку 12 % годовых. Определите величину суммы вместе с процентами к погашению.

Задача 6.

За какой срок в годах сумма, равная 25 млн. рублей, достигнет 200 млн. рублей при начислении процентов по сложной ставке 15 процентов в году и поквартально?

Задача 7.

Кредит в сумме 100000 руб. выдан на срок 3 года под 10% годовых. Проценты начисляются на сумму основного долга и (кроме первого года) на сумму уже начисленных процентов в конце каждого года. Определите общую сумму задолженности по кредиту на момент погашения.

Задача 8.

Кредит в сумме 500000 руб. выдан на срок 5 лет под 7% годовых. Начисляются сложные проценты, периодичность начисления - в конце каждого года. Определите общую сумму задолженности по кредиту на момент погашения.

Задача 9.

Кредит в сумме 100000 руб. выдан на срок 3 года. Номинальная годовая ставка равна 10% годовых. Проценты начисляются на сумму основного долга и (кроме первого квартала) на сумму уже начисленных процентов в конце каждого квартала. Определите общую сумму задолженности по кредиту на момент погашения.

Задача 10.

Кредит в сумме 200000 руб. выдан на срок 5 лет. Номинальная годовая ставка равна 20% годовых. Начисляются сложные проценты, периодичность начисления - в конце каждого квартала. Определите общую сумму задолженности по кредиту на момент погашения.

Задача 11.

Краткосрочная облигация куплена 20.12.2016 по цене 89.41 от номинала, погашена 20.03.2017. Рассчитайте доходность за период владения, доходность к погашению и дисконтную доходность от данного инвестирования.

Задача 12.

Определите дисконтную доходность (доходность на основе дисконта) простого векселя номинальной стоимостью 200000 руб. со сроком платежа «В 90 дней от составления», если вексель был продан на момент составления с дисконтом 5% от номинальной стоимости.

Задача 13.

Определите дисконтную доходность (доходность на основе дисконта) простого векселя номиналом 500000 рублей со сроком платежа в 180 дней от составления, если вексель был продан на момент составления с дисконтом 20 %.

Задача 14.

Номинал облигации 1000 руб., купон 10%, выплачивается 1 раз в год. До погашения облигации 3 года. Определить цену облигации, если ее доходность до погашения должна составить 9%.

Задача 15.

Номинал облигации 1000 руб., купон 10%, выплачивается 2 раза в год. До погашения облигации 2 года. Определить цену облигации, если ее доходность до погашения должна составить 8%.

Задача 16.

Номинал облигации 1000 руб., купон 7%, выплачивается ежеквартально. До погашения облигации 5 лет. Определить цену облигации, если ее доходность до погашения должна составить 6,5% годовых.

Задача 17.

Номинал бескупонной облигации равен 1000 руб., бумага погашается через 5 лет. Определить цену облигации, если ее доходность до погашения должна составить 12% годовых.

Задача 18.

Номинал бескупонной облигации равен 1000 руб., бумага погашается через 30 дней. Определить цену облигации, если ее доходность до погашения должна составить 4% годовых. База 365 дней.

Задача 19.

Номинал бескупонной облигации равен 1000 руб., бумага погашается через 65 дней. Определить цену облигации, если ее доходность до погашения должна составить 3,5% годовых. База 365 дней.

Задача 20.

Номинал бескупонной облигации равен 1000 руб., бумага погашается через 4 дня. Определить цену облигации, если ее доходность до погашения должна составить 2% годовых. База 365 дней.

3. Требования к оформлению контрольной работы

Контрольная работа состоит из титульного листа, содержания, введения, основной части (двух теоретических вопросов и двух практических задач), заключения, списка используемых источников.

Контрольная работа оформляется на компьютере на одной стороне белой бумаги формата А4 (210 x 297 мм). Объем контрольной работы 15 - 20 страниц машинописного текста, включая титульный лист и список использованных источников. Размеры полей: левое - 30 мм, правое - 20 мм, верхнее – 20 мм, нижнее - 20 мм. При оформлении на компьютере используется шрифт –14, интервал - 1,5.

Текст основной части делят на разделы (главы), при необходимости - на подразделы (параграфы) и пункты. При раскрытии теоретических вопросов могут использоваться рисунки, схемы, таблицы, графики. Каждый раздел следует начинать с нового листа.

Страницы работы нумеруют арабскими цифрами. Титульный лист включают в общую нумерацию. На титульном листе номер не ставят, на последующих страницах номер проставляют в правом верхнем углу. Графический материал, выполненный на отдельных страницах, включают в порядковую нумерацию и размещают в контрольной работе после первого упоминания о нем в тексте.

На титульном листе должны быть указаны название кафедры, учебной дисциплины, фамилия, имя и отчество студента, шифр его зачетной книжки, дата предоставления контрольной работы на кафедру.

Список используемых источников должен содержать перечень литературы, использованной при выполнении контрольной работы, и включать не менее 10-ти наименований. Сведения об источниках необходимо давать с указанием автора, названия, места издания, издательства, года издания, объема.

Контрольная работа должна завершаться указанием даты выполнения и личной подписью студента (на последней странице заключения). Законченная работа, содержащая все требуемые элементы оформления, вставленная в обложку и скрепленная по левому краю, сдается для проверки на кафедру не позднее 2-х недель до начала экзаменационной сессии.

После представления законченной и оформленной работы преподаватель проверяет ее и выставляет оценку работе – «зачтено» или «не зачтено».

Контрольная работа, получившая положительную оценку, на руки студенту не выдается, информация о зачете работы оформляется в специальной ведомости.

Если в работе имеются ошибки требующие исправления, рецензент на полях или в рецензии делает соответствующие замечания. После получения проверенной, но не зачтенной работы студент должен исправить все отмеченные ошибки и учесть замечания рецензента. Исправления и дополнения должны быть выполнены на отдельных листах и вложены в соответствующие места контрольной работы. Вносить поправки в ранее написанный текст после проверки, студенту не разрешается.

4. Перечень контрольных вопросов для проверки знаний по дисциплине

1. Понятие финансового рынка.
2. Основные категории финансовых рынков.
3. Основные характеристики финансовых инструментов.
4. Основные виды инструментов займа.
5. Денежный рынок и рынок капитала.
6. Кредитная система и рынок ценных бумаг.
7. Первичный и вторичный рынки.
8. Биржевой и внебиржевой рынки.
9. Базовые и производные Обеспечение экономической безопасности операций на финансовом рынке.
10. Понятие и функции денежного рынка.
11. Отличие денежного рынка от рынка капитала.
12. Причины возникновения денежного рынка.
13. Основные участники западного и российского денежного рынка.
14. Виды инструментов денежного рынка.
15. Основные преимущества и недостатки инвестиций в государственные краткосрочные облигации.
16. Основные преимущества и недостатки инвестиций в муниципальные краткосрочные облигации.
17. Основные преимущества и недостатки инвестиций в банковские депозитные сертификаты.
18. Основные преимущества и недостатки инвестиций в банковские векселя.
19. Основные преимущества и недостатки инвестиций в коммерческие бумаги.
20. Соглашение о продаже ценных бумаг с обратным выкупом – операции РЕПО.
21. Рынок заемного капитала.
22. Участники рынка долгосрочного капитала.
23. Сущность и фундаментальные свойства облигаций.
24. Преимущества и недостатки выпуска облигаций для эмитента
25. Государственные среднесрочные и долгосрочные ценные бумаги.
26. Рынок облигаций федерального займа (ОФЗ).
27. Рынок облигаций государственного сберегательного займа (ОГСЗ).
28. Рынок облигаций государственного внутреннего валютного займа (ОГВВЗ).
29. Муниципальные долгосрочные облигации.
30. Российские корпоративные облигации.
31. Внутренний и международный рынки облигаций.
32. Иностранные облигации и еврооблигации.
33. Основные виды инструментов собственности: акции, депозитарные расписки, варранты.
34. Фундаментальные свойства акций.

35. Характеристика обыкновенных акций по инвестиционным качествам.
36. Преимущества и недостатки выпуска привилегированных акций для эмитента.
37. Особенности рынка производных ценных бумаг.
38. Основные участники рынка производных ценных бумаг: хеджеры, спекулянты, арбитражеры.
39. Виды производных инструментов.
40. Форвардные и фьючерсные контракты.
41. Характеристика фьючерсного контракта.
42. Виды опционных контрактов
43. Валютный рынок и его роль в экономике
44. Участники валютного рынка.
45. Инфраструктура валютного рынка: валютная биржа.
46. Организация и структура финансового рынка.
47. Обеспечение безопасности валютных операций.
48. Обеспечение безопасности кредитных операций банков.
49. Индикаторы безопасности фондового рынка.
50. Безопасность проведения страховых операций.
51. Рынок драгоценных металлов и камней: безопасное проведение операций.
52. Инвестиционные операции на финансовом рынке.
53. Мошенничество на финансовых рынках.
54. Обеспечение информационной безопасности участников финансового рынка.
55. Международная финансовая безопасность в условиях глобализации.

5. Список рекомендуемых информационных источников

а) основная литература:

1. ЭБС «Znanium»: Чижик В. П. Финансовые рынки и институты : учеб. пособие / В.П. Чижик. — М. : ФОРУМ : ИНФРА-М, 2018. — 384 с. - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/940807>
2. ЭБС «Znanium»: Зверев В. А. Рынок ценных бумаг : учебник / Зверев В.А., Зверева А.В., Евсюков С.Г. - М.: Дашков и К, 2018. - 256 с.: ISBN 978-5-394-02390-3 - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/513247>
3. ЭБС «Znanium»: Галанов В. А. Рынок ценных бумаг: Учебник / Галанов В. А. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2016. - 378 с. – Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=549889>
4. ЭБС Znanium.com: Экономическая безопасность : учеб. пособие / под ред. Н.В. Манохиной. — М. : ИНФРА-М, 2017. — 320 с. - Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=641807>

б) дополнительная литература:

1. ЭБС Znanium.com: Основы экономической безопасности : учебник / Н.Н. Карзаева. — М. : ИНФРА-М, 2018. — 275 с. - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/915115>
2. ЭБС «Znanium»: Финансовый рынок: Рынок ценных бумаг: Учебное пособие / И.В. Кирьянов, С.Н. Часовников. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2014. - 281 с. – Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=488348>
3. ЭБ «Труды ученых СтГАУ»: Учебно-методическое пособие по дисциплине "Финансовые рынки" [электронный полный текст] : направления 38.03.01 "Экономика" профиль "Финансы и кредит" квалификация - бакалавр / И. И. Глотова, Е. П. Томилина, О. Н. Углицких, Ю. Е. Клишина ; СтГАУ. - Ставрополь, 2016. - 8,00 МБ.
4. ЭБ "Труды ученых СтГАУ": Методические указания для самостоятельной работы студентов по дисциплине "Финансовые рынки" : для студентов направления 38.03.01 "Экономика" профиль "Финансы и кредит" / О. Н. Углицких, А. А. Гладилин, И. И. Глотова, Е. П. Томилина, Ю. Е. Клишина ; СтГАУ. - Ставрополь, 2015. - 2,70 МБ. - (85 лет СтГАУ).
5. ЭБ "Труды ученых СтГАУ": Рабочая тетрадь по дисциплине "Финансовые рынки" [электронный полный текст] : для студентов направления 38.03.01 "Экономика" профиль "Финансы и кредит" / О. Н. Углицких, А. А. Гладилин, И. И. Глотова, Е. П. Томилина, Ю. Е. Клишина ; СтГАУ. - Ставрополь, 2015. - 2,46 МБ. - (85 лет СтГАУ).
6. Фабоцци, Ф. Справочник по ценным бумагам с фиксированной процентной ставкой. Т. 1 : Основы / пер. с англ. - 7-е изд. - М. : И. Д. Вильямс, 2008. - 928 с.

7. Финансы и кредит (периодическое издание).

в) Интернет-ресурсы:

1. Министерство финансов <http://www.minfin.ru/>
2. Центральный Банк Российской Федерации <http://www.cbr.ru/>
3. Госкомстат России <http://www.gks.ru/>
4. Центр макроэкономического анализа <http://www.forecast.ru/>
5. Статистический портал Высшей Школы Экономики <http://stat.hse.ru>

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ
ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
СТАВРОПОЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АГРАРНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

Кафедра «Финансы, кредит и страховое дело»

КОНТРОЛЬНАЯ РАБОТА
по дисциплине
**«Обеспечение экономической безопасности операций на финансовом
рынке»**

Вариант № 15

Выполнил(а):

обучающийся _____ курса _____
группы

заочная форма обучения

специальность 38.05.01 «Экономическая
безопасность»

Иванов Иван Иванович

Руководитель:

к.э.н., доцент

Углицких Ольга Николаевна

Содержание

Введение	3
1. Методические указания к выполнению контрольной работы	4
2. Контрольные задания	6
3. Требования к оформлению контрольной работы	10
4. Перечень контрольных вопросов для проверки знаний по дисциплине	11
5. Список рекомендуемых информационных источников	13
Приложение	15