

Финансовые рынки и институты (Бак.)

Вопросы для подготовки к зачету

1. Понятие финансового рынка, его сущность и функции.
2. Финансовый рынок как система. Основные тенденции на финансовых рынках.
3. Интеграция и конвергенция финансовых рынков. Превращение национальных финансовых рынков в единый глобальный финансовый рынок. Показатели глобализации.
4. Инновации на финансовых рынках. Финансовые инструменты, их объем и динамика на финансовых рынках.
5. Понятие и классификация финансовых институтов. Российские и зарубежные финансовые институты.
6. Модели банковских систем и инвестиционный потенциал финансового сектора – мировой опыт.
7. Закон Гласа–Стигала и его последствия.
8. Пирамида ГКО как один из источников формирования системы финансового посредничества в России.
9. Кредитные союзы. Паевые инвестиционные фонды – структура и риски.
10. Общие фонды банковского управления. Страховые компании. Негосударственные пенсионные фонды. Фонды прямых инвестиций и венчурные фонды.
11. Хедж-фонды: особенности возникновения, их влияние на мировые финансовые рынки прогноз их будущего.
12. Финансовые рынки и финансовая среда. Мировые финансовые рынки.
13. Виды финансовых рынков: денежный рынок; рынок капитала; рынок инструментов собственности, валютный рынок, рынок деривативов.
14. Фундаментальные свойства финансового рынка, классификация сделок и операций с ценными бумагами.
15. Текущее состояние финансового рынка России: структура, динамика, количественный и качественный анализ.
16. Основные услуги фондовых бирж (биржевые продукты). Виды аукционных механизмов, используемых на фондовых биржах различных типов.
17. Депозитарные и клиринговые системы. Сеть регистраторов.
18. Фондовые индексы, их роль на финансовых рынках. Методы расчета фондовых индексов. Структура и роль ведущих мировых индексов: Доу-Джонс, НАСДАК, NIKKEI, S@P, FT-SE и др.
19. Индекс РТС – история создания, методы расчета, роль в российской экономике.
20. Регулирование финансовых рынков. Информационная инфраструктура фондового рынка. Проблема асимметричности информации.
21. Понятие доходности ценных бумаг. Виды доходности: текущая доходность, доходность за период владения, дисконтная доходность, полная доходность – способы расчета по разным финансовым инструментам.
22. Приведенная стоимость денег – понятие и способы расчетов. Ренты и аннуитеты.
23. Международное регулирование финансовых рынков. Базельский комитет и его роль в области регулирования финансовых рынков и банковской деятельности.
24. Необходимость корректировки принципов международного регулирования банковской деятельности.
25. Норматив достаточности банковского капитала – эволюция принципов расчета и особенности применения этого норматива в России.

26. IOSCO – роль Международной организации комиссий по ценным бумагам в регулировании деятельности профессиональных участников на финансовых рынках.
27. Англо-американское, континентальное и иные группы права и их воздействие на формирование системы регулирования финансовых рынков.
28. Государственное регулирование и саморегулирование рынков. Структура государственных органов и институтов,
29. Регулятивные полномочия Центрального Банка России, Федеральной службы по финансовым рынкам, Министерства финансов России и Федеральной антимонопольной службы России.
30. Саморегулируемые организации: статус, интересы, сфера ответственности, функции.
31. Процедура рассмотрения споров по операциям на финансовых рынках, третейские суды.
32. Инструменты и методы регулирования на финансовых рынках: лицензирование деятельности, допуск на рынок, регулирование достаточности собственного капитала, требования о раскрытии информации и другие инструменты.
33. Фундаментальный и технический анализ финансовых рынков.
34. Понятие инвестиционного горизонта и вероятностного характера эволюции рынков.
35. Тренд и его линии, трендовые индикаторы, осцилляторы.
36. Основные черты и инструменты современного денежного рынка.
37. Краткосрочные облигации федеральных ведомств, агентств, министерств. Муниципальные краткосрочные ценные бумаги, основные преимущества и недостатки.
38. Банковские депозитные сертификаты и банковские депозиты. Основные преимущества и недостатки инвестиций в банковские депозитные сертификаты
39. Классификация банковских депозитных сертификатов в западной финансовой и в российской финансовой практике.
40. Понятие, сущность, виды векселей, их учет и расчет доходности операций с ними.
41. Бланковые векселя и Российский вексельный рынок:
42. Сущность, виды, фундаментальные свойства облигаций, преимущества и недостатки их выпуска. Рейтинг облигаций и система его построения.
43. Ценообразование облигаций. Теоремы об облигациях.
44. Виды муниципальных облигаций: займы общего покрытия и целевые облигации. Рынок корпоративных облигаций в России.
45. Основные виды инструментов собственности и их фундаментальные свойства
46. Формирование собственного капитала. Объявленный и выплаченный капитал, и виды акций.
47. Структура мировых финансовых рынков. Отличие финансовых рынков США от рынков Великобритании, Германии, Японии, Китая и других стран.
48. Мировые финансовые кризисы – причины их возникновения, и особенности регулирования.