|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Казахский национальный университет им. аль-Фараби**  **Силлабус**  **5В050900-Финансы**  **Осенний семестр 2016-2017 уч. год** | | | | | | | | | | |
| **Код дисциплины** | **Название дисциплины** | **Тип** | **Кол-во часов в неделю** | | | | | **Кол-во кредитов** | | **ECTS** |
| **Лек** | **Практ** | | **Лаб** | |
| FRO 2313 | Производные ценные бумаги | ПК | 2 | 2 | | 0 | | 3 | | 4 |
| **Пререквизиты** | Дисциплина базируется на знаниях, умениях и навыках, полученных при изучении следующих дисциплин: Микро- и Макроэкономики; Деньги, кредит, банки; Финансы; Корпоративные финансы; Государственное регулирование и государственный бюджет. | | | | | | | | | |
| **Лектор** | Алиева Баглан Муратовна - кандидат экономических наук, старший преподаватель | | | | **Офис-часы** | | | | По расписанию | |
| **e-mail** | baglan\_a74@mail.ru | | | |
| **Телефоны** | 87074976320 | | | | **Аудитория** | | | |  | |
| **Описание дисциплины** | Содержанием курса «Фондовый рынок и операции с ценными бумагами» является формирование знаний в области функционирования рынка ценных бумаг и механизм биржевых операций с целью совершенствования становления и дальнейшего развития финансового рынка страны и его составляющей – РЦБ, как наиболее перспективного сектора.. | | | | | | | | | |
| **Цель курса** | приобретение студентами теоретических знаний, умения увязывать теорию с практикой финансовой работы, в развитии теоретического способа мышления, устойчивого объективного мировоззрения будущих специалистов в области рынка ценных бумаг. | | | | | | | | | |
| **Результаты обучения** | В результате изучения дисциплины «Фондовый рынок и операции с ценными бумагами» студент должен знать: механизм функционирования рынка ценных бумаг и механизм биржевых операций; виды ценных бумаг; классификацию фондовых операций; систему управления рынком ценных бумаг; участников РЦБ, механизм функционирования фондовой биржи; первичный и вторичный РЦБ; методики определения рыночной стоимости ценных бумаг.  Уметь: классифицировать ценные бумаги по различным признакам; отличать биржевые сделки; характеризовать первичный и вторичный РЦБ; определять рыночную стоимость ЦБ; определять инвестиционную привлекательность ценных бумаг с применением различных методик; оценивать инвестиционные риски ценных бумаг. | | | | | | | | | |
| **Литература и ресурсы** | **Основная литература:**   1. Закон Республики Казахстан от 8 января 2003 года № 373-II «Об инвестициях» (с [изменениями и дополнениями](http://online.zakon.kz/Document/?link_id=1000396257" \t "_parent) по состоянию на 01.12.2015 г.) 2. Закон РК «О рынке ценных бумаг» от 02.07.2003 г. №461-II (с изменениями на 31.10.2015 г.) 3. Закон Республики Казахстан «О лицензировании» от 16 мая 2014 года № 202-V   **Дополнительная литература:**   1. Сейткасимов Г.С., Ильясов А.А. Формирование фондового рынка. /Учебное пособие. Экономика, Алматы, 2012г. 2. Рынок ценных бумаг и его финансовые институты /Учебное пособие под ред. Таркановского В.С. СПб, АО «Комплект», 2012г. 3. Кулекеев Ж.А., Джексебаева Л.Н Государственные ценные бумаги в экономике Казахстана/ Учебное пособие, Алматы, 2010г. 4. Рубцов Б.Б. Зарубежные фондовые рынки: инструменты, структура, механизм функционирования, М., 2010г. 5. Дуглас Л.Г. Анализ рисков операций с облигациями на рынке ценных бумаг, М.. 2012г. 6. Кенжегузин М.Б., Дадонов В.Ю. и др. Рынок ценных бумаг Казахстана: проблемы формирования и развития, Алматы, 2013г. 7. иятий Республики Казахстан. Учебное пособие. А.:Экономика, 2009. | | | | | | | | | |
| **Организация курса** | Это курс, в котором будет осуществлено общее знакомство с большим объемом теоретического и практического материала, поэтому в ходе подготовки к дисциплине существенная роль отводится не только учебнику и финансовой отчетности производственной компании выбранной из сайта www.kase.kz, но законодательным и нормативным документам Республики Казахстан об инвестициях, о рынке ценных бумаг. Домашние задания предоставят возможность студентам ознакомится с практическим применением теоретического материала. | | | | | | | | | |
| **Требования курса** | 1. К каждому аудиторному занятию вы должны подготовиться заранее, согласно графику, приведенному ниже. Подготовка задания должна быть завершена до аудиторного занятия, на котором обсуждается тема. 2. Домашние задания (СРС) будут распределены в течение семестра, как показано в графике дисциплины. 3. Аудиторные практические занятия составят от 0 до 5 баллов в неделю. 4. Оценка СРС составит 65 баллов в первые 5 недель. 5. Оценка СРС составит 60 баллов во вторые 6 недель.   При выполнении СРС должны соблюдаться следующие правила:   * СРС должны выполняться в указанные сроки. * СРС должно быть выполнено в виде реферата на одной стороне листа бумаги А4, и страницы должны быть скреплены по порядку нумерации вопросов. Вопросы должны быть пронумерованы в содержании. (Домашнее задания, не соответствующие этим стандартам, будут возвращены с неудовлетворительной оценкой). * Вы можете работать вместе с другим студентом при выполнении домашних заданий, при условии, что каждый из вас работает по отдельному вопросу. | | | | | | | | | |
| **Политика оценки** | **Описание самостоятельной работы** | | | | **Вес** | | **Результаты обучения** | | | |
| Домашние задания  СРО  Экзамены  ИТОГО | | | | 35%  25%  40%  100% | | 1,2,3,4,5,6,7,9,10,11,12,13,14,15  3,4,5,6,7,10,11,12,13,14 | | | |
| Ваша итоговая оценка будет рассчитываться по формуле  Ниже приведены минимальные оценки в процентах:  95% - 100%: А 90% - 94%: А-  85% - 89%: В+ 80% - 84%: В 75% - 79%: В-  70% - 74%: С+ 65% - 69%: С 60% - 64%: С-  55% - 59%: D+ 50% - 54%: D- 0% -49%: F | | | | | | | | | |
| **Политика дисциплины** | Все виды работ необходимо выполнять и защищать в указанные сроки. Соответствующие сроки практических заданий и СРС могут быть продлены в случае смягчающих обстоятельств (таких, как болезнь, экстренные случаи, авария, непредвиденные обстоятельства и т.д.) согласно Академической политике университета. Кроме того, при оценке учитывается активность студентов во время занятий: это могут быть участие студента в дискуссиях, конструктивные вопросы, диалог, и обратная связь на предмет вопроса дисциплины. Преподаватель при выводе итоговой оценки будет принимать во внимание участие каждого студента на занятии. | | | | | | | | | |
| **График дисциплины** | | | | | | | | | | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Недели** | **Название темы** | **Кол-во часов** | **Максималь-**  **ный балл** |
| **Модуль 1. Формирование и механизм функционирования РЦБ** | | | |
| 1. | Лекция 1. Формирование фондового рынка в Республике Казахстан | 2 | - |
| Семинар 1. Формирование фондового рынка в Республике Казахстан | 1 | 7 |
| 2. | Лекция 2. Понятие механизма формирования рынка ценных бумаг | 2 | - |
| Семинар 2. Понятие механизма формирования рынка ценных бумаг | 1 | 7 |
| 3. | Лекция 3. Ценные бумаги и их виды. Классификационные характеристики ценных бумаг | 2 | - |
| Семинар 3. Ценные бумаги и их виды. Классификационные характеристики ценных бумаг | 1 | 7 |
| СРС 1. Региональная инвестиционная политика | 1 | 30 |
| 4. | Лекция 4. Акции и Облигации | 2 | - |
| Семинар 4. Акции и Облигации | 1 | 7 |
| 5. | Лекция 5. Государственные ценные бумаги | 2 | - |
| Семинар 5. Государственные ценные бумаги | 1 | 7 |
| 6. | Лекция 6. Производные ценные бумаги | 2 | - |
| Семинар 6. Производные ценные бумаги | 1 | 7 |
| 7. | Лекция 7. Брокеры, специалисты и другие участники биржевой торговли | 2 | - |
| Семинар 7. Брокеры, специалисты и другие участники биржевой торговли | 1 | 7 |
| СРС 2. А) Производные ценные бумаги.  Б) Брокеры, специалисты и другие участники биржевой торговли | 1 | 21 |
|  | **Итого 1-7 неделя** |  | **100** |
|  | **Midterm examination** |  | **100\*0,1** |
| 8. | Лекция 8. Первичный и вторичный рынок ценных бумаг | 2 | - |
| Семинар 8. Первичный и вторичный рынок ценных бумаг | 1 | 7 |
| **Модуль 2. Инфраструктура РЦБ** | | | |
| 9. | Лекция (Л9) Фондовая биржа, ее структура, задачи и функции | 2 | - |
| Семинар (С9) Фондовая биржа, ее структура, задачи и функции | 1 | 7 |
| 10. | Лекция (Л 10) Фондовые индексы и индикаторы | 2 | - |
| Семинар (С10) Фондовые индексы и индикаторы | 1 | 7 |
| СРС 3. Фондовые индексы и индикаторы | 1 | 15 |
| 11. | Лекция 11. Системы управления рынком ценных бумаг | 2 | - |
| Семинар 11. Системы управления рынком ценных бумаг | 1 | 7 |
| 12. | Лекция 12. Государственное регулирование рынка ценных бумаг и саморегулирование рынка ценных бумаг | 2 | - |
| Семинар 12. Государственное регулирование рынка ценных бумаг и саморегулирование рынка ценных бумаг | 1 | 7 |
| СРС 4. Показатели коммерческой эффективности, показатели бюджетной эффективности. Анализировать этапы оценки риска | 1 | 15 |
| 13. | Лекция 13. Оценка рыночной стоимости акций | 2 | - |
| Семинар 13. Оценка рыночной стоимости акций | 1 | 7 |
| 14-15. | Лекция 14-15. Инвестиционная деятельность на рынке ценных бумаг | 4 | - |
| Семинар 14. Инвестиционная деятельность на рынке ценных бумаг | 2 | 7;7 |
| СРС 5. Измерение доходности краткосрочных финансов х инструментов  Особенности международных инвестиции | 1 | 14 |
|  | **Итого 8-15 неделя** |  | **100** |
|  | **Экзамен** |  | **100** |
|  | **ВСЕГО** |  | **100** |

Декан ВШЭиБ Ермекбаева Б.Ж.

Председатель методбюро ВШЭиБ Даулиева Г.Р.

Зав.кафедрой «Финансы» Арзаева М.Ж.

Лектор, к.э.н.,

ст.преподаватель Алиева Б.М.