**КАЗАХСКИЙ НАЦИОНАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ**

**ИМ. АЛЬ-ФАРАБИ**

**Высшая школа Экономики и бизнеса**

**Кафедра Финансы**

**Методические указания по выполнению СРС дисциплины «Фондовый рынок и операции с ценными бумагами»**

**для студентов специальности 5B051300 - Мировая экономика**

Алматы, 2015

Методические указания по выполнению СРС дисциплины рассмотрена и обсуждена на заседании кафедры «Финансы» ВШЭиБ

Протокол № 34 от \_05/05\_ 2015г.

Заведующий кафедрой

«Финансы», к.э.н, доцент Арзаева М.Ж.

**Методические указания по выполнению CРС дисциплины**

**«Фондовый рынок и операции с ценными бумагами»**

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **курс** | **семестр** | **кредиты** | **Академические часы в неделю** | | | | **Форма контроля** |
| **Контактный час** | **СРСП** | **СРС** | **всего** |
| **Лекции и семинарские занятия** |
| **III** | **6** | **2** | **30** | **30** | **30** | **90** | **экзамен** |

Примечание: Один кредит равен одному академическому часу аудиторной работы студента в неделю (1 кредит = 1 акад. час);

***СРСП***– самостоятельная работа студента с преподавателем

**1. Самостоятельная работа студента с преподавателем (СРСП)**

**Таблица 2**

**Тематическое содержание и объемы самостоятельной работы**

**студента с преподавателем (СРСП)**

**по дисциплине «Фондовый рынок и операции с ценными бумагами»**

Пояснительная записка оформляется в объёме 10-15 листов формата А 4., межстрочный интервал 1,0, шрифт Times New Roman -14,0.

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **№ недели** | | **Структурное содержание занятий по самостоятельной работе студента под руководством преподавателя (СРСП)** | **Формы проведения** | | **Объемы**  **в часах** | | |
| 1 | | 2 | 3 | | 4 | | |
| **Модуль 1. Тенденции развития фондовых рынков** | | | | | | |
| 1 | **Тема 1. Формирование фондового рынка в Республике Казахстан**  Содержание: Процесс формирования фондового рынка в РК, его этапы становления. Необходимость развития РЦБ в РК. Современное состояние фондового рынка в стране. | | | Реферат | | 2 |
| 2 | **Тема 2. Понятие механизма формирования рынка ценных бумаг**  Содержание: Механизм формирования рынка ценных бумаг в РК. Структура РЦБ. Правовые основы деятельности на рынке ценных бумаг. | | | Реферат | | 2 |
| **Модуль 2. Виды ценных бумаг и их классификация** | | | | | | |
| 3 | **Тема 3. Ценные бумаги и их виды. Классификационные характеристики ценных бумаг**  Содержание:Сущность ценных бумаг. Виды ценных бумаг. Классификационные характеристики ценных бумаг. | | | Доклад | | 2 |
| 4 | **Тема 4. Акции**  Содержание: Порядок эмиссии, продажи, отчуждения акций. Обязательные реквизиты акций**.** Стоимостная оценка акций. Доходность акции. Источники выплаты дивидендов по акциям. | | | Доклад | | 2 |
| 5 | **Тема 5. Облигации**  Содержание: Особенности выплаты дохода по облигации путем оплаты купонов и путем начисления процентов. Способы погашения облигаций. Их сравнительная характеристика.  Доходность по облигациям. Источники выплаты доходов по облигациям. | | | Доклад | | 2 |
| 6 | Тема 6. Государственные ценные бумаги  Содержание: Виды государственных ценных бумаг в Республике Казахстан. Объемы и динамика эмиссии государственных ценных бумаг в Казахстане.Доходность государственных ценных бумаг. | | | Доклад | | 2 |
| 7 | **Тема 7. Производные ценные бумаги**  Содержание:Виды производных ценных бумаг. Отличия опционов от фьючерсов. Варранты, их характеристика и виды. Депозитарные расписки. Прочие виды производных ценных бумаг**.** | | | Реферат | | 2 |
| **Модуль 3. Инфраструктура РЦБ** | | | | | | |
| 8 | **Тема 8. Брокеры, специалисты и другие участники биржевой торговли**  Содержание: Профессионалы РЦБ РК. Другие участники биржевой торговли. Организаторы биржевых торгов в РК. | | | Реферат | | 2 |
| 9 | **Тема 9. Первичный и вторичный рынок ценных бумаг**  Содержание: Первичный рынок ценных бумаг в РК. Развитие IPO в РК. Вторичный рынок ценных бумаг в РК и его перспективы развития с учетом современного развития финансового рынка Казахстана. | | | Доклад | | 2 |
| 10 | **Тема 10. Фондовая биржа, ее структура, задачи и функции**  Содержание: Этапы развития фондовой биржи в Казахстане. Современная структура фондовой биржи в РК. Роль фондовой биржи в развитии государства. | | | Доклад | | 2 |
| 11 | **Тема 11**. **Фондовые индексы и индикаторы**  Содержание: Создание фондовых индексов, изучение индикаторов активности ценных бумаг на РЦБ. Казахстанский индекс РЦБ и его влияние на экономику страны. | | | Реферат | | 2 |
| 12 | **Тема 12. Системы управления рынком ценных бумаг**  Содержание:Современная система управления рынком ценных бумаг. Влияние государства на развитие РЦБ РК. Субъекты и объекты системы управления рынком ценных бумаг Казахстана. | | | Доклад | | 2 |
| 13 | **Тема 13. Государственное регулирование рынка ценных бумаг и саморегулирование рынка ценных бумаг**  Содержание: Современное состояние государственного регулирования в РК. Агентство РК по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций. Саморегулирующие организации на казахстанском РЦБ. | | | Реферат | | 2 |
| **Модуль 4. Инвестиционная деятельность на РЦБ** | | | | | | |
| 14 | **Тема 14. Оценка рыночной стоимости акций**  Содержание: Методики комплексных подходов к определению рыночной стоимости акций. Современные подходы к определению рыночной стоимости ценных бумаг. | | | Реферат | | 2 |
| 15 | **Тема 15. Инвестиционная деятельность на рынке ценных бумаг**  Содержание: Инвестиционная деятельность на фондовом рынке РК и его законодательные основы на фондовом рынке РК. Участники инвестиционной деятельности на РЦБ РК. | | | Доклад | | 2 |
| **Итого** | | | | | | **30** |

**Таблица 3 Рекомендуемая литература**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Основная** | | | Автор | | Изд-во | | год | |
| 1 | Гражданский кодекс РК. Общая часть и Особенная часть | | - | | Алматы | | 2004 | |
| 2 | Закон РК «О рынке ценных бумаг» от 2 июля 2003г. Алматы, 2003г. | | - | | Алматы Юрист | | 2003 | |
| 3 | Налоговый кодекс РК | | - | | Алматы Юрист | | 2004 | |
| * 1. 4   4 | Государственная программа развития рынка ценных бумаг в Казахстане на 2005 – 2007 годы. | | - | |  | | 2004 | |
| 5 | Закон «Об акционерных обществах» от 17 мая 2003г. | | - | | «Казахстанская правда» | | 17.05.2003 | |
| 6 | Закон «О листинговых правилах» - с изменениями и дополнениями | | - | | Алматы | | 2002 | |
| 7 | Рынок ценных бумаг в Казахстане | | Адамбекова А.А. | | Алматы | | 2003 | |
| 8 | Рынок ценных бумаг и биржевое дело | | Бердникова Т.Б. | | Москва | | 2000 | |
| 9 | Долговые ценные бумаги и финансовый кризис | | Рахимжанов А.Т. | | Алматы | | 2001 | |
| 10 | Негосударственные долговые ценные бумаги в Республике Казахстан | | Карагусов Ф. | | Алматы | | 2000 | |
| 11 | Формирование фондового рынка | | Сейткасимов Г.С., Ильясов А.А. | | Алматы, Экономика | | 1996 | |
| 12 | Рынок ценных бумаг и его финансовые институты | | Учебное пособие под ред. Таркановского В.С. | | СПб, АО «Комплект» | | 1994 | |
| 13 | Государственные ценные бумаги в экономике Казахстана | | Учебное пособие  Кулекеев Ж.А., Джексенбаева Л.Н. | | Алматы | | 1996 | |
| 14 | Зарубежные фондовые рынки: инструменты, структура, механизм функционирования | | Рубцов Б.Б. | | М | | 1997 | |
| 15 | Анализ рисков операций с облигациями на рынке ценных бумаг | | Дуглас Л.Г. | | М | | 1998 | |
| 16 | Рынок ценных бумаг Казахстана: проблемы формирования и развития | | Кенжегузин М.Б., Дадонов В.Ю. | | Алматы | | 1998 | |
| 17 | Проблемы и перспективы развития фондового рынка Казахстана | | Саханова А.Н., Ж.С. Исингарина Саханова А.Н. | | Алматы | | 2000 | |
| 18 | Ценные бумаги | | Колесников В.И. и др. | | М. «Финансы и статистика» | | 2000 | |
| 19 | Брокеры и регистраторы на рынке ценных бумаг | | Жайлюбаев А.Ж. и др. | | Алматы | | 2000 | |
| 20 | Рынок ценных бумаг и его финансовые институты | | Торкановский В.С. и др. | | Санкт-Петербург | | 1994 | |
| 21 | Рынок ценных бумаг | | Аналитич. журнал | | Алматы | |  | |
| 22 | Фондовый рынок РК | | Информационное агентство финансовых рынков «ИРБИС» | | e-mail: | | info@kise/almaty/kz | |
| 23 | Интернет сайт | |  | |  | | afn@kz | |
| **Дополнительная** | |  | |  | |  | |
| 1 | Операции с ценными бумагами в РК | Карагусов Ф.С. и др. | | Алматы Каржы- Каражат | | 1995 | |
| 2 | Справочник по ценным бумагам в Республике Казахстан | Ануарбеков, Шарипбаев А.А. | | Алматы | | 1995 | |
| 3 | Инвестиционные институты и процессы приватизации | Кулекеев Ж.А., Джексебаева Л.Н. | | КазГАУ  Алматы | | 1996 | |
| 4 | Рынок ценных бумаг: механизм государственного регулирования | Шалгимбаева Г.Н. | | Алматы | | 1996 | |
| 5 | Ценные бумаги и фондовый рынок | Миркин Я.М. | | Москва | | 1995 | |
| 6 | Рынок ценных бумаг | Галанов В.А., Басов А.И. | | Москва | | 2002 | |
| 7 | Деньги, кредит, банки, ценные бумаги | Килячков А.А., Чалдаева Л.А. | | Москва ЮНИТИ | | 2001 | |
| 8 | Республика Казахстан. Трансформация государства. |  | | Доклад миссии Всемирного банка. Т 1,2 | | | |
| 9 | Валютный рынок и валютные операции | Бертаева К.Ж. | | Алматы | | 1999 | |
| 10 | Биржевое дело | Галакова В.А. | | М.: Финансы и статистика | | 2004 | |
| 11 | Базовый курс по рынку ценных бумаг | Радыгин А.Д., Хабарова Л.П., Шапиро Л.П. | | М.: ИНФРА | | 2004 | |
| 12 | Профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг | Павлова Л.Н. | | М.: Бухгалтерский бюллетень | | 2003г. | |
| 13 | Финансы | Под ред. Г.Б. Поляка | | М.: ЮНИТИ | | 2003 | |
| 14 | Международные финансовые, кредитные и валютные отношения. | Фурсов В.Г., Фурсова Т.В. | | Кайнар Алматы, | | 2000 | |
| 15 | Биржа и ценные бумаги. | (словарь) | | М.: Экономика | | 2004 | |
| 16 | Роль государства в экономике. Синергетический подход | Серёгина С.Ф.Серёгина С.Ф. | | М.: Дело и Сервис | | 2002 | |
| 17 |  |  | |  | |  | |
| 18 | Казахстанский фондовый рынок: организация, потенциал, императивы роста. | Шалгимбаев К.Б. | | Алматы.: Каржы-Каражат | | 2000 | |
| 19 | Рынок ценных бумаг Казахстана | Бексултанова А.Ж. | | Алматы Атамура | | 2000 | |
| 20 | Биржа и ценные бумаги. | (словарь) | | М.: Экономика | | 2004 | |
| 21 | Рынок ценных бумаг | Бердникова Т.Б. | | Инфра-М | | 2004 | |
| 22 | Рынок ценных бумаг | Колтынюк Б.А. | | Изд.Михайлова В.А. | | 2004 | |
| 23 | Рынок ценных бумаг России | Миркин Я.М. | | М.: Альпина Паблишер | | 2002 | |
| 24 | Рынок ценных бумаг и биржевое дело | Дегтярева О.И., Коршунова М.Н. | | М.: ЮНИТИ | | 2003 | |
| 25 | Рынок ценных бумаг | Жуков Е.Ф. | | М.: ЮНИТИ | | 2003 | |
| 26 | Рынок ценных бумаг | Галанов В.А.,  Басов А.И. | | М.: Финансы и статистика | | 2004 | |
| 27 | Рынок облигаций. Курс для начинающих. | Перевод с английского языка | | М.: Альпина Паблишер | | 2003 | |
| 28 | Конкуренция и монополия на фондовом рынке | Владиславлев Д.Н. | | Москва. | | 2001 | |