**Әл-Фараби атындағы Қазақ Ұлттық университеті**

**Экономика және бизнес жоғары мектебі**

**«Қаржы» оқу бағдарламасы бойынша**

**силлабус**

**Күзгі семестр 2021-2022 оқу жылы**

**UDFI 6308 «Қаржылық институттардың тәуекел-менеджменті»**

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Пәннің коды** | **Пән атауы** | **Магистранттың өзіндік жұмысы (МӨЖ)** | **Сағат саны** | | | | **Магистранттың оқытушы басшылығымен өзіндік жұмысы (МОӨЖ)** |
| **Дәріс** | **Практ** | **Лаб** | **Кредит саны** |
| **UDFI 6308** | **Исламдық бағалы қағаздар нарығы** | 98 | 15 | 30 | - | 3  (ECTS-5) | 7 |
| **Курс бойынша академиялық ақпарат** | | | | | | | |
| **Оқыту түрі** | **Курстың түрі / сипаты** | **Дәріс түрлері** | **Семинар (практикалық) сабақтарының түрлері** | | | **МӨЖ саны** | **Қорытынды бақылау түрі** |
| Онлайн / аралас | Базалық | Классикалық | пікірталас,  кеңес беру, зерттеу жүргізу | | | 3 | Zoom-да ауызша |
| **Дәріскер** | Бахыт Ерик Бахытулы доктор Ph.D, доцент КазНУ | | | | | | |
| **e-mail** | mustek55@mail.ru | | | | | | |
| **Байланыс телефоны** | 87018222274 | | | | | | |
| **Семинар сабағын жүргізүші** | Бахыт Ерик Бахытулы доктор Ph.D, доцент КазНУ | | | | | | |
| **e-mail** | mustek55@mail.ru | | | | | | |
| **Байланыс телефоны** | 87018222274 | | | | | | |
| **Академиялық курс презентациясы** | | | | | | | |
| **Академиялық курс презентациясы** | | | | | | | |
| **Курстың мақсаты:** | | **Оқытудан күтілетін нәтижелер (ОН)** | | **Жетістік индикаторлары (ЖИ)** | | | |
| Студенттерді қаржылық институттардың қызметін басқару саласы бойынша толық біліммен қамтамасыз ету, сондай-ақ пән бойынша ғылыми және практикалық  білім жүйесін қалыптастыру. | | Пәнді оқу нәтижесінде білім алушы келесілерге қабілетті болады:  **ОН 1 –** Қаржылық институттардың қызмет етуінің негізгі заңдылықтары мен үрдістерін түсіндіру, сондай-ақ қаржылық институттардың қызметінің мазмұны мен жіктелінуін анықтау  **ОН 2 –** Қаржылық институттардың қызмет етуіндегі ерекшеліктерін айқындау  **ОН 3 –** Халықаралық тәжірибелерге сүйене отырып қаржылық институттардың қызметін басқаруды оңтайландыру шараларын қарастыру  **ОН 4 –** Қаржылық институттардың қызметін басқару механизмін, оны бағалаудың мәліметтер көзі мен ақпараттарын жинақтау  **ОН 5 –** Қаржылық институттардың қызметін басқаруда халықаралық тәжірибедегі стандарттарды енгізудің өзектілігін анықтау  **ОН 6** – Отандық және шетелдік қаржылық институттардың қызметін басқаруды жүзеге асу жолдары мен перспективаларын бағалау | | Пәнді оқу процесінде білім алушы келесі жетістіктерге ие болу керек:  ЖИ 1.1. – Қаржылық институттардың қызметінің теориялық негіздерін білу;  ЖИ 1.2. – Қаржылық институттардың қызметін басқару жүйесінің дәстүрлі нарықтық жүйеден негізгі айырмашылығын түсіну;  ЖИ 1.3. – Заманауи тәжірибедегі қаржылық институттардың қызметінің ерекшелігін түсіну.  ЖИ 1.3. – Қаржылық институттардың қызметін басқаруды мемлекеттік реттеу жүйесіндегі рөлін және заңнамалық қамтамасыз етілуін меңгеру;  ЖИ 2.1. – Қазіргі таңдағы еліміздің экономикасындағы қаржылық институттардың қызметін басқару жүйесінің мәселелерін анықтау және оларды шешу бойынша ұсыныстар жасауға бейімдеу;  ЖИ 2.2. – Қаржылық институттардың қызметінің функциялар мен міндеттерді оқу жағдайында талдау және оның шешу бағыттарын ұсыну;  ЖИ 2.3. – Қаржылық институттардың қызметін басқару аясындағы мәселелерді және негізгі ұғымдарды, тәуекелдердің түрлерінің теориялары бойынша білімдерін практикалық қызметте пайдалана білу;  ЖИ 3.1. – Қаржылық институттардың қызметін басқаруға байланысты жүргізетін операцияларын қолдану техникаларын игеру;  ЖИ 3.2. – Қаржылық институттардың қызметін басқаруға әсер ету шараларының қолданылуын зерттеу;  ЖИ 4.1. – Қаржылық институттардағы тәуекелдерді басқарудағы негізгі қызметтерді анықтауды тұжырымдау;  ЖИ 4.2. – Халықаралық тәжірибелерге сүйене отырып, қаржылық институттардың қызметін басқарудың өзгерістеріне талдау жасау;  ЖИ 5.1. – Қаржылық институттардың қызметін басқаруды реттеу мен қадағалаудың жаһандық жүйелерін сипаттау;  ЖИ 5.2. – Қаржылық институттардың қызметін басқаруды негізгі бағыттары мен міндеттерінің ерекшеліктерін ашу;  ЖИ 5.3. – Қолданыстағы жаһандық реттеу жүйелеріне (дәстүрлі жүйелер, аралас жүйелер және дамытушы унитарлық жүйелер) кешенді талдау жүргізу;  ЖИ 6.1. – Шетелдерде және Қазақстанда қаржылық институттардың қызметін жүзеге асыруға қатысты талдамалық құралдарды қолдану;  ЖИ 6.2. – Қаржылық институттардың қызметін жүзеге асыруға қатысты талдамалық құралдарды қолдана білу;  ЖИ 6.3. – Қаржылық институттардың қызметін басқаруды одан әрі жүзеге асыра отырып, дамыту бағыттарын болжаай алу. | | | |

|  |  |
| --- | --- |
| **Пререквизиттер** | Экономикалық теория, Қаржы, Ақша, несие, банктер, Сақтандыру және т.б. |
| **Постреквизиттер** | Банк ісі, Қаржы нарығы және делдалдар, Инвестицияларды қаржыландыру мен несиелеу, Инвестициялық жобаны талдау, Қаржы менеджменті, Корпоративтік қаржы және т.б. |
| **Әдебиет және ресурстар** | **Әдебиеттер тізімі:**  1. Fabozzi F.J., Mann S.V. Securities Finance. John Wiley & Sons, Inc, 2010.  2. Ranald Michie. The global securities market. A history. Oxford University Press, USA, 2009  3. George G. Kaufman. Financial Institutions and Markets, 2010  4.Дэвид С. Кидуэлл, Ричард Л. Петерсон, Дэвид У. Блэкуэлл. Финансовые институты, рынки и деньги. – Спб., Питер, 2009 г.  5. CECCHETTI. MONEY, BANKING AND FINANCIAL MARKETS - GLOBAL EDITION, 2011  6. «Ақша айналы, қаржы және несие». Смагулова Р.У., Мадыханова К.А., Сатыбалдиева Ж.Ш., Тусаева А.К. Оқу құралы. Алматы, 2008.  **Қосымша:**  1. SAUNDERS. FINANCIAL MARKETS AND INSTITUTIONS, 2012  2. Jesper Blomberg. Marketing Shares, Sharing Markets, 2011  3. Sharpe W. "Investment". – Moscow: "INFRA-M", 2007  4. David Loader. Understanding the Markets. Butterworth-Heinemann, 2009  5.«Бағалы қағаздар нарығы» Көшенова Б.А. Оқу құралы. Алматы, 2010.  6.Дэвид С. Кидуэлл, Ричард Л.Петерсон., Дэвид У.Блэкуэлл. Финансовые институты, рынки и деньги. – СПБ,. Питер, 2000;  7.Деньги. Кредит. Банки. Ценные бумаги. Практикум. Е.Жуковтың жетекшілігімен. – М. Юнити, 2001;  8.Долан Э.Дж., Кэмпбелл Колин Д., Кэмпбэл Розмари Дж. Деньги, банковское дело и денежно-кредитная политика. – М., 1991;  9.Диана Мак-Нотон. Банки на развивающих рынках. 2-томда. - Әлемдік банк институты. 1998;  10.Деньги. Кредит. Банки. Оқулық. В.В. Иванов, Б.И.Соковол. – М. Проспект – 2006.  **Интернет ресурстар:**   1. [http://www.bankir.ru/](http://www.bankir.ru/" \t "_blank) 2. <http://ecsocman.hse.ru/text/22889391/> 3. https://kapital.kz/info/ 4. <https://kursiv.kz/news/obschestvo> 5. <https://www.kase.kz> 6. www.finreg.kz |
| **Университеттік моральдық-этикалық құндылықтар шеңберіндегі курстың академиялық саясаты** | **Академиялық тәртіп ережелері:**  Барлық білім алушылар ЖООК-қа тіркелу қажет. Онлайн курс модульдерін өту мерзімі пәнді оқыту кестесіне сәйкес мүлтіксіз сақталуы тиіс.  **НАЗАР АУДАРЫҢЫЗ!** Дедлайндарды сақтамау баллдардың жоғалуына әкеледі! Әрбір тапсырманың дедлайны оқу курсының мазмұнын жүзеге асыру күнтізбесінде (кестесінде), сондай-ақ ЖООК-та көрсетілген.  **Академиялық құндылықтар:**   * Практикалық / зертханалық сабақтар, МӨЖ өзіндік, шығармашылық сипатта болуы керек. * Бақылаудың барлық кезеңінде плагиатқа, жалған ақпаратқа, көшіруге тыйым салынады. * Мүмкіндігі шектеулі магистанттар [aijan1910@gmail.com](mailto:aijan1910@gmail.com) е-мекенжайы бойынша консультациялық көмек ала алады. |
| **Бағалау және аттестаттау саясаты** | **Критериалды бағалау:** дескрипторларға сәйкес оқыту нәтижелерін бағалау (аралық бақылау мен емтихандарда құзыреттіліктің қалыптасуын тексеру).  **Жиынтық бағалау:** аудиториядағы (вебинардағы) жұмыстың белсенділігін бағалау; орындалған тапсырманы бағалау. |
| **15.2 Қорытынды бағаны есептеу**  Пән бойынша қорытынды бағаның пайыздық құрылымы келесі формуламен есептеледі:  И% = АБ1+МТ+АБ2 х 0,6 + ҚБ х 0,4  2  мұнда:  АБ – аралық бақылау;  МТ – аралық емтихан (мидтерм);  ҚБ – қорытынды бақылау (емтихан).  Білім алушылардың балдық-рейтингтік оқу жетістіктерінің бағасын дәстүрлік баға шкаласына ауыстыру   |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | | Әріптік жүйе бойынша баға | Сандық эквивалент | Баллдары (%-дық көрсеткіші) | Дәстүрлі жүйе бойынша баға | | А | 4,0 | 95-100 | Өте жақсы | | А- | 3,67 | 90-94 | | В+ | 3,33 | 85-89 | Жақсы | | В | 3,0 | 80-84 | | В- | 2,67 | 75-79 | | С+ | 2,33 | 70-74 | | С | 2,0 | 65-69 | Қанағаттанарлық | | С- | 1,67 | 60-64 | | D+ | 1,33 | 55-59 | | D- | 1,0 | 50-54 | | FX | 0,5 | 25-49 | Қанағаттанарлықсыз | | F | 0 | 0-24 | | |

**ОҚУ КУРСЫНЫҢ МАЗМҰНЫН ЖҮЗЕГЕ АСЫРУ КҮНТІЗБЕСІ (кестесі)**

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Апта / модуль | Тақырып атауы | ОН | ЖИ | Сағат саны | Ең жоғары балл | Білімді бағалау формасы | Сабақты өткізу түрі / платформа |
| **Модуль І** | | | | | | | |
| 1 | **Д.** Бағалы қағаздардың экономикалық мәні. | ОН 1 | ЖИ 1.1. ЖИ 1.2. | 1 |  | - сұрақтарды  топта талқылау | Zoom-да бейнедәріс |
| **ПС** Бағалы қағаздардың экономикалық мәні мен маңыздылығын айқындау | ОН 1 | ЖИ 1.1. ЖИ 1.2. | 2 | 14 | - тақырып мәселелерін талқылау | Zoom-да вебинар |
| 2 | **Д.** ҚР қор нарығын қалыптастыру. | ОН 1 | ЖИ 1.1. ЖИ 1.2. | 1 |  | - сұрақтарды топта талқылау | Асинхронды |
| **ПС** ҚР қор нарығын қалыптастыру, заңнамалық негізін қарастыру | ОН 1 | ЖИ 1.1. ЖИ 1.2. | 2 | 14 | - тақырып мәселелерін талқылау | Асинхронды |
| 3 | **Д.** Акциялар. | ОН 1 | ЖИ 1.2.  ЖИ 1.3. | 1 |  | - сұрақтарды топта талқылау | Zoom-да бейнедәріс |
| **ПС** Акциялар. қызметтерінің жүзеге асуын анықтау | ОН 1 | ЖИ 1.2.  ЖИ 1.3. | 2 | 14 | - орындалған тапсырма-лардың нәтижелерін талқылау |  |
| **МОӨЖ 1. МӨЖ 1**  Қаржылық институттардың қызметін реттеу органдарының қызметтеріне зерттеу жасау бойынша кеңес беру, орындалуына бақылау жасау және талқылау |  |  |  |  | - кеңес беру, орындалуына бақылау жасау және талқылау | Zoom-да вебинар |
| 4 | **Д.** Облигациялар | ОН 2 | ЖИ 2.1. ЖИ 2.2. | 1 |  | - сұрақтарды  топта талқылау | Асинхронды |
| **ПС** Облигациялар, даму проблемаларын қарастыру | ОН 2 | ЖИ 2.1. ЖИ 2.2. | 2 | 14 | - тақырып мәселелерін талқылау | Асинхронды |
| 5 | **Д.** Туынды бағалы қағаздар. | ОН 2 | ЖИ 2.1. ЖИ 2.2. | 1 |  | - сұрақтарды топта талқылау | Zoom-да бейнедәріс |
| **ПС** Туынды бағалы қағаздар., ерекшліктерін анықтау | ОН 2 | ЖИ 2.1. ЖИ 2.2. | 2 | 14 | - тақырып мәселелерін талқылау |  |
| **МОӨЖ 2. МӨЖ 1** тапсырмаларын қабылдау және бағалау |  |  |  | 30 | - жоба орындау және нәтиже бойынша презентация | Zoom-да вебинар |
|  | **АБ 1** |  |  |  | 100 |  |  |
| **Модуль ІІ** | | | | | | | |
| 6 | **Д.** Мемлекеттік бағалы қағаздар | ОН 2 | ЖИ 2.2.  ЖИ 2.3. | 1 |  | - сұрақтарды  топта талқылау | Zoom-да бейнедәріс |
| **ПС** Мемлекеттік бағалы қағаздар ерекшеліктерін анықтау | ОН 2 | ЖИ 2.2.  ЖИ 2.3. | 2 | 14 | - тақырып мәселелерін талқылау | Zoom-да вебинар |
| 7 | **Д.** Бағалы қағаздарды шығару және олардың айналысы | ОН 3 | ЖИ 3.1. ЖИ 3.2. | 1 |  | - сұрақтарды топта талқылау | Асинхронды |
| **ПС** Бағалы қағаздарды шығару және олардың айналысы, ерекшеліктерін айқындау | ОН 3 | ЖИ 3.1. ЖИ 3.2. | 2 | 14 | - тақырып мәселелерін талқылау | Асинхронды |
| **МОӨЖ 3. МӨЖ 2** Бағалы қағаздарды шығару және олардың айналысы,  бойынша кеңес беру, орындалуына бақылау жасау және талқылау |  |  |  |  | - кеңес беру, орындалуына бақылау жасау және талқылау | Zoom-да вебинар |
| 8 | **Д.** Бағалы қағаздардың бастапқы және қайталама нарығы | ОН 3 | ЖИ 3.1. ЖИ 3.2. | 1 |  | - сұрақтарды топта талқылау | Zoom-да бейнедәріс |
| **ПС** Бағалы қағаздардың бастапқы және қайталама нарығы, ерекшеліктерін анықтау | ОН 3 | ЖИ 3.1. ЖИ 3.2. | 2 | 14 | - орындалған тапсырма-лардың нәтижелерін талқылау | Zoom-да вебинар |
| **МОӨЖ 4. МӨЖ 2**  орындау бойынша кеңес беру, орындалуына бақылау жасау және талқылау |  |  |  |  | - кеңес беру, орындалуына бақылау жасау және талқылау | Zoom-да вебинар |
| 9 | **Д.** Қор биржасы | ОН 4 | ЖИ 4.1. ЖИ 4.2. | 1 |  | - сұрақтарды топта талқылау | Асинхронды |
| **ПС** Қор биржасы, қызметін ету ерекшеліктерін анықтау | ОН 4 | ЖИ 4.1. ЖИ 4.2. | 2 | 14 | - тақырып мәселелерін талқылау | Асинхронды |
| 10 | **Д.** Бағалы қағаздар портфелін құру және басқару | ОН 4 | ЖИ 4.1. ЖИ 4.2. | 1 |  | - сұрақтарды топта талқылау | Zoom-да бейнедәріс |
| **ПС** Бағалы қағаздар нарығының субъектілерінің қызметтерін айқындау | ОН 4 | ЖИ 1.1. ЖИ 1.2. | 2 | 14 | - тақырып мәселелерін талқылау | Zoom-да вебинар |
| **МОӨЖ 5. МӨЖ 2** тапсырмаларын қабылдау және бағалау |  |  |  | 30 | - жоба орындау және нәтиже бойынша презентация | Zoom-да вебинар |
| **МТ (Midterm Exam) ауызша** | | | | 100 |  |  |
| **Модуль ІІІ** | | | | | | | |
| 11 | **Д.** Бағалы қағаздар нарығын реттеу | ОН 5 | ЖИ 5.1. ЖИ 5.2. | 1 |  | - сұрақтарды топта талқылау | Zoom-да бейнедәріс |
| **ПС** Бағалы қағаздар нарығын реттеу, қызмет ету ерекшелігін анықтау | ОН 5 | ЖИ 5.1. ЖИ 5.2. | 2 | 14 | - тақырып мәселелерін талқылау | Zoom-да вебинар |
| 12 | **Д.** Бағалы қағаздар нарығының қатысушылары және олардың атқаратын қызметтері. | ОН 5 | ЖИ 5.1. ЖИ 5.2. | 1 |  | - сұрақтарды топта талқылау | Асинхронды |
| **ПС** Бағалы қағаздар нарығының қатысушылары және олардың атқаратын қызметтері, қызметін айқындау | ОН 5 | ЖИ 5.1. ЖИ 5.2. | 2 | 14 | - орындалған тапсырма-лардың нәтижелерін талқылау | Асинхронды |
| **МОӨЖ 6. МӨЖ 3**  орындау бойынша кеңес беру, орындалуына бақылау жасау және талқылау |  |  |  |  | - кеңес беру, орындалуына бақылау жасау және талқылау | Zoom-да вебинар |
| 13 | **Д.** Бағалы қағаздар нарығындағы есептер және операциялар | ОН 6 | ЖИ 6.1. ЖИ 6.2. | 1 |  | - сұрақтарды топта талқылау | Zoom-да бейнедәріс |
| **ПС** Бағалы қағаздар нарығындағы есептер және операциялар, ерекшеліктерін анықтау | ОН 6 | ЖИ 6.1. ЖИ 6.2. | 2 | 14 | - орындалған тапсырмаларды талқылау | Zoom-да вебинар |
| 14 | **Д.** Листингтік қызмет. | ОН 6 | ЖИ 6.1. ЖИ 6.2. | 1 |  | - сұрақтарды топта талқылау | Асинхронды |
| **ПС** Листингтік қызмет, қызметтерін анықтау | ОН 6 | ЖИ 6.1. ЖИ 6.2. | 2 | 14 | - тақырып мәселелерін талқылау | Асинхронды |
| 15 | **Д.** Бағалы қағаздар нарығын ақпараттандыру | ОН 6 | ЖИ 6.2.  ЖИ 6.3. | 1 |  | - сұрақтарды топта талқылау | Zoom-да бейнедәріс |
| **ПС** Бағалы қағаздар нарығын ақпараттандыру, анықтау | ОН 6 | ЖИ 6.2.  ЖИ 6.3. | 2 | 14 | - орындалған тапсырма-лардың нәтижелерін талқылау | Zoom-да вебинар |
| **МОӨЖ 7. МӨЖ 3**  тапсырмаларын қабылдау және бағалау |  |  |  | 30 | - жоба орындау және нәтиже бойынша презентация | Zoom-да вебинар |
|  | **АБ2** |  |  |  | 100 |  |  |