**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 бумагиСодержание: 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 пособиеКулекеев 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. | КазГАУАлматы | 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 |