

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Узунов Федор Владимирович

Должность: Ректор

Дата подписания: 13.02.2024 11:49:32

Уникальный программный ключ:

fd935d10451b860e912264c0378f8446052164b607f94388008c38877c61d4ff5

**АВТНОМНАЯ НЕКОММЕРЧЕСКАЯ ОРГАНИЗАЦИЯ
«ОБРАЗОВАТЕЛЬНАЯ ОРГАНИЗАЦИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ»
«УНИВЕРСИТЕТ ЭКОНОМИКИ И УПРАВЛЕНИЯ»**

Факультет экономики, управления и юриспруденции

Кафедра «Финансы, учет и аудит»

УТВЕРЖДАЮ

Проректор по учебно-методической работе

Е.В. Бебешко

«31» марта 2023 г.



Рабочая программа дисциплины

Операции на финансовом рынке

Направление подготовки

38.04.08 Финансы и кредит

Профиль

Специалист по финансовому консультированию

Квалификация выпускника

Магистр

Для всех

форм обучения

Симферополь 2023

Индекс дисциплины по учебному плану	Наименование дисциплины
ФТД.01	ОПЕРАЦИИ на финансовом рынке
Цель изучения дисциплины	формирование теоретических основ и прикладных знаний об операциях на финансовом рынке в современной экономике, в осуществлении финансирования хозяйства и государства.
Место дисциплины в структуре ОПОП	Дисциплина относится к факультативным дисциплинам учебного плана.
Содержание дисциплины	<p>Тема 1. Финансовый рынок: сущность, функции и роль в экономике</p> <p>Тема 2. Операции на финансовых рынках.</p> <p>Тема 3. Эмиссия ценных бумаг.</p> <p>Тема 4. Кассовые и срочные сделки.</p> <p>Тема 5. Инвестиционный портфель. Принципы формирования инвестиционного портфеля ценных бумаг. Пассивные и активные стратегии инвесторов</p> <p>Тема 6. Валютные сделки. Сделки своп, спот и форвардные сделки.</p>
Общая трудоемкость дисциплины	Общая трудоемкость дисциплины составляет 2 зачетных единицы, 72 часа
Форма промежуточной аттестации	Зачет

Содержание

1. Цель и перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы	5
2. Место дисциплины в структуре ОПОП магистратуры	5
3. Объем дисциплины в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам занятий) и на самостоятельную работу обучающихся	5
4. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий	6
5. Контроль качества освоения дисциплины	11
6. Учебно-методическое обеспечение дисциплины	11
7. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины	11
8. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины	12
9. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины	12
10. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости)	13
11. Описание материально-технического обеспечения, необходимого для осуществления образовательного процесса по дисциплине	13
Приложение к РПД	14

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Целью изучения дисциплины формирование теоретических основ и прикладных знаний об операциях на финансовом рынке в современной экономике, в осуществлении финансирования хозяйства и государства.

2. Место дисциплины в структуре ОПОП магистратуры

Дисциплина ФТД.01 «Операции на финансовом рынке» относится к части «Факультативные дисциплины» программы магистратуры по направлению подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит». Дисциплина «Операции с ценными бумагами» изучается обучающимися очной формы обучения во 3 семестре, заочной формы обучения – в 3 семестре.

Дисциплина основывается на знании следующих дисциплин финансового характера: «Финансы», «Деньги, кредит, банки», «Финансовый менеджмент», «Государственные и муниципальные финансы», «Банковское дело», «Корпоративные финансы», «Инвестирование», «Рынок ценных бумаг», «Страховое дело», «Финансовый анализ».

3. Объем дисциплины в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам занятий) и на самостоятельную работу обучающихся

Общая трудоемкость (объем) дисциплины составляет 2 зачетных единицы (ЗЕ), 72 академических часа.

3.1. Объем дисциплины по видам учебных занятий (в часах)

Для очной формы обучения

Общая трудоёмкость дисциплины составляет 2 зачётных единиц 72 часа

Объём дисциплины	Всего часов
Общая трудоемкость дисциплины	72
Контрактная работа	30
Аудиторная работа (всего):	30
Лекции	20
Семинары, практические занятия	10
Самостоятельная работа обучающихся (всего)	42
Зачет	+

Для заочной формы обучения

Общая трудоёмкость дисциплины составляет 2 зачётных единицы 72 часа

Объём дисциплины	Всего часов
Общая трудоемкость дисциплины	72
Контрактная работа	10
Аудиторная работа (всего):	6

Лекции	4
Семинары, практические занятия	2
Самостоятельная работа обучающихся (всего)	62
Зачет	4

4. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий

**4.1 Разделы дисциплины и трудоемкость по видам учебных занятий
(в академических часах)**

№ те мы	Наименование темы	Всего		Количество часов					
		ОФО	ОЗФО	Контактная работа (аудиторная работа)				Внеаудит. работа	
				Лекции		Практическ.		Самост. работа	
				ОФО	ОЗФО	ОФО	ОЗФО	ОФО	ОЗФО
1	Тема 1. Финансовый рынок: сущность, функции и роль в экономике	9	6	3		2		4	6
2	Тема 2. Операции на финансовых рынках.	13	14	3	1	2	1	8	12
3	Тема 3. Эмиссия ценных бумаг.	13	14	3	1	2	1	8	12
4	Тема 4. Кассовые и срочные сделки.	9	8	3				6	8
5	Тема 5. Инвестиционный портфель. Принципы формирования инвестиционного портфеля ценных бумаг. Пассивные и активные стратегии инвесторов	14	13	4	1	2		8	12
6	Тема 6. Валютные сделки. Сделки своп, спот и форвардные сделки.	14	13	4	1	2		8	12
7	Всего по дисциплине	72	68	20	4	10	2	42	62
8	Зачет	+	4						
9	ИТОГО	72	72						

4.2 Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам)

Тема 1. Финансовый рынок: сущность, функции и роль в экономике

Понятие, структура и участники финансового рынка. История развития финансового рынка. Тенденции развития финансового рынка. Инновации на финансовом рынке. Финансовый инжиниринг. Интернационализация хозяйственной жизни и глобализация финансовых рынков

Тема 2. Операции на финансовых рынках.

Эмиссия ценных бумаг; - кассовые и срочные сделки; - арбитражные сделки; - кассовые и срочные сделки; - пассивные и активные стратегии инвесторов; - валютные сделки;

Тема 3. Эмиссия ценных бумаг.

Понятие первичного рынка ценных бумаг, его организация, IPO. Эмитенты эмиссионных ценных бумаг. Конструирование выпуска ценных бумаг, его этапы. Финансовый инжиниринг и финансовые инженеры. Понятие и этапы эмиссии эмиссионных ценных бумаг. Особенности публичного размещения ценных бумаг. Адерайтинг ценных бумаг и его виды. Функции андеррайтера, его риски. Андерайтинг на российском рынке ценных бумаг.

Тема 4. Кассовые и срочные сделки.

Понятия Кассовые и срочные сделки. финансовые посредники, финансовые инструменты, векселя, чеки, долговые расписки, акции, облигации, кредитные карточки, залладные, страховые полисы, кредитные организации, инвестиционные фонды, доверительные общества.

Тема 5. Инвестиционный портфель. Принципы формирования инвестиционного портфеля ценных бумаг. Пассивные и активные стратегии инвесторов.

ценные бумаги, облигация, государственный займ, договор займа, облигации с фиксированным купоном, облигации с плавающим (переменным) купоном, индексируемые облигации, бескупонные облигации.

Тема 6. Валютные сделки. Сделки своп, спот и форвардные сделки.

валютные операции, клиринг, товарные кредиты, валютные кредиты, конверсионные операции, валютные ценности, иностранная валюта, ценные бумаги в иностранной валюте, драгоценные металлы, валютная котировка, валютный курс, межбанковский валютный рынок.

4.3. Темы практических занятий

Тема 1. Финансовый рынок: сущность, функции и роль в экономике				
Сущность финансового рынка, принципы и функции. Характеристика звеньев структуры и инфраструктуры финансового рынка. Инструменты финансового рынка и их классификация.				
Тема 2. Операции на финансовых рынках.				
Лизинговые, факторинговые, форфейтинговые операции. Срочные операции кредитного рынка. Операции репо и обратного репо. Нормативно - правовое регулирование операций на кредитном рынке.				
Тема 3. Эмиссия ценных бумаг.				
Понятие и процедура эмиссии. Стандарты эмиссии ценных бумаг. Регистрация выпуска ценных эмиссионных бумаг. Размещение ценных бумаг				
Тема 4. Кассовые и срочные сделки.				
Вексель. права. вексельного Обращение вексельному Доходность векселей.	Вексельное Женевская обращения. векселей. обязательству.	законодательство. вексельная Простой Индоссамент. Стоимостная	Системы и переводный Ответственность оценка	вексельного регулирование вексель. по векселя.
Тема 5. Инвестиционный портфель. Принципы формирования инвестиционного портфеля ценных бумаг. Пассивные и активные стратегии инвесторов				
Инвестирование в ценные бумаги: основные понятия, риски, расчет доходности. Систематический и несистематический риск. Методы управления инвестиционным риском. Инвестиционный портфель. Виды инвестиционных портфелей и методы управления ими.				
Тема 6. Валютные сделки. Сделки своп, спот и форвардные сделки.				
Понятие валютных операций				
Виды лицензий коммерческих банков для осуществления валютных операций				
Валютный контроль Виды валютных котировок				
Кредитные организации как участники валютного рынка				

4.4 Содержание самостоятельной работы

<p>Тема 1. Финансовый рынок: сущность, функции и роль в экономике Понятие, структура и участники финансового рынка. История развития финансового рынка. Тенденции развития финансового рынка. Инновации на финансовом рынке. Финансовый инжиниринг. Интернационализация хозяйственной жизни и глобализация финансовых рынков</p>
<p>Тема 2. Операции на финансовых рынках. Рынок ценных бумаг, его функции в экономике. Классификация рынка ценных бумаг. Международный. Национальный и региональный рынки ценных бумаг. Мировой рынок ценных бумаг. Развитые и формирующиеся рынки ценных бумаг. Мировые финансовые центры.</p>
<p>Тема 3. Эмиссия ценных бумаг. Развитие отечественного рынка ценных бумаг Основные подходы к определению понятия ценных бумаг Характеристика и свойства ценных бумаг Принципы классификации ценных бумаг Государственные ценные бумаги Корпоративные и производные ценные бумаги.</p>
<p>Тема 4. Кассовые и срочные сделки. Коммерческие бумаги. Депозитные и сберегательные сертификаты. Товарораспорядительные ценные бумаги. Складские свидетельства. Коносаменты. Ипотечные ценные бумаги. Закладные. Облигации с ипотечным покрытием. Ипотечные сертификаты участия. Евробумаги. Рынок евробумаг. Рейтинг ценных бумаг и эмитентов. Участники рынка ценных бумаг (инвесторы, эмитенты, посредники). Первичный и вторичный рынок ценных бумаг</p>
<p>Тема 5. Инвестиционный портфель. Принципы формирования инвестиционного портфеля ценных бумаг. Пассивные и активные стратегии инвесторов Управляющая компания и институциональные инвесторы (инвестиционные фонды, паевые инвестиционные фонды, пенсионные фонды). Гипотеза эффективного рынка. Теория Марковица. Модель САРМ. Модель Шарпа. Фундаментальный и технический анализ.</p>
<p>Тема 6. Валютные сделки. Сделки своп, спот и форвардные сделки. Государственное регулирование финансов рынков, основные принципы его организации. Модели регулирования финансовых рынков (отраслевой, функциональный, мегарегулятор). Функции Банка России как мегарегулятора на финансовых рынках. Саморегулирование финансового рынка. СРО на основных сегментах финансового рынка. Глобализация финансовых рынков и основные направления создания мировой системы регулирования.</p>

5. Контроль качества освоения дисциплины

Текущий контроль и промежуточная аттестация осуществляются в соответствии с «Положением о текущем контроле успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся в Автономной некоммерческой организации «Образовательная организация высшего образования» «Университет экономики и управления».

Вид промежуточной аттестации – зачет. Форма проведения промежуточной аттестации – письменный зачет.

Фонд оценочных средств по дисциплине приведен в приложении к РПД.

6. Учебно-методическое обеспечение дисциплины

7. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

а) основная учебная литература:

1. Гасанов, О. С. Депозитные операции российских банков: состояние и направления совершенствования : монография / О. С. Гасанов. — Саратов : Вузовское образование, 2019. — 77 с. — ISBN 978-5-4487-0444-4. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/78607.html>

2. Синиченко, О. А. Банковское дело. Организация деятельности коммерческого банка

: учебное пособие / О. А. Синиченко. — Таганрог : Таганрогский институт управления и экономики, 2020. — 156 с. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/108073.html> - DOI: <https://doi.org/10.23682/108073>

б) дополнительная учебная литература:

1. Банки и небанковские кредитные организации и их операции : учебник для студентов вузов, обучающихся по направлению «Экономика» / Е. Ф. Жуков, Н. Д. Эриашвили, Л. Т. Литвиненко [и др.] ; под редакцией Е. Ф. Жуков, Н. Д. Эриашвили. — 4-е изд. — Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2019. — 559 с. — ISBN 978-5-238-02239-0. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/74879.html>

2. Банки и небанковские кредитные организации и их операции : учебник для студентов вузов, обучающихся по направлению «Экономика» / Е. Ф. Жуков, Н. Д. Эриашвили, Л. Т. Литвиненко [и др.] ; под редакцией Е. Ф. Жуков, Н. Д. Эриашвили. — 4-е изд. — Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2020. — 559 с. — ISBN 978-5-238-02239-0. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/74879.html>

3. Масленченков, Ю. С. Финансовый менеджмент банка : учебное пособие для вузов / Ю. С. Масленченков. — Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2021. — 399 с. — ISBN 5-238-00576-8. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/71207.html>

8. Перечень ресурсов Интернет, необходимых для освоения дисциплины «Финансовый анализ (продвинутый уровень)»

1. Сайт Министерства финансов РФ [Электронный ресурс]. – Режим доступа: [Сайт журнала www.minfin.ru](http://www.minfin.ru) ла «Эксперт» [Электронный ресурс]. – Режим доступа: www.expert.ru
2. «Галерея экономистов» (Материалы об экономистах и направлениях экономической теории) [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://gallery.economicus.ru>
3. Официальный интернет-портал правовой информации РФ [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://pravo.gov.ru/>
4. Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики РФ (Росстат) [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <https://rosstat.gov.ru/>
5. Официальный сайт территориального органа Федеральной службы государственной статистики по Республике Крым (Крымстат) [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <https://crimea.gks.ru/>
6. Информационно-правовой портал «Гарант»: официальный сайт. – URL: <http://www.garant.ru> – Текст: электронный.
7. Цифровой образовательный ресурс «IPRsmart»: официальный сайт. – URL: <http://www.iprbookshop.ru/> – Текст: электронный.

8. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

При проведении лекций, семинарских (практических) занятий, самостоятельной работе обучающихся применяются интерактивные формы проведения занятий с целью погружения обучающихся в реальную атмосферу профессионального сотрудничества по разрешению проблем, оптимальной выработки навыков и качеств будущего специалиста. Интерактивные формы проведения занятий предполагают обучение в сотрудничестве. Все участники образовательного процесса (преподаватель и обучающиеся) взаимодействуют друг с другом, обмениваются информацией, совместно решают проблемы, моделируют ситуацию.

В учебном процессе используются интерактивные формы занятий:

- творческое задание. Выполнение творческих заданий требует от обучающегося воспроизведение полученной ранее информации в форме, определяемой преподавателем, и требующей творческого подхода;

- групповое обсуждение. Групповое обсуждение кого-либо вопроса направлено на достижение лучшего взаимопонимания и способствует лучшему усвоению изучаемого материала.

В ходе освоения дисциплины при проведении контактных занятий используются следующие формы обучения, способствующие формированию компетенций: лекции-дискуссии; кейс-метод; решение задач; ситуационный анализ; обсуждение рефератов и докладов; разработка групповых проектов.

10. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости)

В процессе лекционных и практических занятий используется следующее программное обеспечение:

*программы, обеспечивающие доступ в сеть «Интернет» (например, «Google chrome»);

*программы, демонстрации видео материалов (например, проигрыватель «Windows Media Player»);

*программы для демонстрации и создания презентаций (например, «Microsoft PowerPoint»).

11. Описание материально-технического обеспечения, необходимого для осуществления образовательного процесса по дисциплине

Для преподавания дисциплины не требуется специальных материально-технических средств (лабораторного оборудования, компьютерных классов и т.п.). Однако во время лекционных занятий, которые проводятся в большой аудитории, использовать проектор для демонстрации слайдов, схем, таблиц и прочего материала, мультимедийные проекторы Epson, Benq ViewSonic; экраны для проекторов; ноутбуки Asus, Lenovo, микрофоны.