

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Узунов Федор Владимирович

Должность: Ректор

Дата подписания: 24.06.2025 11:43:59

Уникальный программный ключ: «Образовательная организация высшего образования»

fd935d10451b860e912264c0378f8448452bfdb605f24388008e29877a6bcbf5

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Автономная некоммерческая организация

«Образовательная организация высшего образования»

«Университет экономики и управления»

Факультет экономики, управления и юриспруденции

Кафедра финансов, учета и аудита

УТВЕРЖДАЮ

Проректор по учебно-методической работе



Г.П. Узунова
01 20 25 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

ФТД.01 Операции на финансовом рынке

Направление подготовки

38.04.08 Финансы и кредит

Образовательная программа

Специалист по финансовому консультированию

Квалификация выпускника: магистр

Для всех
форм обучения

г. Симферополь, 2025

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	Тема 1. Финансовый рынок: сущность, функции и роль в экономике Тема 2. Операции на финансовых рынках. Тема 3. Эмиссия ценных бумаг. Тема 4. Кассовые и срочные сделки. Тема 5. Инвестиционный портфель. Принципы формирования инвестиционного портфеля ценных бумаг. Пассивные и активные стратегии инвесторов Тема 6. Валютные сделки. Сделки своп, спот и форвардные сделки.
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 программы магистратуры	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	6
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	9
6. Учебно-методическое обеспечение дисциплины	9
7. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины	9
8. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины	9
9. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины	10
10. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости)	10
11. Описание материально-технического обеспечения, необходимого для осуществления образовательного процесса по дисциплине	10
12. Приложение к РПД	

1. ЦЕЛЬ И ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ, 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».

Область профессиональной деятельности, на которую ориентирует дисциплина «Операции с ценными бумагами», включает знания, умения и навыки, получаемые при изучении дисциплины.

Типы задач и задачи профессиональной деятельности, к которым готовится обучающийся, определены учебным планом, а именно:

- знать способы организации и оптимизации работы финансово-контрольных и финансово-кредитных органов, принятия управленческих решений;
- уметь оказывать консалтинговые услуги коммерческим и некоммерческим организациям различных организационно-правовых форм (включая финансово-кредитные организации) по вопросам совершенствованию финансовых аспектов их деятельности;
- владеть приемами и методами проведения консалтинговых исследований финансовых проблем по заказам организаций (включая финансово-кредитные организации), органов государственной власти и органов местного самоуправления и разработка предложений по совершенствованию финансовых аспектов их деятельности.

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. Объём дисциплины по видам учебных занятий (в часах)

Для очной формы обучения

Общая трудоёмкость дисциплины составляет 2 зачётных единицы 72 часа

Объём дисциплины	Всего часов
Общая трудоемкость дисциплины	72
Аудиторная работа (всего):	30

Лекции	20
Семинары, практические занятия	10
Самостоятельная работа обучающихся (всего)	42
Зачет	+

Для очно-заочной формы обучения

Общая трудоёмкость дисциплины составляет 2 зачётных единицы 72 часа

Объём дисциплины	Всего часов
Общая трудоёмкость дисциплины	72
Аудиторная работа (всего):	10
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 трудоёмкость по видам учебных занятий (в академических часах)

№ темы	Наименование темы	Всего		Количество часов					
				Контактная работа				Внеаудит. работа	
		ОФО	ОЗФО	Лекции		Практические		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
	Всего по дисциплине	72	68	20	4	10	2	42	62
	Контроль		4						

	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. Аднерайтинг 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, залоговые, 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, индексированные 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. Содержание практических занятий (очная форма обучения)

Разделы, темы, дидактические единицы
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. Вексельное законодательство. Системы вексельного права. Женевская вексельная конвенция, регулирование вексельного обращения. Простой и переводный вексель. Обращение векселей. Индоссамент. Ответственность по вексельному обязательству. Стоимостная оценка векселя. Доходность векселей.
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

Разделы, темы, дидактические единицы
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. 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.
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.
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
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.
Тема 6. Валютные сделки. Сделки своп, спот и форвардные сделки. Государственное регулирование финансовых 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.

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.

Оценочные средства по дисциплине приведены в Приложении 1.

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Моторина, Д. В. Финансовый рынок и финансово-кредитные институты: Опорный конспект лекций/ Д. В. Моторина . - Симферополь: АНО «ООВО» «УЭУ», 2025. - 98 с. .
— Текст : непосредственный

7. ПЕРЕЧЕНЬ ОСНОВНОЙ И ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ УЧЕБНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

а) основная 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. Жукова, Н. Д. Эриашвили. — 4-е изд. — Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2023. — 559 с. — ISBN 978-5-238-02239-0. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/141377.html> (дата обращения: 03.01.2025). — Режим доступа: для авторизир. пользователей

2. Учет, анализ и аудит операций с ценными бумагами : учебное пособие / Г. С. Клычова, А. Т. Исхаков, А. С. Клычова, Н. Н. Нигматуллина. — Казань : Казанский государственный аграрный университет, 2022. — 132 с. — ISBN 978-5-6044928-4-0. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/129698.html> (дата обращения: 03.01.2025). — Режим доступа: для авторизир. пользователей

б) дополнительная учебная литература:

1. Развитие взаимоотношений Банка России с некредитными финансовыми организациями в области ПОД/ФТ : монография / Н. А. Кабанова, М. В. Богданова, Е. А. Горшков [и др.]. — 2-е изд. — Москва : Научный консультант, 2024. — 174 с. — ISBN 978-5-907084-15-5. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/140326.html> (дата обращения: 03.01.2025). — Режим доступа: для авторизир. пользователей

8. ПЕРЕЧЕНЬ РЕСУРСОВ ИНФОРМАЦИОННО-ТЕЛЕКОММУНИКАЦИОННОЙ СЕТИ «ИНТЕРНЕТ», НЕОБХОДИМЫХ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

1. Электронная библиотечная система «IPRsmart» [Электронный ресурс]. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru>.

2. eLIBRARY.RU: научная электронная библиотека: сайт. – Москва, 2000. – URL: <https://elibrary.ru>. – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. – Текст: электронный.
3. Официальный сайт правительства Российской Федерации. – URL: <http://www.government.ru>.
4. Официальный сайт Министерства финансов Российской Федерации. – URL: <http://www.minfin.ru>.
5. Официальный сайт Министерства экономического развития Российской Федерации. – URL: <http://www.economy.gov.ru>.
6. Официальный сайт Центрального банка России. – URL: <http://www.cbr.ru>.
7. Официальный сайт Федеральной налоговой службы РФ – URL: <http://www.nalog.ru>.
8. Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики. – URL: <http://www.gks.ru>.
9. Официальный сайт Федеральной службы по финансовому мониторингу. – URL: <http://www.fedsfm.ru>.
10. Официальный сайт территориального органа Федеральной службы государственной статистики по Республике Крым (Крымстат) [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <https://crimea.gks.ru/>.
11. Сайт Фонда президентских грантов, на котором представлены описания проектов НКО, участвовавших в конкурсах Фонда, с возможностью фильтра по направлениям реализации проектов, городам и регионам базирования НКО и др.: <https://президентскиегранты.рф/public/application/cards>.
12. Единая информационная система ДОБРО.РФ Добро.Центры (dobro.ru).
13. Единый Реестр субъектов малого и среднего предпринимательства <https://ofd.nalog.ru/search.html?mode=extended>.
14. Каталог социальных предприятий <https://soindex.ru/>.
15. Примеры студенческих проектов доступны по ссылке: <https://clck.ru/3584JB>

9. 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; встречи с представителями государственных и общественных организаций.

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:

- 1) программы, обеспечивающие доступ в сеть «Интернет» (например, «Google chrome»);
- 2) программы, демонстрации видео материалов (например, проигрыватель «Windows Media Player»);
- 3) 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.

Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства: Microsoft, Windows, Microsoft Office, LibreOffice, Архиватор 7-zip, Adobe Reader, КонсультантПлюс, Kaspersky Security, VLC, Media Player, Прометей.