

Міністерство освіти і науки, молоді та спорту України
ДВНЗ «НАЦІОНАЛЬНИЙ ГІРНИЧИЙ УНІВЕРСИТЕТ»



Фінансово-економічний факультет
Кафедра економічного аналізу та фінансів

РОБОЧА ПРОГРАМА З ДИСЦИПЛІНИ
«Депозитарна діяльність»

для студентів спеціальності 6.030508
Фінанси і кредит

Дніпропетровськ
2011

Робоча програма з дисципліни «Депозитарна діяльність» для студентів спеціальності 6.030508 Фінанси і кредит / Упорядн.: Замковий О.І. - Дніпропетровськ: Національний гірничий університет, 2011. – 11 с.

Упорядник:
О.І.Замковий, ст..викладач

Затверджено методичною комісією з напрямку 0305 Економіка та підприємництво (протокол № ___ від _____) за поданням кафедри економічного аналізу та фінансів (протокол № ___ від _____).

Подана робоча навчальна програма з дисципліни «Депозитарна діяльність» освітньо-кваліфікаційної програми підготовки фахівців спеціальності 6.030508 „Фінанси і кредит”

Рекомендовано до видання Навчально-методичним управлінням НГУ.

1. ПЕРЕДМОВА

“Депозитарна діяльність” — спеціальний курс, предметом якого є вивчення специфічної сфери грошових та майнових відносин, які виникають у процесі руху цінних паперів між державою, юридичними та фізичними особами за допомогою спеціалізованих фінансових інститутів.

Мета навчальної дисципліни “Депозитарна діяльність” — підготовка бакалаврів такого рівня кваліфікації в галузі управління фінансами та аналізу фондового ринку та розрахунково-клірингових операцій на ньому, який забезпечуватиме їм конкурентні переваги на ринку праці.

Завдання навчальної дисципліни

- Сформуванати комплексне розуміння взаємозв'язків суб'єктів на фондовому ринку та системи спеціалізованих фондових інститутів.
- Навчити визначати потреби споживачів на ринку цінних паперів у конкретних ситуаціях та можливості задоволення цих потреб різними видами фінансових послуг.
- Забезпечити комплексне розуміння позиціонування послуг різних фінансових інститутів як на фондовому ринку в цілому, так і на окремих його сегментах.
- Розвинути навички порівняльного аналізу в галузі послуг на ринку цінних паперів та визначенні конкурентних переваг та недоліків окремих видів послуг.
- Показати роль держави по контролю за послугами з управління цінними паперами та розрахунково-клірингові операції на фондовому ринку .
- Висвітлити основні напрями державної політики в галузі регулювання фінансових відносин, які виникають на фондовому ринку.

Студенти повинні керуватися програмою курсу під час самостійної роботи з навчальним матеріалом, виконання письмових робіт та індивідуальних завдань, а також при підготовці до іспиту.

Знання та навички, отримані в процесі вивчення курсу “Депозитарна діяльність”, можуть бути корисними як при написанні дипломної роботи магістра, так і в подальшій професійній діяльності.

Програма нормативної дисципліни “Депозитарна діяльність” конкретизує освітньо-професійну програму вищої освіти за професійним спрямуванням 6.030508 “Фінанси і кредит”. Програма дисципліни - складова системи стандартів вищої освіти.

Базові дисципліни

Вища математика

Основи права

Макроекономіка

Фінанси

Страхування

Фінансовий ринок

Інвестування

Банківська справа

2. РОЗПОДІЛ НАВЧАЛЬНИХ ГОДИН ЗА СЕМЕСТРАМИ І ВИДАМИ НАВЧАЛЬНИХ ЗАНЯТЬ

Розподіл навчальних годин за семестрами і видами навчальних занять здійснюється відповідно до робочих навчальних планів за наступною формою (табл. 2.1).

Таблиця 2.1

Робоча програма дисципліни “Депозитарна діяльність”

Модулі	Змістові модулі	Розподіл часу		
		аудиторний	самостійна робота	загальний
1	2	3	4	5
№1	Практичні заняття - 2 семестр, (1...9 тиждень) Аудиторні – 2 години на тиждень			
	Учасники фондового ринку та їх професійна діяльність	5	102	144
	Сутність цінних паперів і їх місце на фінансовому ринку	4		
	Характеристика акцій та механізм їх функціонування	5		
	Сутність фондової біржі, її види та функції. Правила фондової біржі	5		
	Сутність біржового ринку	5		
	Депозитарні операції	5		
	Функції Національного депозитарію	5		
	Тенденції розвитку Національної депозитарної системи України	6		
	Модульний контроль – практична контрольна робота: 8-9 тижні	2		
	Разом по дисципліні	42		
	Частка навантаження	42	102	144
			0,67	

Методи навчання: лекції, практичні заняття (рішення задач, розгляд конкретних ситуацій); рішення комплексних самостійних задач; самостійне вивчення матеріалу; поточні та передекзаменаційна консультації.

3. РЕКОМЕНДОВАНІ ДЖЕРЕЛА ІНФОРМАЦІЇ

1. Закон України “Про фінансові послуги та державне регулювання ринків фінансових послуг”

2. Закон України "Про національну депозитарну систему та особливості електронного обігу цінних паперів в Україні" від 10 грудня 1997 р. №710/97-ВР.
3. Закон України "Про цінні папери і фондовий ринок". Закон України від 23.02.2006 р. № 3480-IV.
4. Закон України "Про оподаткування прибутку підприємств" від 22 травня 1997 р. №283/97-ВР.
5. Закон України "Про податок на додану вартість" від 3 квітня 1997 р. №168/97-ВР.
6. Закон України "Про державне регулювання ринку цінних паперів в Україні" від 30 жовтня 1996 р. №448/96-ВР. С
7. Закон України "Про лізинг" від 16 грудня 1997 р. №723/97-ВР.
8. Закон України "Про банки та банківську діяльність" від 20 березня 1991 р. М872-ХП.
9. Закон України "Про державне регулювання ринку цінних паперів в Україні" від 30 жовтня 1996 р. №448/96-ВР.
10. Декрет Кабінету Міністрів України "Про систему валютного регулювання і валютного контролю" від 19 лютого 1993 р. №15—93.
11. Положення про порядок ведення реєстрів власників іменних цінних паперів. Затверджено наказом Державної комісії з цінних паперів та фондового ринку від 1 квітня 1996 р. №58.
12. Положення про реєстрацію фондових бірж та торговельно-інформаційних систем і регулювання їх діяльності. Затверджено наказом ДКЦПФР від 22 січня 1998 р. №19
13. Положення про порядок реєстрації випуску акцій і облігацій підприємств та інформація про їх емісію. Затверджена рішенням ДКЦПФР від 12.02.98 р. № 36
14. Положення про порядок видачі банкам ліцензії на здійснення банківських операцій. Затверджено постановою Правління Національного банку України від 6 травня 1998 р. №181.
15. Положення Національного банку України "Про кредитування" від 28 вересня 1995 р. №246.

16. Положення про інвестиційні фонди та інвестиційні компанії. Затверджено Указом Президента України від 19 лютого 1994 р. №55/94. (Зі змінами від 28 березня 1995 р. №265/95; 18 листопада 1995 р. №1080.)

17. Правила випуску та обігу фондових деривативів. Затверджено рішенням Державної комісії з цінних паперів та фондового ринку від 24 червня 1997 р. №13

18. Правила випуску та обігу фондових деривативів. Затверджено рішенням Державної комісії з цінних паперів та фондового ринку від 24 червня 1997 р. №13.

19. Правила Української фондової біржі. Затверджені рішенням Біржової Ради АТ “Українська фондова біржа” від 22.04.94.

4. РЕКОМЕНДОВАНА ЛІТЕРАТУРА

1. Мендрул О. Г., Шевчук І. А. Ринок цінних паперів: Навч. посібник. — К.: КНЕУ, 1998. — 152 с.

2. Мозговий О. М. Фондовий ринок: Навч. посібник. — К.: КНЕУ, 1999.— 316 с.

3. А.Н.Балабушкин Опционы и фьючерсы. Методическое пособие. Фондовая биржа РТС Деньги. Кредит. Банки. Ценные бумаги. Практикум: Учеб. пособие для вузов /Под ред. проф. Е.Ф. Жукова. — М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2003. - 310 с.

4. Просветов Г.И. Ценные бумаги:Задачи и решения: Учебно-практическое пособие. 2-е изд., доп. – М.: Издательство «Альфа-Пресс», - 2008. -244 с.

5. РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ (ФУНДАМЕНТАЛЬНЫЙ АНАЛИЗ): Учеб. пособие / Карташов Б. А., Матвеева Е. В., Смелова Т. А., Гаврилов А. Е. / ВолгГТУ, Волгоград, 2006. – 180 с.

6. Рынок ценных бумаг: Учебник / Под ред. В.А. Галанова, А.И. Басова. - 2-е изд., перераб. и доп. - М.: Финансы и статистика, 2006. - 448 с : ил.

7. Аскинадзи В.М. Рынок ценных бумаг. – Учебно-методический комплекс. – М., Изд. центр ЕАОИ, 2008. – 211 с.

8. Никифорова В.Д. Рынок ценных бумаг: Учебное пособие. – СПб.: Изд-во СПбГУЭФ, 2010. - с.

9. Рынок ценных бумаг: учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / под ред. Е.Ф. Жукова. — 3-е изд., перераб. и доп. — М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2009. - 567 с.
10. Боровкова Вал. А., Боровкова Вик. А. Рынок ценных бумаг: тесты и задачи. — СПб.: Питер, 2007. — 272 с.: ил. — (Серия «Учебное пособие»).
11. Малюгин В.И. Рынок ценных бумаг: Количественные методы анализа: Учеб. пособие. — М.: Дело, 2003. — 320 с.
12. Берзон Н.И., Буянова Е.А., Кожевников М.А., Чаленко А.В. Фондовый рынок: Учебное пособие для высших учебных заведений экономического профиля. — М.: Вита-Пресс, 1998. - 400 с.: ил.
13. К.С. Царихин Практикум по курсу «Рынок ценных бумаг» Учебное пособие в 4-х частях. — М.: 2001.
14. Твардовский В.В., Паршиков С.В. Секреты биржевой торговли: Торговля акциями на фондовых биржах. — М.: Альпина Паблишер, 2003. — 530 с.
15. Деривативы. Курс для начинающих (Серия «Reuters для финансистов»). Пер. с англ. — М.: Альпина Паблишер, 2002. — 208 с.
16. Томсет Майкл Биржевые секреты: опционы / Пер. с англ. В.В. Найденкова, А.В. Бушуева. — Смоленск: Русич, 2008. — 384 с.
17. Ценные бумаги. Н.Л. Маренков. — Изд. 2-е. — М.: Московский экономико-финансовый институт. Ростов н/Д: Изд-во «Феникс», 2005. — 602 с. — (Высшее образование)
18. Янукян М.Г. Практикум по рынку ценных бумаг. — СПб.: Питер, 2006. — 192 с.: ил. — (Серия «Учебное пособие»).
19. Тьюлз Р., Бредли Э., Тьюлз Т. Фондовый рынок. — 6-е изд.: Пер. с англ. — М.: ИНФРА-М, 2000. - 648 с. — (Университетский учебник)
20. Рынок ценных бумаг: Методические указания к изучению курса (для студентов экономического факультета заочной формы обучения) / Сост.: Л.Н. Иванова, Н.В. Огорелкова. — Омск: Омск. гос. ун-т, 2003. — 68 с.
21. Солонская Л.А. Ценные бумаги. Учеб. пособие. СПб.: СЗТУ, 2002. — 45 с.

22. Рынок ценных бумаг и биржевое дело: Опорный конспект лекций / составитель Юдина И.Н. Барнаул. Изд-во «Азбука», 2006. 119 с.
23. Фондовый рынок. Курс для начинающих (Серия “Reuters для финансистов”). Пер. с англ. – М.: Альпина Паблишер, 2002. – 277 с.
24. Иванов А.П. Финансовые инвестиции на рынке ценных бумаг. – М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К», 2004. – 444 с.
25. Барбаумов В.Е. и др.. Сборник задач по финансовым инвестициям / В.Е.Барбаумов, И.М.Гладких, А.С.Чуйко. – М.: Финансы и статистика, 2004. – 352 с.: ил.
26. Базовый курс по рынку ценных бумаг. - М.: Финансовый издательский дом «Деловой экспресс», 1998. - 408с.
27. Базисные финансовые расчеты. Курс лекцій Д-р Билл Вильямс Торговый хаос. Экспертные методики максимизации прибыли. – М.: ИК Аналитика, 2000. – 159 с.
28. Как увидеть деньги на экране монитора. Под ред.. В.И.Сафина. СПб.: Питер, 2004. – 190 с.
29. Играть на бирже просто?! /НП «Форекс-Клуб». – М.: Форекс Клуб, 2003. -240 с. – (Школа валютных трейдеров)
30. Найман Э.Л. Трейдер-Инвестор. – Киев: ВИРА-Р, 2000. - 640 с.
31. Найман Э.Л. Малая Энциклопедия Трейдера —К . ВИРА-Р Альфа Капитал, 1999. —236 с..ил. 134 — Библиогр -с. 221
32. Стив Нисон Японские свечи. Графический анализ. Пер. с англ. М.Волкова и Т.Дозорова. – М.: «Диалог», 1999. -255 с.
33. Джеффри Оуэн Кац, Донна Л. Мак Кормик Энциклопедия торговых стратегий/Пер, с англ. — М.: Альпина Паблишер, 2002. — 400 с.
34. Базовый курс по рынку ценных бумаг : учебное пособие / О.В. Ломтатидзе, М.И. Львова, А.В. Болотин и др. - М.: КНОРУС, 2010. - 448 с.
35. Нидерхеддер Виктор, Кеннер Лорел Практика биржевых спекуляций/ Пер. с англ. – М.: Альпина Паблишер, 2003. – 560 с.
36. Алехин Б. Й. Рынок ценных бумаг. Введение в фондовые операции. - М.: Финансы и статистика, 1991.
37. Бланк И.А. Инвестиционный менеджмент. - К.: ИТЕМ, -1995.-С. 67.

38. Долай Дж.З. и др. Деньги, банковское дело и денежно-кредитная политика: Пер. с англ. В. Лукашевича и др. / Под общ. ред. В. Лукашевича. -Л, 1991.

39. Мартенс А. В. Инвестиции: Курс лекций по современной финансовой теории. - К.: Киевское инвестиционное агентство, 1997.

40. Миркин Я. М. Ценные бумаги и фондовый рынок. Профессиональный курс в Финансовой академии при правительстве РФ. - М.: Перспектива, 1995.

41. Роде З. Банки, биржи, валюта современного капитализма: Пер. с нем. / Под ред. В. Н. Шенаева. - М.: Финансы и статистика, 1986.

42. Страховое дело / Под ред. Л. И. Рейтмана - М.: Банковский и биржевой научно-консультационный центр, 1992.

43. Суторміна В. М. та ін. Фінанси зарубіжних корпорацій: Навч. посібник / За ред. В. М. Федосова. - К.: Либідь, 1993.

44. Усоскин В. М. Современный коммерческий банк: управление и операции. - М.: Все для Вас, 1993.

45. Фондовый рынок України: Навч. посібник / Керівник авт. кол. В. В. Оскольський. - К.: УФБ - «Скарбниця», 1994.

46. Ходаківська В.П. Удосконалення інфраструктури фінансового ринку України у просторовому вимірі. -Ірпінь: УФЕІ,-1998.

47. Ходаківська В.П., Данілов О.Д. Ринок фінансових послуг: Навч.посібник. – Ірпінь: Академія ДПС України, 2001. – 501с.

5. ЗАСОБИ КОНТРОЛЮ

До основних форм контролю включені:

- опитування за матеріалами лекцій та за матеріалами для самостійного вивчення матеріалу;
- модульна контрольна робота за матеріалами лекцій;
- підсумковий іспит.

Модульна контрольна робота проводиться в формі тестування знань студентів з теоретичного матеріалу, викладеного на лекціях. Тестове завдання складається з 30 тестових питань багатоваріантного вибору.

Підсумковий контроль реалізується через визначення середньозваженого балу результатів усіх модульних контролів.

Екзаменаційна методика: письмовий іспит тривалістю 1 год. 20 хв. Іспит перевіряє теоретичні знання та практичні навички, отримані за весь термін навчання з дисципліни “Депозитарна діяльність”. Результати виконання цього завдання використовуються для оцінки успішності засвоєння теоретичного та практичного матеріалу, викладеного на практичних заняттях.

Завдання складається з теоретичної частини (тестові завдання).

Теоретична частина представлена у формі тестових завдань. На кожне запитання необхідно вибрати одну чи декілька відповідей, які найбільш повно доповнюють твердження, або відповідають на запитання, та вказати літеру (чи літери) вірної відповіді у екзаменаційному листі.

Перед тим, як здати роботу, студент повинен перевірити, чи на всі питання він дав відповідь.

Зразки типових тестових завдань:

До основних напрямів нагляду Державної комісії з регулювання ринків фінансових послуг належить встановлення критеріїв та нормативів щодо:

1. ліквідності
2. капіталу та платоспроможності
3. прибутковості
4. якості активів та ризиковості операцій

5. усі відповіді правильні

Інвестиційний фонд який (або компанія з управління його активами) бере на себе зобов'язання в будь-який час на вимогу інвесторів викупити цінні папери, емітовані цим фондом (або компанією з управління його активами) вважається:

1. фондом відкритого типу
2. фондом інтервального типу
3. фондом закритого типу

Спеціальні кредитно-фінансові інститути, що утворюються товаровиробниками на часткових засадах для задоволення взаємних потреб у кредитах та інших банківських послугах це:

1. Спеціалізовані банки
2. Кооперативні банки
3. Комерційні банки

5. ОЦІНЮВАННЯ ЗАСВОЄННЯ МАТЕРІАЛУ

Модульна контрольна робота з практичного матеріалу оцінюються виходячи з коефіцієнту засвоєння:

$$K_{\xi} = N/P$$

де N – правильних відповідей на поставлені запитання;

P – загальна кількість поставлених відповідей.

Критеріями визначення оцінок приймається:

- | | |
|----------------|-----------------------|
| “відмінно” | - $K_3 > 0,9$; |
| “добре” | - $K_3 = 0,8...0,9$; |
| “задовільно” | - $K_3 = 0,7...0,8$; |
| “незадовільно” | - $K_3 < 0,7$. |

Письмовий іспит тривалістю 1 год. 20 хв., який перевіряє успішність засвоєння практичного матеріалу за весь термін навчання з дисципліни “Депозитарна діяльність” оцінюється також на базі коефіцієнту засвоєння (табл. 5.1)

Таблиця 5.1

Оцінка письмового іспиту

Частина \ Оцінка	відмінно	добре	задовільно	незадовільно
Теоретична частина (30 тестових запитань)	> 0,9	0,8...0,9	0,7...0,8	< 0,7
Всього:	> 0,9	0,8...0,9	0,7...0,8	< 0,7