

ИКОНОМИЧЕСКИ УНИВЕРСИТЕТ - В А Р Н А
ФАКУЛТЕТ „УПРАВЛЕНИЕ“
КАТЕДРА „УПРАВЛЕНИЕ И АДМИНИСТРАЦИЯ“

Приета от ФС (протокол №/ дата):

Приета от КС (протокол №/ дата):

УТВЪРЖДАВАМ:

Декан:
(проф. д-р Стоян Маринов)

У Ч Е Б Н А П Р О Г Р А М А

ПО ДИСЦИПЛИНАТА: **“ФИНАНСОВИ ПАЗАРИ И ИНСТИТУЦИИ”;**

ЗА СПЕЦ: **„Мениджмънт“; ОКС „бакалавър“**

КУРС НА ОБУЧЕНИЕ: **3; СЕМЕСТЪР: 5;**

ОБЩА СТУДЕНТСКА ЗАЕТОСТ: **180 ч.; в т.ч. аудиторна 60 ч.**

КРЕДИТИ: **6**

РАЗПРЕДЕЛЕНИЕ НА СТУДЕНТСКАТА ЗАЕТОСТ СЪГЛАСНО УЧЕБНИЯ ПЛАН

| <i>ВИД УЧЕБНИ ЗАНЯТИЯ</i> | <i>ОБЩО(часове)</i> | <i>СЕДМИЧНА НАТОВАРЕНОСТ (часове)</i> |
|---|---------------------|---|
| АУДИТОРНА ЗАЕТОСТ: | | |
| т. ч. | | |
| • ЛЕКЦИИ | 30 | 2 |
| • УПРАЖНЕНИЯ (семинарни занятия/ лабораторни упражнения) | 30 | 2 |
| ИЗВЪНАУДИТОРНА ЗАЕТОСТ | 120 | - |

Изготвили програмата:

1.
(доц. д-р Добрин Добрев)

2.
(гл. ас. д-р М. Владимир)

Ръководител катедра:
„Управление и администрация“ (доц. д-р Добрин Добрев)

I. АНОТАЦИЯ

Основната цел на дисциплината е да запознае студентите с предназначението, организацията и начините за функциониране на съвременните финансови пазари, институциите и инструменти тържувани на тях. Последователно са представени банковите и небанковите финансови посредници и тяхната роля и място на капиталовите пазари. Отделено е внимание на базовите и производните финансови инструменти, механизмите им на търгуване стратегиите за управление на риска .

II. ТЕМАТИЧНО СЪДЪРЖАНИЕ

| No. по ред | НАИМЕНОВАНИЕ НА ТЕМИТЕ И ПОДТЕМИТЕ | БРОЙ ЧАСОВЕ | | |
|------------|--|-------------|-----|----|
| | | Л | СЗ | ЛУ |
| | Тема 1 ОБЩ ПРЕГЛЕД НА ФИНАНСОВИТЕ ПАЗАРИ | 2 | 2 | |
| 1.1 | Функции на финансовите пазари. | 1 | 1 | |
| 1.2 | Видове финансови пазари. | 1 | 1 | |
| | Тема 2 КАПИТАЛОВ ПАЗАР. ПЪРВИЧНИ И ВТОРИЧНИ ПАЗАРИ | 2 | 2 | |
| 2.1 | Функции на капиталовия пазар. | 1 | 1 | |
| 2.2 | Роля на първичните и вторичните пазари. | 1 | 1 | |
| | Тема 3 ДЕПОЗИТАРНИ ИНСТИТУЦИИ | 2 | 2 | |
| 3.1 | Видове депозитарни институции | 1 | 1 | |
| 3.2 | Функции на депозитарни финансови последници | 1 | 1 | |
| | Тема 4 Недепозитарни институции | 2 | 2 | |
| 4.1 | Характеристика на недепозиталните финансови посредници. | 2 | 2 | |
| | Тема 5 Инвестиционни банки | 2 | 2 | |
| 5.1 | Природа инвестиционните банки. | 1 | 1 | |
| 5.2 | Функции на инвестиционните банки | 1 | 1 | |
| | Тема 6 Пазар на деривати. Финансовите фючърси | 2 | 2 | |
| 6.1 | Производни финансови инструменти. | 1 | 1 | |
| 6.2. | Пазари и механизъм на търгуване на производните финансови инструменти. | 1 | 1 | |
| | Тема 7 Опционни пазари. Въведение | 2 | 2 | |
| 7.1 | Видове опции. | 1 | 1 | |
| 7.2 | Оценяване на опции | 0,5 | 0,5 | |
| 7.3 | Стратегии използващи опции | 0,5 | 0,5 | |
| | Тема 8 Суапоз пазар. Въведение. | 2 | 2 | |
| | Лихвени суап. | 1 | 1 | |
| | Кръстосън валутен суап. | 1 | 1 | |
| | Тема 9 Дългови пазари. Паричен пазар. | 2 | 2 | |
| 9.1 | Инструменти на паричния пазар. | | | |
| | Тема 10 Дългови пазари. Пазарна корпоративни облигации | 2 | 2 | |
| 10.1 | Оценка на облигации | 1 | 1 | |
| 10.2 | Дюрация и конвекност | 1 | 1 | |
| 11 | Дългови пазари. Общински облигационен пазар. | 2 | 2 | |
| | Тема 12 Кредитни деривати. | 2 | 2 | |
| 12.1 | Ипотечни деривати. | 1 | 1 | |
| 12.2 | Механизъм на създаване | 1 | 1 | |

| | | | | |
|------------------------------------|--|----|----|--|
| Тема 13 Международен валутен пазар | | 2 | 2 | |
| 14 | Инструменти на международния валутен пазар | 2 | 2 | |
| | Общо: | 30 | 30 | |

III. ФОРМИ НА КОНТРОЛ:

| №. по ред | ВИД И ФОРМА НА КОНТРОЛА | Брой в сем. | ИАЗ ч. |
|---|-------------------------------|-------------|------------|
| 1. | Текущ контрол | | |
| 1.1. | Тест | 1 | 30 |
| 1.2. | Курсова работа | 1 | 30 |
| Общо за семестриален контрол: | | 2 | 60 |
| 2. | Сесиен (краен) контрол | | |
| 2.1. | Изпит (тест) | 1 | 60 |
| Общо за сесиен контрол: | | 1 | 60 |
| Общо за всички форми на контрол: | | 3 | 120 |

IV. ЗАДЪЛЖИТЕЛНА (ОСНОВНА) ЛИТЕРАТУРА:

1. The World's First Stock Exchange -Columbia Business School Publishing- Hardcover - 2014 Lo Dewijk Petram
2. Stock Market Investing for Beginners: Essentials to Start Investing Successfully- Tycho Press Berkeley California -2013
3. Fundamentals of Financial Instruments: An Introduction to Stocks, Bonds, Foreign Exchange, and Derivatives -Sunil K. Parameswaran ISBN: 978-0-470-82490-0; John Wiley & Sons inc-2011

ПРЕПОРЪЧИТЕЛНА (ДОПЪРНИТЕЛНА) ЛИТЕРАТУРА:

1. Fundamentals of Investment Management (McGraw-Hill/Irwin series in finance, insurance, and Real Estate-2014) ISBN-10: 0078034620 Geoffrey Hirt , Stanley Block
2. The Theory and Practice of Investment Management: Asset Allocation, Valuation, Portfolio Construction, and Strategies Hardcover – April 5, 2011 Frank J. Fabozzi , Harry M. Markowitz
3. Introduction to Finance: Markets, Investments, and Financial Management 15th Edition ISBN-10: 1118492676 Ronald W. Melicher 2014 John Wiley & Sons inc
4. Modern Portfolio Theory and Investment Analysis Edwin J. Elton Stephen J. Brown ISBN-10: 1118469941 John Wiley & Sons inc 2014