

Національний університет біоресурсів і природокористування України
Економічний факультет
Кафедра організації підприємництва та біржової діяльності

«ЗАТВЕРДЖУЮ»

Декан економічного факультету
А. Д. Діброва

РОЗГЛЯНУТО І СХВАЛЕНО
на засіданні кафедри організації
підприємництва та біржової діяльності
Протокол №6 від 14 травня 2020 р.
Завідувач кафедри
М.М. Ільчук

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

**АНАЛІЗ І ПРОГНОЗУВАННЯ БІРЖОВОГО
РИНКУ**

(назва навчальної дисципліни)

Спеціальність 076 Підприємництво, торгівля та біржова діяльність
(шифр і назва спеціальності)

Факультет _____ Економічний _____

розробник: к.е.н., доц. Яворська В.О.

Київ – 2020 р.

1. Опис навчальної дисципліни
Аналіз і прогнозування біржового ринку

(назва)

Галузь знань, напрям підготовки, спеціальність, освітній ступінь		
Освітній ступінь	Магістр (бакалавр, спеціаліст, магістр)	
Галузь знань	_07 «Управління та адміністрування» (шифр і назва)	
Спеціальність	076 Підприємництво, торгівля та біржова діяльність (шифр і назва)	
Характеристика навчальної дисципліни		
Вид	Обов'язкова	
Загальна кількість годин	___ 120 ___	
Кількість кредитів ECTS	___ 4 ___	
Кількість змістових модулів	___ 3 ___	
Курсовий проект (робота) (якщо є в робочому навчальному плані)		
Форма контролю	екзамен	
Показники навчальної дисципліни для денної та заочної форм навчання		
	денна форма навчання	заочна форма навчання
Рік підготовки	___ 1 ___	___ 1 ___
Семестр	___ 1 ___	___ 1 ___
Лекційні заняття	___ 30 ___ год.	___ 8 ___ год.
Практичні, семінарські заняття	___ 30 ___ год.	___ 6 ___ год.
Лабораторні заняття	___ - ___ год.	___ ___ год.
Самостійна робота	___ 60 ___ год.	___ ___ год.
Індивідуальні завдання	___ - ___ год.	___ ___ год.
Кількість тижневих годин для денної форми навчання: аудиторних самостійної роботи студента –	___ 4 ___ год. ___ 4 ___ год.	___ 6 ___ год. ___ 8 ___ год.

2. Мета та завдання навчальної дисципліни

Програма вивчення навчальної дисципліни "Аналіз і прогнозування біржового ринку" складена відповідно до освітньо-професійної програми

підготовки студентів ОС "Магістр" спеціальності 076 "Підприємництво, торгівля та біржова діяльність" і є важливою складовою частиною у системі підготовки фахівців для біржового ринку країни в аграрних вищих навчальних закладах.

Предметом вивчення навчальної дисципліни є організація аналізу і прогнозування біржового ринку за умов застосування системи науково-прикладних методів і комп'ютерних програм.

Дисципліна "Аналіз і прогнозування біржового ринку" вивчає систему методів оцінки ситуації на біржовому ринку, що склалася і його прогнозування функціонування на перспективу.

Мета вивчення курсу – дати майбутньому спеціалісту економічного спрямування теоретичні основи та практичні навички з проведення аналізу і здійснення прогнозування кон'юнктури біржового ринку, а також ефективного використання отриманих знань у своїй майбутній діяльності.

Завдання курсу:

- формування у студентів знань з проведення поетапного аналізу та прогнозування перспектив функціонування біржового ринку;
- набуття практичних навичок з застосування різних методів і підходів при проведенні поставленого завдання.

У результаті вивчення дисципліни студенти повинні **знати:**

- основні етапи проведення дослідження біржового ринку;
- специфіку здійснення поточного спостереження на біржовому ринку;
- особливості проведення фундаментального аналізу;
- основний інструментарій технічного аналізу;
- процес здійснення аналізу і прогнозування біржового ринку за допомогою методів математичного аналізу;
- основні етапи проведення коротко-, середньо- та довгострокового прогнозування.

На підставі отриманих знань студенти повинні **вміти:**

- здійснювати поточне спостереження за тенденціями на біржовому ринку;
- за допомогою освоєних методів проводити аналіз біржового ринку;
- працювати аналітиком в сфері дослідження біржового ринку;
- застосовувати методи прогнозування біржового ринку на практиці.

3. Структура навчальної дисципліни

Назви змістових модулів і тем	Кількість годин											
	денна форма						заочна форма					
	усього	у тому числі					усього	у тому числі				
		л	с / п	ла б	ін д	с. р.		л	с/п	ла б	ін д	с. р.
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Змістовий модуль 1. Аналітичне дослідження біржового ринку.												
Т.1. Теоретичні основи аналізу біржового ринку	6	2	2			2		1				
Т.2. Кон'юнктура біржового ринку	6	2	2			2		1				
Змістовий модуль 2. Основи фундаментального аналізу і прогнозування біржової кон'юнктури.												
Т.3. Поняття і види фундаментального аналізу	10	2	2			6		1				
Т.4. Інформаційні ресурси для аналізу біржового ринку	14	4	4			6		1				
Т.5. Макроекономічний аналіз біржового ринку	10	2	2			6		1				
Т.6. Мікроекономічний аналіз біржового ринку	12	2	2			8		1	1			
Змістовий модуль 3. Технічний і математичний аналіз біржового ринку.												
Т.7. Технічний аналіз біржового ринку	14	4	4			6		1				
Т.8. Фігури	10	2	2			6		1				

технічного аналізу												
Т.9. Математичний аналіз біржового ринку	10	2	2			6			1			
Т.10.Біржова статистика	12	4	4			4		1	1			
Т.11.Прогнозування біржової кон'юнктури	16	4	4			8		1	1			
Усього годин	120	30	30			60		8	6			

4. Теми семінарських занять

№ з/п	Назва теми	Кількість годин
1	Теоретичні основи аналізу біржового ринку	2
2	Кон'юнктура біржового ринку	2
3	Поняття і види фундаментального аналізу	2
4	Інформаційні ресурси для здійснення фундаментального аналізу біржового ринку	4
	Разом	10

5. Теми практичних занять

№ з/п	Назва теми	Кількість годин
5	Макроекономічний аналіз біржового ринку	2
6	Мікроекономічний аналіз біржового ринку	2
7	Технічний аналіз біржового ринку	4
8	Фігури технічного аналізу	2
9	Математичний аналіз біржового ринку	2
10	Біржова статистика	4

11	Прогнозування біржової кон'юнктури	4
	Разом	20

6. Методи навчання

Семінарські заняття проводяться у формі дискусії за попередньо визначеним планом та підготованими рефератами або есе. Студенти готують тези доповідей. На практичних заняттях вирішуються ситуаційні завдання, для аналізу використовується аналітичні звіти світової федерації бірж, фондових бірж. Студенти залучаються до процесу біржових торгів. Індивідуальні завдання виконуються за кейс-методом, групи готують презентаційні та реферативні матеріали і завдання.

Електронний курс доступний на платформі НУБІП України – Elearn.
URL: <https://elearn.nubip.edu.ua/course/view.php?id=2508>

7. Форми контролю ЕКЗАМЕН

8. Розподіл балів, які отримують здобувачі вищої освіти

Оцінювання здобувача вищої освіти відбувається згідно «Положення про екзамени та заліки в НУБІП України»

ШКАЛА ОЦІНЮВАННЯ СТУДЕНТІВ

Рейтинг здобувача вищої освіти, бали	Оцінка національна за результати складання екзаменів заліків	
	екзаменів	заліків
90-100	відмінно	зараховано
74-89	добре	
60-73	задовільно	
0-59	незадовільно	не зараховано

9. Методичне забезпечення

1. Яворська В.О., Солодкий М.О. Методичні вказівки до написання курсових робіт з дисципліни "Аналіз і прогнозування біржового ринку", К. ЦП Компринт, 2017 р. – 48с.

2. Яворська В.О. Методичні вказівки до проведення лабораторних занять з дисципліни "Аналіз і прогнозування біржового ринку" К. ЦП Компринт, 2017 р. – 78 с.

3. Яворська В.О., Солодкий М.О., Шиш А.М. Методичні вказівки до самостійного вивчення дисципліни "Аналіз і прогнозування біржового ринку" студентами заочної форми спеціальності "Підприємництво, торгівля та біржова діяльність" К. ЦП Компрінт, 2017 р. – 60 с.

4. Методичні рекомендації до вивчення дисципліни «Аналіз і прогнозування біржового ринку» / М.О.Солодкий, В.О. Яворська. – К.: Компрінт, 2015. - 49с.

5. Конспект лекцій з дисципліни «Аналіз і прогнозування біржового ринку» Укл. Яворська В.О. та ін. – К.: Компрінт, 2015. – 42 с.

6. Методичні рекомендації для написання курсових робіт з дисципліни "Аналіз і прогнозування біржового ринку" / Укл. Яворська В.О. та ін. – К.: Компрінт, 2016. – 20 с.

10. Рекомендовані джерела

Базові

1. Прикладна статистика: навч. посібник / В. О. Костюк; Харк. нац. ун-т міськ. госп-ва ім. О. М. Бекетова. – Харків: ХНУМГ ім. О. М. Бекетова, 2015. 191 с.

2. Фінансова статистика. Навчальний посібник /М. В. Мальчик, С. І. Галашко, А. І. Пелех. URL: http://ebooktime.net/book_393.html

3. Статистичне моделювання та прогнозування: навч. посіб./Єріна А.М. Електронний ресурс. URL: <http://studentam.kiev.ua/content/view/774/82/>

4. Солодкий М.О. Біржовий товарний ринок: навчальний посібник/ М.О. Солодкий. Київ: Компрінт, 2017. 576с.

5. Солодкий М.О. Біржовий ринок: навчальний посібник/ М.О. Солодкий. Київ: Аграрна освіта, 2016. 565с.

6. Солодкий М.О., Яворська В.О., Кравченко А.С. Розвиток біржової торгівлі на товарних та фінансових ринках: монографія / М.О. Солодкий, В.О. Яворська, А.С. Кравченко. Київ: В-во ЦП Компрінт, 2017. 450с.

7. Солодкий М.О., Яворська В.О., Кравченко А.С. Розвиток біржового товарного ринку: монографія. Київ.: ЦП Компрінт, 2018. 488 с.

8. Яворська В.О. Головний вплив на інноваційний розвиток світового ринку фінансових деривативів. *Вісник НУБІП України*. 2015. № 222. с. 176-181.

9. Яворська В.О. Аналіз діяльності світових бірж. *Моніторинг біржового ринку*. 2015. № 4 (35). С.12-15.

10. Яворська В.О. Аналітична оцінка світового біржового ринку. *Агросвіт*. 2016. № 12. С. 14-18.

11. Яворська В.О. Аналітична оцінка світового біржового ринку *Інфраструктура ринку*. 2017. № 10. URL: http://www.market-infr.od.ua/journals/2017/10_2017_ukr/16.pdf.

12. Солодкий М.О., Яворська В.О. Механізм хеджування на біржовому товарному ринку. *Приазовський економічний вісник*. 2019. Вип. 3(14). URL: <http://pev.kpu.zp.ua/archives>.

13. Солодкий М.О., Яворська В.О. Біржовий ринок в умовах глобалізації: стан та перспективи розвитку. *Інфраструктура ринку*. 2019. Вип. 31. URL: <http://www.market-infr.od.ua/uk/archive>.

Допоміжні

14. Фундаментальний аналіз фінансових інвестицій. Фінансові коефіцієнти. Індекс Альтмана. Точка беззбитковості. Леверидж. URL: <http://library.if.ua/book/82/5816.html>

15. Сутність та особливості фундаментального аналізу міжнародного валютного ринку. Види економічних індикаторів. URL: Режим доступу: <http://library.if.ua/book/131/8725.html>

16. Фундаментальний аналіз ринку фінансових інвестицій – Електронний ресурс. URL: http://pidruchniki.com/11970524/investuvannya/fundamentalniy_analiz_rinku_finansovih_investitsiy

17. Технический анализ. URL: <http://www.markets.com/ru/education/technical-analysis/>

18. Основа технического анализа. URL: <http://berg.com.ua/tech/technical-analysis-in-detail/>

19. John Hull. Options, Futures and Other Derivative Securities. 9-edition- New Jersey, University of Toronto, Prentice Hall, Englewood Cliffs, 2015. 852p.

11. Інформаційні ресурси

1. Електронні та друковані видання бібліотеки ім. Вернадського www.nbuv.gov.ua

2. Аналітичне видання. Журнал Інтернет-трейдинг (Бібліотека кафедри біржової діяльності)

3. Аналітичне видання. Журнал Біржовий моніторинг (бібліотека кафедри біржової діяльності)

4. Верхован Рада України. URL: www.rada.gov.ua.

5. Державна служба статистики України. URL: www.ukrstat.gov.ua

6. Комісія з товарної ф'ючерсної торгівлі США. URL: www.cftc.gov.

7. Чиказька товарна біржа. URL: www.cme.com.

8. Міжнародна асоціація своп дирелів. URL: www.isda.org.