

Національний університет біоресурсів і природокористування України
Економічний факультет

"ЗАТВЕРДЖУЮ"

Перший проректор Національного
університету біоресурсів і
природокористування України,
професор, академік НААН
Л. І. Козулін
11.09.2020 р.

РОЗГЛЯНУТО І СХВАЛЕНО

на засіданні Вченої ради економічного факультету

Протокол № 10 від 14.09.2020 р.

Декан факультету *А. Д. Дуброва*

на засіданні кафедри організації підприємництва та
біржової діяльності

Протокол № 6 від 14.09.2020 р.

Завідувач кафедри *М. М. Ільчук*

**РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ
ДИСЦИПЛІНИ**

Аналіз товарних і фінансових ринків

(назва навчальної дисципліни)

Рівень вищої освіти – Третій (освітньо-науковий)

Галузь знань 07 – Управління та адміністрування

Спеціальність 076 – Підприємництво, торгівля та біржова діяльність

Освітня програма – Підприємництво, торгівля та біржова діяльність

Освітній ступінь – Доктор філософії з підприємництва, торгівлі та біржової діяльності

Розробники: к.е.н., проф. Солодкий М.О.

к.е.н., доц. Яворська В.О.

Київ – 2020 р.

1. Опис навчальної дисципліни
Аналіз товарних і фінансових ринків

(назва)

Галузь знань, напрям підготовки, спеціальність, освітній ступінь		
Галузь знань	07 Управління та адміністрування (шифр і назва)	
Спеціальність	076 Підприємництво, торгівля та біржова діяльність (шифр і назва)	
Освітня програма	Підприємництво, торгівля та біржова діяльність	
Освітній ступінь	Доктор філософії	
Характеристика навчальної дисципліни		
Вид	Вибіркова	
Загальна кількість годин	150	
Кількість кредитів ECTS	5	
Форма контролю	екзамен	
Показники навчальної дисципліни для денної та заочної форм навчання		
	денна форма навчання	Заочна, вечірня форма навчання
Рік підготовки	1	1
Семестр	2	2
Лекційні заняття	20 год.	20 год.
Практичні, семінарські заняття	20 год.	20 год.
Самостійна робота	110 год.	110 год.
Кількість тижневих годин навчання: аудиторних	4 год.	4 год.

2. Мета та завдання навчальної дисципліни

Програма вивчення навчальної дисципліни «Аналіз товарних і фінансових ринків» складена відповідно підготовки фахівців третього (освітньо-наукового) рівня вищої освіти спеціальності 076 «Підприємництво, торгівля та біржова діяльність» і є важливою складовою частиною у системі підготовки науковців в аграрних вищих навчальних закладах.

Предметом вивчення навчальної дисципліни є методологічні підходи аналізу і прогнозування ринків за умов застосування системи науково-прикладних методів і комп'ютерних програм.

Дисципліна «Аналіз товарних і фінансових ринків» вивчає систему методів оцінки ситуації на ринках, що склалася і його прогнозування функціонування на перспективу.

Мета дисципліни – сформулювати у науковців комплекс знань з аналізу товарних і фінансових ринків.

Завдання – дати здобувачам знання сутності методів аналізу, сформулювати практичні навички з аналізу ринкових показників.

У результаті вивчення дисципліни здобувач повинен:

знати: основні етапи проведення кон'юнктурного дослідження ринків; специфіку здійснення спостереження на біржовому ринку; особливості виконання фундаментального та технічного аналізу; методи здійснення аналізу ринків; тощо.

уміти: обрати оптимальні методи для здійснення аналізу ринків; виконувати аналітичну роботу на товарних та фінансових ринках; розробляти економіко-математичні моделі прогнозування біржової кон'юнктури; тощо.

відповідати наступним загальним та фаховим компетентностям ОНП «Підприємництво, торгівля та біржова діяльність»:

ЗК2. Здатність до пошуку, оброблення та аналізу інформації з різних джерел та проведення комплексних досліджень у сфері підприємництва, торгівлі та біржової діяльності.

ЗК4. Здатність до аналізу та синтезу, а також до прийняття обґрунтованих рішень.

ЗК5. Здатність розробляти та управляти проектами у вітчизняному та зарубіжному контексті.

СК1. Знання основних концепцій, розуміння теоретичних і практичних проблем у сфері підприємництва, торгівлі та біржової діяльності.

СК5. Здатність застосовувати сучасні інформаційні технології, бази даних та інші електронні ресурси, спеціалізоване програмне забезпечення у науковій та навчальній діяльності.

СК7. Здатність формулювати наукову проблему, розробляти робочі гіпотези, визначати актуальність, мету, завдання, які необхідно вирішити для

досягнення мети, оцінювати необхідні ресурси та час для реалізації, що передбачає глибоке переосмислення наявних та створення нових цілісних знань та професійної практики у сфері підприємництва, торгівлі та біржової діяльності.

СК8. Здатність продукувати нові ідеї, розв'язувати комплексні проблеми та приймати науково обґрунтовані рішення в професійній діяльності.

отримати наступні програмні результати навчання ОНП «Підприємництво, торгівля та біржова діяльність»:

РН1. Вміти продукувати нові ідеї, здійснювати критичний аналіз, оцінку і синтез у сфері підприємницької, торговельної та біржової діяльності.

РН4. Ініціювати інноваційні проекти, забезпечувати підготовку наукових розробок у сфері підприємницької, торговельної та біржової діяльності.

РН6. Знати та критично оцінювати теорії, положення та концептуальні підходи до вирішення комплексних наукових і практичних завдань у підприємстві, торгівлі та біржовій діяльності.

РН7. Формулювати і перевіряти гіпотези, використовувати для обґрунтування висновків належні докази, зокрема, результати теоретичного аналізу, експериментальних досліджень і математичного та/або комп'ютерного моделювання.

3. Структура навчальної дисципліни

Назви змістових модулів і тем	Кількість годин											
	денна форма						Заочна, вечірня форма					
	усього	у тому числі					усього	у тому числі				
		л	п	л	ін д	с.р.		л	п	л	ін д	с.р.
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Модуль 1.												
Т.1. Методологічні засади аналізу ринків.	12	2	-			10	12	2	-			10
Т.2. Дослідження кон'юнктури товарних і фінансових ринків.	16	2	4			10	16	2	4			10
Т.3. Поняття аналізу ринків.	12	2	-			10	12	2	-			10
Т.4. Інформаційні ресурси.	12	2	-			10	12	2	-			10
Всього модуль 1	52	8	4			40	52	8	4			40
Модуль 2.												
Т.5.Макроекономічний аналіз.	16	2	4			10	16	2	4			10
Т.6.Мікроекономічний аналіз.	14	2	2			10	14	2	2			10
Т.7. Технічний аналіз товарних і фінансових ринків.	16	2	4			10	16	2	4			10
Т.8.Фігури технічного аналізу.	12	2	-			10	12	2	-			10
Т.9. Математичний аналіз та прогнозування	14	2	2			10	14	2	2			10
Т.10.Біржова статистика	14	2	2			10	14	2	2			10
Всього модуль 2.	98	12	16			70	98	12	16			70
Усього годин	150	20	20			110	150	20	20			110

4.Теми лекцій:

- 1.Методологічні засади аналізу ринків (2 год.).
- 2.Дослідження кон'юнктури товарних і фінансових ринків (2 год.).
- 3.Поняття аналізу ринків (2 год.).
- 4.Інформаційні ресурси (2 год.).
- 5.Макроекономічний аналіз (2 год.).
- 6.Мікроекономічний аналіз (2 год.).
- 7.Технічний аналіз товарних і фінансових ринків (2 год.).
- 8.Фігури технічного аналізу (2 год.).
- 9.Математичний аналіз та прогнозування (2 год.).
- 10.Біржова статистика (2 год.).

5.Теми практичних занять:

- 1.Аналітична оцінка кон'юнктури ринків (4 год.).
- 2.Фундаментальний аналіз біржових товарних і фінансових ринків (4 год.).
- 3.Технічний аналіз (4 год.).
- 4.Статистичний аналіз показників біржового ринку (4 год.).
- 5.Моделі прогнозування ринкової кон'юнктури (4 год.).

6. Питання для самоконтролю знань з дисципліни

1. Методичні підходи до здійснення аналізу ринків.
2. Принципи та функції аналізу.
3. Етапи проведення аналізу і прогнозування.
4. Економічна сутність, теорії фундаментального аналізу.
5. Основні функції та цілі фундаментального аналізу.
6. Види фундаментального аналізу.
7. Індустріальний аналіз.
8. Аналіз діяльності компаній - виробників.
9. Цикл життя факторів фундаментального аналізу.
- 10.Теорії та інструменти технічного аналізу.
- 11.Загальні принципи технічного аналізу.
- 12.Основні методи технічного аналізу.
- 13.Типи графіків руху ринку. Основні характеристики графіків руху ціни.
- 14.Лінійні графіки, чарти, гістограми.
- 15.Японські свічі.
- 16.Переваги та недоліки використання технічного аналізу.
- 17.Графіки об'єму торгівлі та відкритих позицій на прикладі товарних ф'ючерсних ринків.
- 18.Класичні фігури технічного аналізу.
- 19.Ціновий тренд та його поняття.
- 20.Лінії опору та підтримки. їх значення та особливості побудови.
- 21.Лінії тренду та каналу.
- 22.Поняття та основні види розворотних фігур.

23. Фігури продовження та їх значення у технічному аналізі.
24. Методи і прийоми математичного аналізу цінкових і курсових ризиків на ф'ючерсному ринку.
25. Числа Фібоначчі.
26. Ковзні середні та їх види. Осцилятори.
27. Теорія циклів і хвильова теорія Еліота.
28. Кореляційно-регресійний аналіз.
29. Індексний метод оцінки біржової кон'юнктури.
30. Групування показників біржової кон'юнктури.
31. Економіко-математичні моделі прогнозування біржової кон'юнктури.
32. Короткотермінове прогнозування.
33. Методи середньо- і довготермінового прогнозування.
34. Використання індикаторів та індексів. Математичне моделювання на біржовому ринку товарних активів.

7. Методи навчання

Передбачено використання наступних методів навчання:

- вербальні (лекція, пояснення, розповідь, бесіда, інструктаж);
- наочні (спостереження, ілюстрація, демонстрація);
- пояснювально-ілюстративний або інформаційно-рецептивний, який передбачає пред'явлення готової інформації викладачем та її засвоєння студентами;
- репродуктивний, в основу якого покладено виконання різного роду завдань за зразком;
- метод проблемного викладу;
- частково-пошуковий або евристичний;
- дослідницький (розв'язування творчих завдань, проведення аналітичних досліджень, складання графічних схем, таблиць, діаграм, тощо.)

8. Методи контролю

- експрес – опитування на лекціях;
 - опитування на практичних заняттях (письмове, усне, групове й індивідуальне);
 - оцінювання аналітичного проекту;
 - тестові методи перевірки знань.
- Підсумковий і поточний контроль знань:
- поточний контроль: опитування, тестування, виступи; контрольна модульна робота (письмова робота);
 - підсумковий контроль: екзамен.

9. Розподіл балів, які отримують студенти

Оцінювання аспірантів відбувається згідно чинного «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

10. Рекомендована література

Базова

1. Солодкий М. О., Яворська В.О. Біржовий товарний ринок: навч. посібник. К.: ЦП Компринт, 2016. 482с.
2. Солодкий М.О. Основи біржової діяльності: навч. посіб. / за ред. М.О. Солодкого. К.: ЦП Компринт, 2017. 450 с.
3. Солодкий М.О. Яворська В.О. Хеджування ф'ючерсами і опціонами: навч. посіб. К.: ЦП Компринт, 2018. 398с.
4. Солодкий М.О. Яворська В.О. Міжнародні біржові ринки: навч. посіб. К.: ЦП Компринт, 2019. 520с.
5. Сотник І., Таранюк Л. Підприємництво, торгівля та біржова діяльність: посібник. Суми: Університетська книга, 2018. 572 с.
6. Сохацька О. М. Біржова справа: підручник. / вид. 3-тє, перероб., змін. та допов. Тернопіль, 2014. 654 с.
7. Яворська В.О. Аналіз діяльності світових бірж. *Моніторинг біржового ринку*. 2015. – № 4 (35). – С. 12-15.

Допоміжна

8. Фундаментальний аналіз ринку фінансових інвестицій URL: http://pidruchniki.com/11970524/investuvannya/fundamentalniy_analiz_rinku_finansovih_investitsiy.
9. Технический анализ URL: <http://www.markets.com/ru/education/technical-analysis/>.
10. Основа технічного аналізу URL: <http://berg.com.ua/tech/technical-analysis-in-detail/>.
11. Фундаментальний аналіз фінансових інвестицій. Фінансові коефіцієнти. Індекс Альтмана. Точка беззбитковості. Леверидж. URL: <http://library.if.ua/book/82/5816.html>.
12. Сутність та особливості фундаментального аналізу міжнародного валютного ринку. Види економічних індикаторів. URL: <http://library.if.ua/book/131/8725.html>

Інформаційні ресурси

13. Електронні та друковані видання бібліотеки ім. Вернадського URL: www.nbuv.gov.ua.
14. Електронні та друковані видання бібліотеки НУБІП України URL: <https://nubip.edu.ua/structure/library>.
15. Аналітичне видання. Журнал Інтернет-трейдинг (Бібліотека кафедри біржової діяльності).
16. Аналітичне видання. Журнал Біржовий моніторинг (бібліотека кафедри біржової діяльності).
17. Державна служба статистики України. URL: www.ukrstat.gov.ua
18. Комісія з товарної ф'ючерсної торгівлі. URL: www.cftc.gov.
19. Чиказька група бірж. URL: www.cme-group.com.
20. Офіційний сайт Верховної Ради України. URL : www.zakon.rada.gov.ua
21. Офіційний сайт Кабінету Міністрів України. URL : www.kmu.gov.ua
22. Офіційний сайт Міністерства освіти та науки України. URL : <http://mon.gov.ua>
23. Офіційний сайт Державної наукової установи «Книжкова палата України імені Івана Федорова». URL : <http://www.ukrbook.net>
24. Електронна бібліотека Національного університету біоресурсів і природокористування України. URL : <https://nubip.edu.ua/node/17325>
25. Наукова бібліотека Національного університету біоресурсів і природокористування України. URL : <https://nubip.edu.ua/structure/library>
26. Національна бібліотека України ім. В. І. Вернадського. URL : <http://www.nbuv.gov.ua>
27. Національна бібліотека України ім. Ярослава Мудрого. URL : <http://nlu.org.ua>
28. Наукова бібліотека Національного університету «Києво-Могилянська академія». URL : <http://www.library.ukma.edu.ua>
29. Наукова бібліотека ім. Максимовича. URL : <http://www.library.univ.kiev.ua/ukr/title4.php3>