

НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ БІОРЕСУРСІВ І
ПРИРОДОКОРИСТУВАННЯ УКРАЇНИ
Кафедра організації підприємництва та біржової діяльності


"ЗАТВЕРДЖУЮ"
Декан економічного факультету
Анатолій ДІБРОВА
"16" травня 2024 р.

"СХВАЛЕНО"
на засіданні кафедри організації
підприємництва
та біржової діяльності
Протокол № 13 від "14" травня 2024 р.
Завідувач кафедри
Микола ІЛЬЧУК

"РОЗГЛЯНУТО"
Гарант ОП «Підприємництво, торгівля та
біржова діяльність»
Людмила БЕРЕЗОВСЬКА

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

АНАЛІЗ І ПРОГНОЗУВАННЯ БІРЖОВОГО РИНКУ

Галузь знань – 07 «Управління та адміністрування»
Спеціальність – 076 «Підприємництво та торгівля»
Освітня програма – «Підприємництво, торгівля та біржова діяльність»
Факультет – Економічний

Розробник: к.е.н., доцент Яворська В.О.

Київ – 2024 р.

Опис навчальної дисципліни
АНАЛІЗ І ПРОГНОЗУВАННЯ БІРЖОВОГО РИНКУ

Галузь знань, спеціальність, освітня програма, освітній ступінь		
Галузь знань	Управління та адміністрування	
Спеціальність	076 «Підприємництво та торгівля»	
Освітня програма	Підприємництво, торгівля та біржова діяльність	
Освітній ступінь	Магістр	
Характеристика навчальної дисципліни		
Вид	Обов'язкова	
Загальна кількість годин	180	
Кількість кредитів ECTS	6	
Кількість змістових модулів	3	
Форма контролю	Екзамен	
Показники навчальної дисципліни для денної та заочної форм навчання		
	денна форма навчання	заочна форма навчання
Курс (рік підготовки)	1	1
Семестр	2	2
Лекційні заняття	30 год.	8 год.
Практичні, семінарські заняття	30 год.	6 год.
Лабораторні заняття		
Самостійна робота	120 год.	166 год.
Кількість тижневих аудиторних годин для денної форми навчання:	___4___ год.	

1. Мета, завдання, компетентності та програмні результати навчальної дисципліни

Мета – дати майбутньому здобувачу вищої освіти 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: формування у студентів знань з проведення поетапного аналізу та прогнозування перспектив функціонування біржового ринку; набуття практичних навичок із застосування різних методів і підходів при проведенні поставленого завдання.

Набуття компетентностей:

інтегральна компетентність (ІК):

Здатність розв'язувати складні задачі і проблеми у галузі підприємництва, торгівлі та/або біржової діяльності або у процесі навчання, що передбачає проведення досліджень та/або здійснення інновацій за невизначених умов і вимог.

загальні компетентності (ЗК):

ЗК 2. Вміння виявляти, ставити та вирішувати проблеми.

спеціальні (фахові) компетентності (СК):

СК 3. Здатність до ефективного управління діяльністю суб'єктів господарювання в сфері підприємництва, торгівлі та/або біржової діяльності.

СК 6. Здатність вирішувати задачі у нестійкому економічному середовищі, здійснювати аналіз і прогнозування тенденцій розвитку підприємницьких та біржових структур у конкурентному середовищі.

програмні результати навчання (ПРН):

ПРН2. Визначати, аналізувати проблеми підприємництва, торгівлі і біржової діяльності та розробляти заходи щодо їх вирішення.

ПРН9. Розробляти і приймати рішення, спрямовані на забезпечення ефективності діяльності суб'єктів господарювання в сфері підприємництва, торгівлі та/або біржової діяльності.

ПРН12. Вміти визначати тенденції розвитку організованого товарного ринку, підприємницької, торговельної та біржової діяльності в агробізнесі, пов'язані із впливом інтеграційних процесів на реалізацію аграрної політики.

2.Програма та структура навчальної дисципліни для:
 – повного терміну денної (заочної) форми здобуття вищої освіти

Назви змістових модулів і тем	Кількість годин													
	денна форма							заочна форма						
	тижні	усього	у тому числі					усього	у тому числі					
			л	с/п	лаб	І н д	с.р.		л	с/п	л	ін д	с.р.	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	
Змістовий модуль 1. Аналітичне дослідження біржового ринку.														
Т.1. Теоретичні основи аналізу БР	1	14	2	2			10	21	1					20
Т.2.Кон'юнктура БР	2	16	2	4			10	21	1					20
Всього за М.1.		30	4	6			20	42	2					30
Змістовий модуль 2. Основи фундаментального аналізу і прогнозування біржової кон'юнктури.														
Т.3. Поняття і види фундаментального аналізу	3	14	2	2			10	21	1					20
Т.4. Інформаційні ресурси для аналізу біржового ринку	4, 5	18	4	4			10	21	1					20
Т.5.Макроекономічний аналіз біржового ринку	6	14	2	2			10	21	1					20
Т.6.Мікроекономічний аналіз біржового ринку	7	16	2	4			10	12	1	1				10
Всього за М.2.		62	10	12			40	75	4	1				70
Змістовий модуль 3. Технічний і математичний аналіз біржового ринку.														
Т.7. Технічний аналіз біржового ринку	8, 9	23	4	4			15	13		1				12
Т.8.Фігури технічного аналізу	10	19	2	2			15	13		1				12
Т.9. Математичний аналіз біржового ринку	11	14	2	2			10	13		1				12
Т.10.Біржова статистика	12, 13	16	4	2			10	12	1	1				15
Т.11.Прогнозування біржової кон'юнктури	14, 15	16	4	2			10	17	1	1				15
Всього за М.3.		88	16	12			60	73	2	5				66
Усього годин		180	30	30			120	180	8	6				166

3. Теми практичних занять

№ з/п	Назва теми	Кількість Годин
1	Тема 1. Аналіз біржових показників.	2
2	Тема 2. Кон'юнктура біржового ринку	4
3	Тема 3. Поняття і види фундаментального аналізу	2
4	Тема 4. Інформаційні ресурси для здійснення фундаментального аналізу біржового ринку	4
5	Тема 5. Макроекономічний аналіз біржового ринку	2
6	Тема 6. Мікроекономічний аналіз біржового ринку	4
7	Тема 7. Технічний аналіз біржового ринку	2
8	Тема 8. Фігури технічного аналізу	2
9	Тема 9. Математичний аналіз біржового ринку	4
10	Тема 10. Біржова статистика	2
11	Тема 11. Прогнозування біржової кон'юнктури	2
	Разом	30

4. Теми самостійної роботи

№ самостійної	Назва теми	Кількість Годин
Самостійна робота 1.	Тема 1. Аналіз біржових показників.	10
	Тема 2. Кон'юнктура біржового ринку	10
Самостійна робота 2.	Тема 3. Поняття і види фундаментального аналізу	10
	Тема 4. Інформаційні ресурси для здійснення фундаментального аналізу біржового ринку	10
	Тема 5. Макроекономічний аналіз біржового ринку	10
	Тема 6. Мікроекономічний аналіз біржового ринку	10
Самостійна робота 3.	Тема 7. Технічний аналіз біржового ринку	15
	Тема 8. Фігури технічного аналізу	15
	Тема 9. Математичний аналіз біржового ринку	10
	Тема 10. Біржова статистика	10
	Тема 11. Прогнозування біржової кон'юнктури	10
	Разом	120

5. Засоби діагностики результатів навчання:

- екзамен;
- модульні тести;
- реферати;
- розрахункові роботи;
- захист практичних робіт;
- інші види.

6. Методи навчання:

- словесний метод (лекція, дискусія, співбесіда тощо);
- практичний метод (практичні заняття);

- наочний метод (метод ілюстрацій, метод демонстрацій);
- робота з навчально-методичною літературою (конспектування, тезування, анотування, рецензування, складання реферату);
- відеометод (дистанційні, мультимедійні, веб-орієнтовані тощо);
- самостійна робота (виконання завдань);
- інші види.

7.Методи оцінювання.

- екзамен;
- усне або письмове опитування;
- модульне тестування;
- реферати, есе;
- захист практичних робіт;
- презентації та виступи на наукових заходах;
- інші види.

8.Розподіл балів, які отримують здобувачі вищої освіти. Оцінювання знань здобувача вищої освіти відбувається за 100-бальною шкалою і переводиться в національні оцінки згідно з табл. 1 чинного «Положення про екзамени та заліки у НУБіП України»

Рейтинг здобувача вищої освіти, бали	Оцінка національна та результати складання екзамену
90-100	відмінно
74-89	добре
60-73	задовільно
0-59	незадовільно

Для визначення рейтингу здобувача вищої освіти із засвоєння дисципліни РДИС (до 100 балів) одержаний рейтинг з атестації (до 30 балів) додається до рейтингу здобувача вищої освіти з навчальної роботи РНР (до 70 балів): $R_{ДИС} = R_{НР} + R_{АТ}$.

9.Навчально-методичне забезпечення

-електронний навчальний курс навчальної дисципліни (на навчальному порталі НУБіП України eLearn - <https://elearn.nubip.edu.ua/course/view.php?id=2508>;

-конспекти лекцій та їх презентації (в електронному вигляді) - <https://elearn.nubip.edu.ua/course/view.php?id=2508>;

- Конспект лекцій з дисципліни «Аналіз і прогнозування біржового ринку». Укл. Яворська В.О. та ін. К.: Компринт, 2022. 42 с. ;

- Солодкий М.О., Ільчук М.М., Яворська В.О. Аналіз і прогнозування біржового ринку: навч. посіб. Київ: ФОП Ямчинський О.В., 2020. 642 с.

- Яворська В.О. Методичні вказівки до проведення практичних занять з дисципліни "Аналіз і прогнозування біржового ринку", К. ЦП Компринт, 2022 р. 104с.

10. Рекомендовані джерела інформації

1. Закон України «Про ринки капіталу та організовані товарні ринки» № 738-IX від 19.06.2020 із змінами № 1587-IX від 30.06.2021№ 2180-IX від 01.04.2022. URL: <https://zakon.rada.gov.ua>.

2. Ільчук М.М., Яворська В.О., Радько В.І. Організаційні засади здійснення біржових операцій на біржовому ринку. Інфраструктура ринку. 2021. №52. URL: <http://www.market->

infr.od.ua/journals/2021/52_2021/6.pdf/

3. Конспект лекцій з дисципліни «Аналіз і прогнозування біржового ринку» Укл. Яворська В.О. та ін. К.: Компринт, 2022. 42 с.
4. Солодкий М.О., Ільчук М.М., Яворська В.О. Аналіз і прогнозування біржового ринку: навч. посіб. Київ: ФОП Ямчинський О.В., 2020. 642 с.
5. 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>.
6. Сохацька О.М., Панасюк В.М., Роговська-Іщук І.В., Вінницький С.І. Фундаментальний та технічний аналізи міжнародних ринків. Тернопіль: ЗУНУ, 2022. 309 с.
7. Статистичне моделювання та прогнозування: навч. посіб./Єріна А.М. URL: <http://studentam.kiev.ua/content/view/774/82>.
8. Сутність та особливості фундаментального аналізу міжнародного валютного ринку. Види економічних індикаторів. URL: Режим доступу: <http://library.if.ua/book/131/8725.html>.
9. Фінансова статистика. Навчальний посібник /М. В. Мальчик, С. І. Галашко, А. І. Пелех. URL: http://ebooktime.net/book_393.html
10. Фундаментальний аналіз фінансових інвестицій. Фінансові коефіцієнти. Індекс Альтмана. Точка беззбитковості. Леверидж. URL: <http://library.if.ua/book/82/5816.html>.
11. Фундаментальний аналіз ринку фінансових інвестицій – Електронний ресурс. URL: http://pidruchniki.com/11970524/investuvannya/fundamentalniy_analiz_rinku_finansovih_investitsiy.
12. 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.
13. Яворська В.О. Аналіз торгівлі деривативними контрактами на міжнародних біржах. Інфраструктура ринку. 2022. № 68. URL: <http://www.market-infr.od.ua/uk/68-2022>.
14. Яворська В.О. Аналіз ринків капіталу та організованих товарних ринків. Інфраструктура ринку. 2022. № 69. URL: <http://www.market-infr.od.ua/uk/69-2022>.
15. Яворська В.О. Методичні вказівки до проведення практичних занять з дисципліни "Аналіз і прогнозування біржового ринку", К. ЦП Компринт, 2022 р. 104с.
16. How to use fundamental analysis in trading. URL: <https://www.oanda.com/us-en/learn/fundamental-analysis/introduction-to-fundamental-analysis>.
17. Fundamental analysis. URL: <https://www.cmcmarkets.com/en/trading-guides/fundamental-analysis>.
18. Fundamental Analysis. URL: <https://www.wallstreetmojo.com/fundamental-analysis>.
19. Technical Analysis – A Beginner’s Guide. URL: <https://corporatefinanceinstitute.com/resources/career-map/sell-side/capital-markets/technical-analysis>.
20. Technical Analysis. URL: <https://www.cfainstitute.org/en/membership/professional-development/refresher-readings/technical-analysis>.
21. Офіційний сайт Верхованої Ради України. URL: www.rada.gov.ua.
22. Офіційний сайт Державної служби статистики України. URL: www.ukrstat.gov.ua
23. Офіційний сайт Національної комісії з цінних паперів та фондового ринку. URL: <https://www.nssmc.gov.ua>
24. Офіційний сайт Комісії з товарної ф’ючерсної торгівлі США. URL: www.cftc.gov.
25. Офіційний сайт Чиказької товарної біржі. URL: www.cme.com.

26. Офіційний сайт Української біржі. URL: <http://www.ux.ua>
27. Офіційний сайт Української енергетичної біржі. URL: <https://www.ueex.com.ua>
28. Офіційний сайт Української універсальної біржі. URL: <https://sale.uub.com.ua>.