



Лектор навчальної
дисципліни
Контактна інформація
лектора (e-mail)
URL ЕНК на
навчальному порталі
НУБіП України

СИЛАБУС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ «АНАЛІЗ І ПРОГНОЗУВАННЯ БІРЖОВОГО РИНКУ»

Ступінь вищої освіти - Магістр

Спеціальність **076 Підприємництво та торгівля**

Освітня програма «Підприємництво, торгівля та біржова діяльність»

Рік навчання 1 , семестр 2

Форма навчання денна/заочна

Кількість кредитів ЄКТС 6

Мова викладання українська

 к.е.н., доц. Яворська В.О.

 vali2009@ukr.net

 +380501061359

<https://elearn.nubip.edu.ua/course/view.php?id=2508>

ОПИС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Мета вивчення курсу – дати майбутньому фахівцю економічного спрямування теоретичні основи та практичні навички з аналізу і прогнозування кон'юнктури біржового ринку (далі БР), а також ефективного використання отриманих знань у своїй майбутній діяльності. **Предметом** вивчення є аналіз і прогнозування БР за умов застосування системи науково-прикладних методів і комп'ютерних програм.

Компетентності навчальної дисципліни:

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.

СТРУКТУРА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Тема	Години лекції/практичні, семінарські	Результати навчання	Завдання	Оцінювання
2 семестр				
Модуль 1				

Тема1. Теоретичні основи аналізу БР	2/2	Знати: економічну сутність методів Вміти: використовувати отримані знання для практичних розрахунків	Підготовка аналітичних звітів, написання есе, тестів, виконання самостійної роботи в elearn	20
Тема2. Кон'юнктура БР	2/4	Знати: організаційну структуру організованого ринку Вміти: використовувати вивчені методи на практиці	Підготовка аналітичних звітів, написання есе, тестів, виконання самостійної роботи в elearn	20 10
Самостійна робота 1		Знати: практичні елементи фундаментального аналізу Вміти: здійснювати аналітичну оцінку відібраних акцій	Підготовка аналітичного звіту з висновками за досліджуваний період	10
Тест до модуля 1			Тестові завдання	40
Всього модуль 1 (M1)				100
Модуль 2				
Тема3. Поняття і види фундаментальн ого аналізу	2/2	Знати: сутність фундаментального аналізу Вміти: використовувати отримані знання для проведення фундаментального аналізу	Підготовка аналітичних звітів, написання звітів, тестів, виконання самостійної роботи в elearn	10
Тема4. Інформаційні ресурси для аналізу БР	4/4	Знати: наявні інформаційні ресурси для аналізу Вміти: використовувати отримані знання для проведення аналізу	Підготовка аналітичних звітів, написання звітів, тестів, виконання самостійної роботи в elearn	5 10
Тема5. Макроекономіч ний аналіз БР	2/2	Знати: етапи здійснення макроаналізу БР Вміти: використовувати отримані знання для проведення аналітичної роботи	Підготовка аналітичних звітів, виконання самостійної роботи в elearn	10
Тема6. Мікроекономіч ний аналіз БР	2/4	Знати: етапи здійснення мікроаналізу БР Вміти: використовувати отримані знання для проведення аналітичної роботи	Підготовка аналітичних звітів, виконання самостійної роботи в elearn	10 10
Самостійна робота 2		Знати: практичні елементи фундаментального аналізу Вміти: здійснювати аналітичну оцінку відібраних акцій	підготовка аналітичного звіту з висновками за досліджуваний період	15
Тест до модуля 2			Тестові завдання	30
Всього модуль 2 (M2)				100
Модуль 3				
Тема7. Технічний аналіз БР	4/2	Знати: методику технічного аналізу БР Вміти: використовувати отримані знання для біржового трейдингу	Підготовка звітів, побудова графіків, написання есе, тестів, виконання самостійної роботи в elearn	10
Тема8. Фігури технічного аналізу	2/2	Знати: класичні фігури БР Вміти: використовувати отримані знання для біржового трейдингу	Підготовка звітів, побудова чартів, написання есе, тестів, виконання самостійної роботи в elearn	10
Тема9.		Знати: індикатори тех аналізу	Підготовка розрахункових	

Математичний аналіз БР	2/4	Вміти: використовувати отримані знання для біржового трейдингу	робіт, побудова чартів з індикаторами, написання тестів, виконання самостійної роботи в elearn	10 10
Тема10. Біржова статистика	4/2	Знати: статистичні методи аналізу БР Вміти: використовувати отримані знання для підготовки аналітичних звітів	Підготовка звітів, розрахунки статистичних показників, написання есе, тестів, виконання самостійної роботи в elearn	10
Тема11. Прогнозування біржової кон'юнктури	4/2	Знати: методи прогнозування БР Вміти: використовувати отримані знання для прогнозування біржової кон'юнктури	Підготовка аналітичних прогнозних звітів, розрахунок статистичних показників, написання тестів, виконання самостійної роботи в elearn	10
Самостійна робота 3		Знати: практичні елементи фундаментального аналізу Вміти: здійснювати аналітичну оцінку відібраних акцій	підготовка аналітичного звіту з висновками за досліджуваний період	10
Тест до модуля 3			Тестові завдання	30
Всього модуль 3 (М3)				100
Навчальна робота за курс			$(M1+M2+M3) / 3 \times 0,7$	70
Екзамен			2 теоретичні питання і 10 тестових завдань	30
ВСЬОГО ЗА КУРС			Навчальна робота за курс + Екзамен	100

ПОЛІТИКА ОЦІНЮВАННЯ

Політика щодо дедлайнів та перескладання:	Роботи, які здаються із порушенням термінів без поважних причин, оцінюються на нижчу оцінку. Перескладання модулів відбувається із дозволу лектора за наявності поважних причин (наприклад, лікарняний).
Політика щодо академічної доброчесності:	Списування під час контрольних робіт та екзаменів заборонені (в т.ч. із використанням мобільних девайсів). Реферати, есе повинні мати коректні текстові посилання на використану літературу
Політика щодо відвідування:	Відвідування занять є обов'язковим. За об'єктивних причин (наприклад, хвороба, міжнародне стажування) навчання може відбуватись індивідуально (в он-лайн формі за погодженням із деканом факультету)

ШКАЛА ОЦІНЮВАННЯ ЗНАТЬ ЗДОБУВАЧІВ ВИЩОЇ ОСВІТИ

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

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-Ішук 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: <http://library.if.ua/book/131/8725.html>. Режим доступу:

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/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>.