



СИЛАБУС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ «БІРЖОВА ДІЯЛЬНІСТЬ НА РИНКАХ КАПІТАЛУ ТА ОРГАНІЗОВАНИХ ТОВАРНИХ РИНКАХ»

Ступінь вищої освіти – Доктор філософії

Спеціальність 076 Підприємництво та торгівля

Освітня програма «Підприємництво, торгівля та біржова діяльність»

Рік навчання 1, семестр 2

Форма здобуття вищої освіти денна/вечірня/заочна

Кількість кредитів ЄКТС 5

Мова викладання українська

к.е.н., доц. Яворська В.О.

yavorska.v.o@nubip.edu.ua

<https://elearn.nubip.edu.ua/course/view.php?id=4478>

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

ОПИС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Дисципліна “Біржова діяльність на ринках капіталу та організованих товарних ринках” вивчає становлення та розвиток ринку капіталу та організованих товарних ринків в умовах світових глобалізаційних процесів.

Мета дисципліни – формування у здобувачів знань умов і факторів становлення та механізмів функціонування ринку капіталу та організованих товарних ринків.

Завдання – дати здобувачам знання сутності ринку капіталу та організованих товарних ринків, сформувані практичні навички зі здійснення біржових операцій на ринку капіталу та організованих товарних ринках.

Компетентності навчальної дисципліни:

-інтегральна компетентність (ІК) Здатність продукувати нові ідеї, розв'язувати комплексні проблеми у сфері підприємництва, торгівлі та біржової діяльності, що передбачає глибоке переосмислення наявних і створення нових цілісних знань та/або професійних практик, застосовувати новітні методології наукової, педагогічної, професійної діяльності, здійснювати власні наукові дослідження, результати яких мають наукову новизну, теоретичне та практичне значення

-загальні компетентності (ЗК):

ЗК2. Здатність працювати в міжнародному контексті.

ЗК5. Здатність розробляти проекти та управляти ними.

- спеціальні (фахові) компетентності (СК):

СК1. Здатність планувати і виконувати оригінальні дослідження на відповідному рівні, досягати наукових результатів, які можуть бути опубліковані у провідних наукових виданнях, впроваджені у практичну діяльність, що створюють нові знання у підприємницьких, торговельних та біржових структурах та/або дотичних до них міждисциплінарних напрямках.

СК4. Здатність усно та/або письмово презентувати, обговорювати, апробувати результати досліджень, розробок, проектів українською та іноземною мовами.

Програмні результати навчання (ПРН):

ПРН3. Застосовувати сучасні інструменти і технології пошуку, оброблення та аналізу інформації, зокрема, статистичні, економікоматематичні методи аналізу даних великого обсягу та/або складної структури, спеціалізовані бази даних та інформаційнокомунікативні технології, прилади та обладнання.

ПРН05. Застосовувати сучасні методи та інструменти наукових досліджень та інноваційної діяльності для отримання нових знань та/або розв'язання комплексних проблем у сфері підприємництва, торгівлі та біржової діяльності, а також у дотичних міждисциплінарних напрямках.

ПРН07. Аналізувати та оцінювати стан, тенденції розвитку підприємництва, торгівлі, біржової діяльності, застосовувати сучасні методології, методи та інструменти для вирішення актуальних проблем у професійній практиці.

ПРН09. Планувати і виконувати теоретичні та/або емпіричні дослідження з використанням сучасних методів й інструментів, здійснювати критичний аналіз результатів власних або сторонніх досліджень у контексті усього комплексу сучасних знань щодо проблем у сфері підприємництва, торгівлі, біржової діяльності та дотичних міждисциплінарних напрямів, з дотриманням норм академічної і професійної етики.

ПРН14. Застосовувати сучасні методи та інструменти управління організованими товарними ринками та вирішувати проблеми розвитку біржової діяльності.

СТРУКТУРА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Тема	Години лекції/практичні, семінарські	Результати навчання	Завдання	Оцінювання
2 семестр				
Т.1. Вплив глобалізації на формування біржової торгівлі.	2/2	Знати: економічну сутність глобалізації Вміти: використовувати отримані знання для практичних розрахунків	Підготовка рефератів, написання есе, тестів, виконання самостійної роботи в elearn	5
Т.2. Становлення міжнародного біржового ринку	2/2	Знати: організаційну структуру міжнародного біржового ринку Вміти: використовувати отримані знання для практичних операцій на міжнародних біржах	Підготовка рефератів, написання есе, тестів, виконання розрахункових завдань та самостійної роботи в elearn	10
Т.3. Організація і регулювання ринку капіталу в Україні.	4/4	Знати: вітчизняну законодавчу базу Вміти: використовувати отримані знання для здійснення операцій на вітчизняному біржовому ринку	Підготовка рефератів, написання звітів, тестів, виконання самостійної роботи в elearn	5
Т.4. Теоретичні засади функціонування організованих товарних ринків в Україні.	2/2	Знати: особливості функціонування товарних бірж Вміти: використовувати отримані знання для здійснення операцій на вітчизняному біржовому товарному ринку	Підготовка рефератів, написання звітів, тестів, виконання самостійної роботи в elearn	5
Т.5. Організаційна структура біржі.	4/4	Знати: організаційну структуру біржі Вміти: використовувати отримані знання для проведення біржової торгівлі	Підготовка рефератів, написання есе, тестів, виконання самостійної роботи в elearn	5
Т.6. Види учасників біржової торгівлі.	2/2	Знати: види учасників біржового ринку Вміти: використовувати отримані знання для проведення практичної роботи на біржовому ринку	Підготовка рефератів, написання есе, тестів, виконання самостійної роботи в elearn	5
Т.7. Технології торгівлі та клірингових розрахунків.	4/4	Знати: технології торгівлі та клірингу на біржах	Підготовка розрахункових робіт, написання тестів, виконання самостійної роботи в elearn	10

		Вміти: використовувати отримані знання для біржового трейдингу		
Т.8. Методичні підходи до формування торгових стратегій біржовими ф'ючерсами та опціонами.	4/4	Знати: методику розробки біржових торгових стратегій Вміти: використовувати отримані знання для біржового трейдингу	Підготовка розрахункових робіт, розробка торгових стратегій, написання тестів, виконання самостійної роботи в elearn	5
Т.9. Моделювання спекулятивних стратегій торгівлі.	2/2	Знати: методику розробки біржових торгових стратегій Вміти: використовувати отримані знання для біржового трейдингу	Підготовка розрахункових робіт, розробка торгових стратегій, написання тестів, виконання самостійної роботи в elearn	10
Т.10. Хеджування цінних ризиків. Стратегії хеджування.	4/4	Знати: теорію і практику хеджування Вміти: використовувати отримані знання для здійснення хеджування цінних ризиків на біржах	Підготовка розрахункових робіт, розробка хеджових стратегій, написання тестів, виконання самостійної роботи в elearn	10
Всього за 2 семестр				70
Екзамен				30
Всього за курс				100

ПОЛІТИКА ОЦІНЮВАННЯ

Політика щодо дедлайнів та перекладання:	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 за результати складання екзаменів і заліків	
	екзаменів	заліків
90-100	відмінно	зараховано
74-89	добре	
60-73	задовільно	
0-59	незадовільно	не зараховано

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> (дата звернення 10.05.2024).
2. Закон України «Про товарні біржі» в редакції Закону № 3585-IX від 22.02.2024. URL: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/1956-12#Text> (дата звернення 10.05.2024).
3. 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/ (дата звернення 10.05.2024).
4. Ільчук М.М., Яворська В.О. Вступ до фаху та соціальні комунікації : навч. посіб. Київ : В-во НУБП, 2022. 472с.
5. Солодкий М.О., Яворська В.О. Економічна сутність аналізу біржового ринку

Інфраструктура ринку. Київ, 2020. Випуск № 48. С. 68-73. URL: <https://doi.org/10.32843/infrastruct48-13>. (дата звернення 10.05.2024).

6. 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>. (дата звернення 10.05.2024).

7. Яворська В.О., Солодкий М.О. Особливості підготовки фахівців з підприємництва, торгівлі та біржової діяльності. *Економіка та суспільство*. 2021. № 29. URL: <https://doi.org/10.32782/2524-0072/2021-29-5> (дата звернення 10.05.2024).

8. Яворська В.О. Аналіз торгівлі деривативними контрактами на міжнародних біржах. *Інфраструктура ринку*. 2022. № 68. URL: <https://doi.org/10.32782/infrastruct68-13> (дата звернення 10.05.2024).

9. Яворська В.О. Аналіз ринків капіталу та організованих товарних ринків. *Інфраструктура ринку*. 2022. № 69. URL: <https://doi.org/10.32782/infrastruct69-5> (дата звернення 10.05.2024).

10. Яворська В.О. Аналіз біржової торгівлі деривативами на міжнародних товарних і фондових біржах. *Інфраструктура ринку*. 2023. № 75. URL: <https://doi.org/10.32782/infrastruct69-5> (дата звернення 10.05.2024).

11. Derivatives Market. URL: <https://www.sciencedirect.com/topics/economics-econometrics-and-finance/derivatives-market> (дата звернення 10.05.2024).

12. Derivative Markets and Instruments. URL: <https://www.cfainstitute.org> (дата звернення 10.05.2024).

13. Офіційний сайт Верхована Рада України. URL: www.rada.gov.ua.

14. Офіційний сайт Державна служба статистики України. URL: www.ukrstat.gov.ua

15. Офіційний сайт Національна комісія з цінних паперів та фондового ринку. URL: <https://www.nssmc.gov.ua>

16. Офіційний сайт Комісія з товарної ф'ючерсної торгівлі США. URL: www.cftc.gov.

17. Офіційний сайт Чиказька товарна біржа. URL: www.cme.com.

18. Офіційний сайт Українська біржа. URL: <http://www.ux.ua>

19. Офіційний сайт Українська енергетична біржа. URL: <https://www.ueex.com.ua>

20. Офіційний сайт Українська універсальна біржа. URL: <https://sale.uub.com.ua>.