



Силабус навчальної дисципліни АНАЛІЗ І ПРОГНОЗУВАННЯ БІРЖОВОГО РИНКУ

підготовки бакалавра

(назва освітнього ступеня)

спеціальності 076 Підприємництво, торгівля та біржова діяльність

(назва спеціальності)

освітньо-професійної програми
«Підприємницька діяльність»

(назва освітньої програми)

Статус дисципліни	нормативна
Мова навчання	українська
Факультет	Економічний
Кафедра	Фінансів, економіки та підприємництва
Контакти кафедри	Висотний корпус, к. В-1007, тел. 073 183 14 31, електронна адреса e.and.p@pgasa.dp.ua
Викладачі-розробники	Ступнікер Ганна Леонідівна, к.е.н, доцент
Контакти викладачів	stupniker.hanna@pdaba.edu.ua тел. 0677636712
Розклад занять	розклад занять на сайті академії https://pgasa.dp.ua/timetable/WSIGMA/EK/K4/ROZKLAD.HTML
Консультації	Сторінка кафедри на сайті https://pgasa.dp.ua/wp-content/uploads/2022/10/Graf.pdf

Анотація навчальної дисципліни

Предметом вивчення навчальної дисципліни «Аналіз і прогнозування біржового ринку» є формування системи теоретичних і прикладних знань та компетенцій з питань аналізу та прогнозування біржового ринку через освоєння методів аналізу і прогнозу, навички роботи з фінансовою інформацією, здійснення аналізу ризиків, їх хеджування, вміння спрогнозувати дохідність на різних ринках та для різних груп товарів.

	Години	Кредити	Семестр
			VIII
лекції	16	4	16
лабораторні роботи	-		-
практичні заняття	14		14
Самостійна робота, у т.ч:	90		90
підготовка до аудиторних занять	15		15
підготовка до контрольних заходів	15		15
виконання курсового проєкту або роботи			
виконання індивідуальних завдань	15		15
опрацювання розділів програми, які не викладаються на лекціях	15		15
підготовка до екзамену	30		30
Форма підсумкового контролю			Екзамен

Мета дисципліни: формування у студентів системи теоретичних і прикладних знань на основі структурно-цілісного усвідомлення та творчо-критичного осмислення сучасних тенденцій розвитку, функціонування та регулювання біржових ринків, фундаментальних методологічних засад та теоретико-концептуальних основ аналізу і прогнозування зміни ціни та ситуації на біржових ринках, науково-дослідного апарату та науково-практичних підходів до роботи з фінансовою інформацією та адекватно інтерпретувати отриману інформацію.

Завдання дисципліни: охарактеризувати основні методи аналізу та прогнозування біржового ринку, що дозволить приймати адекватні управлінські рішення з питань мінімізації ризикованості комерційних операцій, вибору перспективних ринків збуту для відповідних товарних груп; висвітлити сучасні проблеми вітчизняних та світових біржових ринків; сформувати практичні навички щодо критичного аналізу фінансової інформації, аналізу ситуації на біржових ринках та практичні навички з прогнозування ситуації на біржовому ринку.

Пререквізити дисципліни: вивчення даної навчальної дисципліни студент розпочинає, прослухавши такі навчальні дисципліни як «Економіко-математичні методи і моделі», «Статистика», «Біржова діяльність», «Маркетинг».

Постреквізити дисципліни: професійна діяльність за фахом.

Компетентності:

Інтегральна компетентність. Здатність розв'язувати складні спеціалізовані завдання та проблеми у сферах підприємницької, торговельної та біржової діяльності або в процесі навчання, що передбачає застосування теорій та методів організації і функціонування підприємницьких, торговельних, біржових структур і характеризується комплексністю та невизначеністю умов.

Спеціальні компетентності:

СК2. Здатність обирати та використовувати відповідні методи, інструментарій для обґрунтування рішень щодо створення, функціонування підприємницьких, торговельних і біржових структур.

СК3. Здатність здійснювати діяльність у взаємодії суб'єктів ринкових відносин.

СК5. Здатність визначати та оцінювати характеристики товарів і послуг в підприємницькій, торговельній, біржовій діяльності.

СК6. Здатність здійснювати діяльність з дотриманням вимог нормативно-правових документів у сфері підприємницької, торговельної та біржової діяльності.

Заплановані результати навчання (відповідно до освітньо-професійної програми СВО ПДАБА- 076-2020 «Підприємницька діяльність»):

У результаті вивчення навчальної дисципліни студент повинен:

РН2. Застосовувати набуті знання для виявлення, постановки та вирішення завдань за різних практичних ситуацій в підприємницькій, торговельній та біржовій діяльності.

РН13. Використовувати знання форм взаємодії суб'єктів ринкових відносин для забезпечення діяльності підприємницьких, торговельних та біржових структур.

РН15. Оцінювати характеристики товарів і послуг у підприємницькій, торговельній та біржовій діяльності за допомогою сучасних методів.

РН16. Знати нормативно-правове забезпечення діяльності підприємницьких, торговельних та біржових структур і застосовувати його на практиці.

PH17. Вміти вирішувати професійні завдання з організації діяльності підприємницьких, торговельних та біржових структур і розв'язувати проблеми у кризових ситуаціях з урахуванням зовнішніх та внутрішніх впливів.

1. ТЕМАТИЧНИЙ ПЛАН ДИСЦИПЛІНИ

Назва змістових модулів і тем	Кількість годин, у тому числі				
	усього	л	п	лаб.	с/р
Змістовий модуль 1. Аналіз і прогнозування біржового ринку					
Сутність, роль та особливості аналізу та прогнозування біржового ринку	14	2	2		10
Інформаційні та організаційно-нормативні ресурси для аналізу біржового ринку	14	2	2		10
Фундаментальний аналіз, як основний метод дослідження біржової кон'юнктури	14	2	2		10
Макро- та мікроекономічний аналіз біржового ринку	16	4	2		10
Технічний аналіз біржового ринку	14	2	2		10
Прогнозування біржової кон'юнктури	18	4	4		10
Разом за змістовим модулем 1	90	16	14		60
Підготовка до екзамену	30				30
Усього годин	120	16	14		90

2. САМОСТІЙНА РОБОТА

ОПРАЦЮВАННЯ РОЗДІЛІВ ПРОГРАМИ, ЯКІ НЕ ВИКЛАДАЮТЬСЯ НА ЛЕКЦІЯХ:

Назва теми	Посилання на джерела
Історія виникнення фундаментального аналізу	5,7,10
Оцінка ефективності використання технічного аналізу в біржовій діяльності	1,3,5
Математичні методи у дослідженні біржових показників	5,6,7

3. ПОРЯДОК ТА КРИТЕРІЇ ОЦІНЮВАННЯ

Змістовий модуль 1. Аналіз і прогнозування біржового ринку

Максимальна оцінка за змістовий модуль 1 – 100 балів.

Оцінка поточного контролю за змістовий модуль 1 складається з:

- присутності студента на лекціях (максимальна кількість – 8 балів. 1 лекція – 1 бал);
- присутності студента на практичних заняттях (максимальна кількість – 7 балів. 1 практичне заняття – 1 бал);
- виконання студентом практичного завдання (максимальна кількість балів – 35 балів: 1 виконане практичне завдання в межах одного практичного заняття – 5 балів (за планом – 7 практичних занять): студент в повному обсязі, якісно та правильно виконав завдання, показав вміння логічно і послідовно викладати матеріал, робити висновки, наводити, де можливо, приклади з наданням фактичного матеріалу - 5 балів; відповідь і висновки до завдання студентом виконані правильно, але стисло і неповно. Завдання

виконано без наведення достатньої кількості прикладів і статистичних даних. На додаткові питання викладача студент відповідає не в повному обсязі – 4 бали; студент виконав завдання не в повному обсязі і з грубими помилками. Правильні висновки за результатами виконання завдання студент робить не самостійно, а лише з урахуванням наведених викладачем запитань. – 2-3 бали; студент не правильно та/або неякісно виконав завдання і допустив грубі помилки при формулюванні висновків не тільки при самостійному розгляді питання, але і з урахування наведених викладачем запитань – 1 бал; студент не правильно та/або неякісно виконав завдання і допустив грубі помилки при формулюванні висновків не тільки при самостійному розгляді питання, але і з урахування наведених викладачем запитань та на додаткові питання викладача студент не відповідає або відповідає з грубими помилкам – 0 балів;

– конспектування розділів програми, які не викладаються на лекціях (максимальна кількість балів 12 балів): надання повного розгорнутого конспекту – 12 балів; якщо у конспекті допущені неprincipові помилки, відсутня необхідна деталізація, студент одержує 9-11 балів; якщо у конспекті розкрито сутність питання, але допущені неправильні тлумачення, студент одержує 5-8 балів; студент не повністю розкрив сутність питання, у відповіді допущені грубі помилки – 1-4 бали; якщо у відповіді містяться принципіві помилки, або повністю відсутня відповідь – 0 балів.

– відповідь на 19 тестових запитань (1 тестове питання – 2 бали). Максимальна кількість – 38 балів.

Підсумковий контроль знань студента здійснюється у формі екзамену, що складається з 40 тестових питань та задач і оцінюється за 100 бальною шкалою (1 тестове питання – 2 бали; розв'язання задачі – 20 балів).

Критерії оцінювання правильності розв'язання задачі (максимум 20 балів):

– студент в повному обсязі, якісно та правильно виконав завдання, показав вміння логічно і послідовно викладати матеріал, робити висновки – 20 балів;

– відповідь і висновки до задачі студентом виконані правильно, але стисло і не повно. Задача розв'язана без наведення достатньої кількості формул та логічної послідовності розв'язання. На додаткові питання викладача щодо послідовності розв'язання задачі чи то використаних формул студент відповідає не в повному обсязі – 15-19 балів;

– студент розв'язав задачу не в повному обсязі, навів формули для розрахунку, одиниці виміру, пояснив логічну послідовність розв'язання задачі в цілому, але не знає які далі застосовувати формули. Правильні висновки за результатами виконаних розрахунків студент робить самостійно – 9-14 балів;

– студент розв'язав задачу з грубими помилками, не навів одиниці виміру та/або формули для розрахунку. Правильні висновки за результатами виконаних розрахунків студент робить не самостійно, а лише з урахуванням наведених викладачем запитань – 4-8 балів;

– студент не правильно та/або не якісно розв'язав задачу і допустив грубі помилки при формулюванні висновків не тільки при самостійному розгляді питання, але і з урахування наведених викладачем запитань. На додаткові питання викладача щодо базових формул що застосовуються для розрахунку показників в межах дисципліни студент відповідає – 1-3 бали;

– студент не правильно та/або не якісно розв'язав задачу і допустив грубі помилки при формулюванні висновків не тільки при самостійному розгляді питання, але і з урахування наведених викладачем запитань. На додаткові питання викладача щодо базових формул що застосовуються для розрахунку показників в межах дисципліни студент не відповідає або відповідає з грубими помилкам - 0 балів.

Підсумкова оцінка з дисципліни визначається як середня арифметична оцінка за результатами змістового модуля 1 та результатів екзамену.

4. ПОЛІТИКА КУРСУ

Політика курсу передбачає відповідальність викладача і студента за якість викладення та опанування навчального матеріалу, прозорість оцінювання, дотримання принципів академічної доброчесності. Середовище на заняттях є дружнім та відкритим до конструктивної критики.

Дотримання академічної доброчесності студентами. Студенти академії мають керуватися у своїй діяльності Кодексом академічної доброчесності ПДАБА ПЛПМ 0812-001:2018, яким встановлено загальні моральні принципи та правила етичної поведінки.

Дотримання академічної доброчесності здобувачами вищої освіти передбачає:

-самостійне виконання всіх видів робіт, завдань, форм контролю, передбачених робочою програмою навчальної дисципліни (для осіб з особливими освітніми потребами ця вимога застосовується з урахуванням їхніх індивідуальних потреб і можливостей);

-дотримання норм законодавства про авторське право і суміжні права;

-посилання на джерела інформації у разі використання ідей, розробок, тверджень, відомостей інших авторів;

-надання достовірної інформації про результати власної (наукової, творчої) діяльності, використанні методики досліджень і джерела інформації.

Дотримуємося Положення про запобігання та виявлення академічного плагіату у ПДАБА. Жодні форми порушення академічної доброчесності не толеруються. Якщо студент має сумніви або непевність, що його дії або бездіяльність можуть порушити Кодекс академічної доброчесності Академії, він може звернутися за консультацією до Комісії з питань академічної доброчесності.

Порядок зарахування пропущених занять відбувається у формі усного опитування (якщо пропущена лекція) та виконання індивідуального розрахункового завдання (якщо пропущене практичне заняття).

5. РЕКОМЕНДОВАНА ЛІТЕРАТУРА

Основна

1. Біржовий товарний ринок: навч. посіб. За ред. М.О. Солодкого. Київ: Компринт, 2017. 482 с.

2. Лутай Л.А., Козицька Г.В. Теоретичні аспекти аналізу та прогнозування цін на біржових ринках. Економічний вісник Донбасу. 2011. № 3 (25). URL: http://www.evd-journal.org/download/2011/2011-3/Ek_visnyk_3_2011-145-148.pdf

3. Підгорний А.З., Самоєнкова О.В. Методологія статистичного дослідження біржової діяльності: навч. посіб. Одеса: ФОП Гуляєва В.М., 2018. 170 с. URL: <http://dspace.oneu.edu.ua/jspui/bitstream/123456789/7768/1/Методологія%20статистичного%20дослідження%20біржової%20діяльності.pdf>

4. Підприємництво, торгівля та біржова діяльність: підручник. За заг. ред. І.М. Сотник, Л.М. Таранюка. Суми: Університетська книга, 2018. 572 с. URL: <http://sites.znu.edu.ua/science-earth/assets/documents/principles/Pidruchnyk-Pidpryyemnytstvo-torhivlya-birzhovadiyalnist.pdf>

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

6. Солодкий М.О., Резнік Н.П., Яворська В.О. Основи біржової діяльності: навч. посіб. За ред. М.О. Солодкого. К.: ЦП Компринт, 2017. 450 с.

7. Сохацька О., Роговська-Іщук І., Вінницький С. Фундаментальний та технічний аналіз цін товарних та фінансових ринків. К.: Кондор, 2012. 305 с. URL: <http://dspace.wunu.edu.ua/bitstream/316497/608/1/Fumdanentalnyy%20ta%20technichnyy%20analiz.pdf>

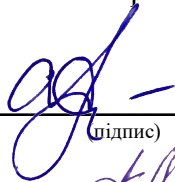
Допоміжна

8. Хеджування ф'ючерсами й опціонами: навч. посіб. За ред. М.О. Солодкого. Київ: Компринт, 2018. 398 с.
9. Вавдійчук І.М. Сучасний стан та тенденції розвитку біржової торгівлі в Україні. Миколаївський національний університет ім. В.О. Сухомлинського. 2017. Вип. 15. С. 182 – 185. URL: <http://global-national.in.ua/archive/15-2017/36.pdf>
10. Дяченко Ю.А. Розвиток методів прогнозування динаміки біржових цін на сільськогосподарські товари. Науковий вісник Ужгородського національного університету. 2018. Вип. 19. Ч1. С. 142 – 146. URL: http://www.visnyk-econom.uzhnu.uz.ua/archive/19_1_2018ua/33.pdf
11. Поліщук В.С. Прогнозування та розвиток ринку цінних паперів. Причорноморські економічні студії. 2016. Вип.10. С. 224 – 228. URL: <http://bses.in.ua/journals/2016/10-2016/48.pdf>
12. Резнік Н. П., Ярмолюк А.В. Прогнозування поведінки біржового ф'ючерсного ринку сільськогосподарської продукції. Український журнал прикладної економіки. 2020. Том 5. № 3. С. 233 – 242. URL: http://ujae.org.ua/wp-content/uploads/2021/05/ujae_2020_r03_a25.pdf
13. John Hull. Options, Futures and Other Derivative Securities. 9-edition- New Jersey, University of Toronto, Prentice Hall, Englewood Cliffs, 2015. 852p.
14. Research Department, Commodities Unit IMF. Commodity Market Monthly. 2017. URL: <http://imf.org/commodities>

6. ІНТЕРНЕТ-РЕСУРСИ

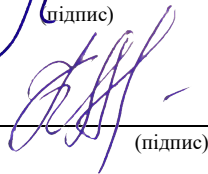
1. Агенство з розвитку інфраструктури фондового ринку України – <https://smida.gov.ua/about>
2. Державна служба статистики України – <http://www.ukrstat.gov.ua>
3. Офіційний сайт Національної бібліотеки України ім. В. І. Вернадського – <http://www.nbu.gov.ua>
4. Офіційний сайт Національної комісії з цінних паперів та фондового ринку – <https://www.nssmc.gov.ua>
5. Офіційний сайт Національного депозитарію України – <https://csd.ua>
6. Офіційний сайт Національного Банку України – <https://bank.gov.ua>
7. Офіційний сайт Української біржі – <http://www.ux.ua>

Розробник _____


(підпис)

(Ганна СТУПНІКЕР)

Гарант освітньої програми _____


(підпис)

(Кіра СПІРІДОНОВА)

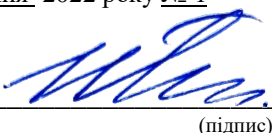
Силабус затверджено на засіданні кафедри

_____ Фінансів, економіки та підприємництва _____

(назва кафедри)

Протокол від «22» серпня 2022 року № 1

Завідувач кафедри _____


(підпис)

(Ірина ПОПОВИЧЕНКО)