

Силабус навчальної дисципліни

Фінансовий ринок



Ступінь вищої освіти: бакалавр

Галузь знань: 07 Управління та адміністрування

Спеціальність: 072 Фінанси, банківська справа та страхування

Освітньо – професійна програма “Фінанси, банківська справа та страхування”

Кафедра фінансово – економічних дисциплін

Рік навчання: II, семестр

Дні занять: згідно розкладу

Консультації: згідно графіку

Кількість кредитів: 3,0

Загальний обсяг годин -90 (аудиторних – 51 , самостійна робота – 39)

Підсумковий контроль: залік

Мова викладання: українська

Викладач кандидат економічних наук Бабій Віталій Миколайович

Контактна інформація vitamia1947@gmail.com

Опис дисципліни

Дисципліна «Фінансовий ринок» є дисципліною вибіркової компоненти навчального плану, циклу **професійної підготовки**, яка спрямована на формування у студентів теоретико-методологічних засад функціонування фінансового ринку як економічного простору, де формуються і функціонують відносини купівлі - продажу фінансових інструментів, цінних паперів як інструменту фінансового ринку.

Студенти отримують практичні навички в проведенні фінансових розрахунків по цінним паперам, кредитам, визначенню валютного курсу.

Структура курсу

Годин (лек./с ем.)	Тема	Результати навчання	Завдання
2/2	Фінансовий ринок: сутність, функції та роль в економіці	знати: роль фінансового ринку як економічного простору, на якому формуються відносини купівлі-продажу фінансових фондів, місце фінансового ринку у фінансовій системі, структуру фінансового ринку: фондовий ринок, грошовий ринок, ринок банківських позичок, функції фінансового ринку	Тести, питання
2/2	Регулювання фінансового ринку	знати: розвиток законодавчого регулювання фінансового ринку в країнах з розвинутою ринковою економікою (на прикладі США та Великобританії), міжнародні стандарти регулювання фінансового ринку, рекомендації Групи 30 щодо введення єдиних міжнародних стандартів фінансових ринків. міжнародне співробітництво з регулювання фінансових ринків, резолюції	Тести, індивідуальна практична робота

		Міжнародної організації комісій з цінних паперів (IOSCO), регулювання фондового ринку в країнах — учасниках Європейського Союзу.	
2/2	Фінансові інструменти	знати: суть і види фінансових інструментів, їх характеристику; оцінювання фінансових інструментів; сутність портфеля фінансових інструментів; еволюцію сучасної портфельної теорії, оцінювання характеристик портфеля.	Тести, індивідуальна практична робота
-/2	Фінансові посередники	знати: поняття інфраструктури фінансового ринку, її склад; значення інфраструктури для розвитку фінансового ринку, систему інфраструктури фінансового ринку в Україні, фінансові інститути як посередники між суб'єктами фінансового ринку, значення фінансового посередництва: деномінація заощаджень, приймання ризику неповернення виданої позички та виплати процентів, інформаційне забезпечення, консолідація ризиків та ефект росту масштабів угод.	Тести, індивідуальна практична робота
2/2	Організація діяльності на кредитному ринку	знати: сутність та структуру ринку капіталів, суть і функції кредиту, класифікацію банківського кредиту, цінні папери, як головний інструмент фінансового ринку, їх характеристику та види, сутність та класифікацію акцій, сутність та класифікацію облігацій, доходність облігацій.	Тести, питання
2/2	Організація діяльності на валютному ринку	знати: поняття і структуру валютного ринку, сутність валютних операцій, механізм валютної інтервенції, валютний курс, валютне регулювання та валютний контроль, порядок здійснення операцій на міжбанківському валютному ринку	Тести, питання
2/4	Організація фондового ринку	знати: основи організації фондових бірж, права та обов'язки учасників фондових бірж, типи фондових бірж. класифікацію: «Бики» та «ведмеді», брокери та дилери у біржовій грі, процедуру лістингу, сутність простого та безперервного аукціону, основні схеми укладання угод на біржі. Історія розвитку фондових бірж, розвиток фондових бірж в Україні.	Тести, індивідуальна практична робота
2/2	Боргові цінні папери	знати: облігації як основний вид боргових цінних паперів; основні види, ціни облігацій; конвертовані, державні облігації; операції з облігаціями.	Тести, питання
2/2	Похідні цінні папери	знати: сутність та характеристику форвардних та ф'ючерсних угод, основні принципи ціноутворення на форвардні і ф'ючерсні контракти, відмінності форвардів від ф'ючерсів, визначення та види опціонів та свопів, дохідність опціонів, характеристику процентних свопів.	Тести, індивідуальна практична робота
2/2	Ризик та ціна капіталу	знати: механізм ціноутворення на фінансовому ринку, структуру процентних ставок фінансового ринку, дохід і ризик цінного папера, теорії структури процентних ставок (неупередженого очікування, переваги ліквідності, сегментації ринку), розвиток теорій ризику, причини появи та розвитку теорій ризику.	Тести, питання
-/2	Інфраструктурні учасники фондового ринку	знати: організацію та функціонування депозитарних установ; національний депозитарій України; розрахунково – клірингову діяльність депозитаріїв.	Тести, індивідуальна практична робота
2/1	Фондові індекси та рейтинги	знати: індексну оцінку фондового ринку; фондові індекси деяких ринків; рейтингову оцінку цінних паперів; міжнародні рейтингові агентства.	Практична робота, тести

Список використаних джерел

1. Базилевич В. Д. Цінні папери : навчальний посібник / В. Д. Базилевич. – Київ : Ліра, 2013. – 791 с.
2. Базилевич В.Д., Шелудько В.М., Вірченко В.В. та ін. Фондовий ринок: підручник / за ред. В.Д.Базилевич. Книга 1. К.:Знання, 2015. 621с.
3. Коваленко Ю. М. Фінансовий ринок : підручник / Ю. М. Коваленко. – Ірпінь, 2018. – 441 с.
4. Лютий І.О., Боринець С.Я., Варналій З.С. та ін. Фінанси: підручник /І.О.Лютий. К.:Вид-во Ліра-К.,2017.728с.
5. Нікола С.О. Фінанси підприємств: навч.посібник/ С.О.Нікола. Одеса:Одес.нац.ун-т ім. І.І.Мечнікова,2020.206с.
6. Поважний О. С. Цінні папери і фондовий ринок : навчальний посібник / О. С. Поважний. – Київ : Ліра, 2014. – 364 с.
7. Черкасова С. В. Фінансовий ринок : навчальний посібник / С. В. Черкасова. – Київ : Ліра, 2014. – 336 с
8. Шелудько В. М. Фінансовий ринок : підручник / В. М. Шелудько. – Київ : Ліра, 2015. – 535 с.
9. Шкварчук Л. О. Фінансовий ринок : навчальний посібник / Л. О. Шкварчук. – Київ : Ліра, 2018. – 382 с
10. Школьник І.О., Васильєва Т.А., Леонов С.В. та ін. Проблеми і перспективи розвитку фінансової системи України: монографія. Суми: СумДУ, 2017.343с.

Політика оцінювання

Роботи, які здаються із порушенням термінів без поважних причин, оцінюються на нижчу оцінку (вказати на скільки).

Робота на практичних заняттях (усне опитування, тестування, розв'язування задач, оформлення бланків документів, участь у навчальній дискусії, доповідь з презентацією) максимальна оцінка 6 балів.

Модульна контрольна робота максимальна оцінка 10 балів.

Перездача модульних контрольних робіт відбувається із дозволу декана факультету за наявності поважних причин.

Самостійна робота включає в себе теоретичне вивчення питань, що стосуються тем лекційних занять, які не ввійшли в теоретичний курс.

Усі завдання, передбачені програмою, мають бути виконані

Індивідуальні розрахункові роботи перевіряються на відповідність варіанту роботи, отриманого кожним студентом, і захищаються студентами.

Списування під час модульних контрольних робіт та екзаменів заборонені (в т. ч. із використанням мобільних пристроїв).

Мобільні пристрої дозволяється використовувати лише під час он-лайн тестування (освітня платформа «Калаборатор»).

За об'єктивних причин (наприклад, хвороба), навчання може відбуватись в он-лайн формі за погодженням із викладачем та деканом факультету.

У другому семестрі передбачено два змістовних модулі. За перший модуль студент може набрати максимально 30 балів, за другий – 50 балів (разом за семестр – 80 балів). Мінімальний допусковий бал – 35.

Розподіл балів (поточний контроль, тестування, МКР)															
Змістовий модуль 1					Змістовий модуль 2									Залік	
T1	T2	T3	T4	Мкр.	T5	T6	T7	T8	T9	T10	T11	T12	Мкр.		
5	5	5	5	10	5	5	5	5	5	5	5	5	5	10	20
30					50									20	
100															

Оцінювання

ECTS	Бали	Зміст
A	90-100	відмінно
B	85-89	добре
C	75-84	добре
D	65-74	задовільно
E	60-64	достатньо
FX	35-59	незадовільно з можливістю повторного складання
F	1-34	незадовільно з обов'язковим повторним курсом

Розробник силябусу навчальної дисципліни

В.М. Бабій

Завідувач кафедри

Н.В.Євдокимова

Силябус затверджено на засіданні кафедри фінансово-економічних дисциплін
31.08.2020 р., протокол № 1.