

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ

**ХАРКІВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ ЕКОНОМІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ІМЕНІ СЕМЕНА КУЗНЕЦЯ**

Затверджено на засіданні кафедри
Статистики та економічного
прогнозування.
Протокол № 7 від 19.01.2016 р.

**Програма
навчальної дисципліни
"ФІНАНСОВА АНАЛІТИКА МІЖНАРОДНОГО
БІЗНЕСУ"
для студентів усіх спеціальностей
усіх форм навчання**

Укладачі: професор, д.е.н., Стрижиченко К.А,

Відповідальний за випуск
зав. каф. професор, д.е.н., Раєвнева О.В.

ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2016

1. Вступ

В процесі вивчення дисципліни розглядається сучасне поняття фінансового ринку, який являє собою систему економічних та правових відносин, пов'язаних із купівлею-продажем або випуском в обіг фінансових активів, його структура, основні сегменти та фінансові інструменти. Послідовно розкриваються різні складові фінансового ринку та властиві для кожної з них методи кількісної статистичної оцінки, основні показники та прийоми проведення досліджень.

Навики володіння методами фінансової аналітики дають можливість описати тенденції та закономірності розвитку фінансової сфери як на макро-, так і на мікрорівнях, виявити і кількісно оцінити вплив окремих факторів на явище чи процес, що досліджується, скласти обґрунтований прогноз його розвитку, який становитиме базу для розробки подальших дій відповідних господарських структур стосовно поліпшення економічного становища і вирішення поточних і майбутніх проблем.

Метою є формування у студентів системи теоретичних знань та практичних навичок щодо аналізу і прогнозування кон'юнктури фінансового ринку та окремих його сегментів, визначення привабливих фінансових інструментів та формування оптимальних портфелів фінансових паперів

Основними завданнями є:

- узагальнення інформації, щодо поняття та ролі фінансового ринку в розвитку економіки;
- вивчення методів фінансових розрахунків щодо інструментів фінансового ринку;
- дослідження ринків цінних паперів та похідних фінансових інструментів;
- узагальнення та аналіз методичних принципів статистичного дослідження грошового ринку;
- проведення оцінки ризиків фінансового ринку для відповідного прийняття управлінських рішень;
- дослідження ринків кредитних ресурсів та банківських послуг.

Об'єктом навчальної дисципліни є фінансовий ринок та його

сегменти.

Предметом навчальної дисципліни є інструменти фінансового ринку та пов'язані з ними моделі визначення їх привабливості.

Пререквізити: вивчення даної навчальної дисципліни студент розпочинає, прослухавши такі навчальні дисципліни, як: "Макроекономіка", "Мікроекономіка", "Оптимізаційні методи та моделі", "Економетрика", "Статистика".

У результаті вивчення навчальної дисципліни студент повинен:

знати:

основи функціонування фінансового ринку, взаємозв'язок різних його сегментів, призначення кожного з них;

основи функціонування ринку основних фінансових інструментів; статистичні показники їх оцінювання;

основні види похідних фінансових інструментів, статистичні методи оцінювання строкових угод та формування різних стратегій на ринку строкових угод;

методи фінансових обчислювань, які необхідні для розрахунку статистичних показників на різних видах фінансових ринків;

статистичне забезпечення функціонування ринку цінних паперів;

статистичне забезпечення ринку грошей;

статистичне забезпечення функціонування ринку банківських послуг.

вміти:

застосовувати отримані знання для обробки та аналізу інформації про окремі показники оцінки фінансових процесів;

робити висновки про сучасний стан ринків фінансових активів та вміти прогнозувати майбутній розвиток подій, використовуючи статистичну інформацію;

вільно оперувати навичками фінансових розрахунків по фінансовим інструментам

формувати адекватні прогнози розвитку сегментів фінансового ринку

приймати ефективні управлінські рішення щодо поведінки суб'єктів

господарювання на фінансовому ринку

У процесі викладання навчальної дисципліни основна увага приділяється оволодінню студентами професійною компетентністю, що наведена в табл. 1.

Таблиця 1

Професійна компетентність, яка отримується студентами після вивчення навчальної дисципліни

| Назва компетентності | Складові компетентності |
|--|---|
| Здатність до цілісного уявлення основних засад функціонування фінансового ринку та окремих його складових. | Знання основ побудови та функціонування фінансового ринку в ринковій економіці; |
| | Здатність проводити фінансові розрахунки для визначення основних характеристик фінансових активів; |
| | Здатність працювати з ринковою інформацією та робити висновки; |
| | Здібність виділяти серед різноманітних пропозицій щодо вирішення проблеми інформацію, яка дозволяє це здійснити; |
| Здатність до цілісного розуміння сутності та видів основних інструментів ринку цінних паперів та найважливіших засад щодо оцінки ринку, на якому вони звертаються . | Проводити фінансові розрахунки щодо визначення основних характеристик акцій та облігацій; |
| | Здатність проводити розрахунки по визначенню індикаторів фондового ринку; |
| | Вміти проводити статистичний аналіз ринку цінних паперів. |
| Здатність до цілісного розуміння сутності та видів похідних інструментів фінансового ринку. | Знання щодо похідних інструментів ринку цінних паперів; Знання щодо основних характеристик ф'ючерсних та форвардних угод та опціонних угод; |
| | Вміння проводити порівняння різних стратегій хеджування ризиків за допомогою строкових угод. |
| | Здатність проводити фінансові розрахунки щодо визначення основних характеристик ф'ючерсних, форвардних та опціонних угод; |
| Здатність до проведення економіко-статистичного аналізу окремих частин фінансового ринку | Здатність проводити економіко-статистичний грошового ринку; |
| | Здатність проводити економіко-статистичний аналіз ринку кредитних ресурсів; |
| | Здатність проводити розрахунки щодо фінансових інструментів з врахуванням властивого їм ризику; |
| | Формування навичок розрахунку основних характеристик інструментів грошового ринку, ринку кредитних ресурсів та банківських послуг; . |

Структуру складових професійних компетентностей та їх формування відповідно до Національної рамки кваліфікацій України наведено в таблиці 2.

**Структура складових професійних компетентностей з навчальної дисципліни
"ФІНАНSOVA АНАЛІТИКА МІЖНАРОДНОГО БІЗНЕСУ"
за Національною рамкою кваліфікацій України**

| Складові компетентності, яка формується в рамках теми | Пререквізити | Знання | Вміння | Комунікації | Автономність і відповідальність |
|---|--|---|---|---|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| Тема 1. Поняття та роль фінансового ринку в розвитку міжнародного бізнесу. | | | | | |
| Здатність проводити фінансові розрахунки для визначення основних характеристик фінансових активів; Здатність визначати об'єкт, предмет та завдання дослідження банківської системи. | Сутність поняття фінансового ринку та його складових | Знання основ побудови та функціонування фінансового ринку в ринковій економіці; | Визначати складові фінансового ринку | Досліджувати взаємодію складових фінансового ринку | Відповідальність за точну ідентифікацію причин та наслідків взаємодії |
| Тема 2. Методи фінансових розрахунків щодо інструментів фінансового ринку. | | | | | |
| Здатність проводити фінансові розрахунки щодо визначення основних характеристик акцій та облігацій; | Поняття інструментів фінансового ринку | Знання щодо основних інструментів ринку цінних паперів | Проведення фінансових розрахунків. Визначення привабливих фінансових інструментів | Презентувати результати визначення найбільш привабливих фінансових інструментів | Відповідальність за визначення найбільш привабливих фінансових інструментів |

| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
|---|---|--|--|---|--|
| Тема 3. Статистичне забезпечення міжнародного ринку цінних паперів. | | | | | |
| Здатність проводити розрахунки по визначенню індикаторів фондового ринку; | Фондовий ринок та його інструменти | Поняття щодо фондового ринку та концепцій щодо його дослідження; | Вміння проводити статистичний аналіз ринку цінних паперів. | Презентувати результати побудови економіко-математичних моделей | Самостійно приймати ефективні управлінські рішення |
| Тема 4. Ринок похідних фінансових інструментів. | | | | | |
| Здатність проводити порівняння різних стратегій хеджування ризиків за допомогою строкових угод. | Стратегії хеджування | Знання щодо основних характеристик опціонних угод; | Вміння проводити порівняння різних стратегій хеджування ризиків за допомогою строкових угод. | Презентувати результати дослідження | Самостійно приймати ефективні управлінські рішення |
| Тема 5. Статистичне дослідження грошового ринку. | | | | | |
| Здатність проводити економіко-статистичний грошового ринку; | Визначення поняття "прогнозування" та його основних принципів | Знання щодо сутності та основних засад функціонування грошового ринку та його інструментів | Будувати прогностичні моделі грошового ринку, валютного курсу | Презентувати результати побудови прогностичних моделей | Самостійно приймати ефективні управлінські рішення |

| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
|--|---|---|---|--|---|
| Тема 6. Оцінка та управління ризиками фінансового ринку. | | | | | |
| . Здатність проводити розрахунки щодо фінансових інструментів з врахуванням властивого їм ризику. | Поняття невизначеності. Причини виникнення та види невизначеності | Знання щодо концепції ризику, як невід'ємної характеристики операцій на фінансовому ринку | Визначати та формалізувати природу невизначеності. Визначати взаємозв'язок невизначеності та ризику. Здійснювати вибір математичного методу формалізації невизначеності | Презентувати результати формалізації невизначеності. Здатність до групової взаємодії в процесі з'ясування причин виникнення невизначеності | Приймати рішення в умовах невизначеності та відповідати за точність і коректність результатів |
| Тема 7. Статистичне дослідження ринку кредитних ресурсів. | | | | | |
| ; Здатність проводити економіко-статистичний аналіз ринку кредитних ресурсів; | Сутність кредитного ринку та його інструменти | Знання щодо сутності та основних засад функціонування ринку кредитних ресурсів та його інструментів | Будувати прогностичні моделі кредитного ринку, обсягу депозитів та кредитів | Презентувати результати побудови моделей | Самостійно приймати ефективні управлінські рішення |
| Тема 8. Статистичне дослідження ринку банківських послуг. | | | | | |
| Формування навичок розрахунку основних характеристик інструментів грошового ринку, ринку кредитних ресурсів та банківських послуг. | Визначення понять банківський ринок | Знання щодо сутності та основних засад ринку банківських послуг. | Формування навичок розрахунку основних характеристик інструментів грошового ринку, ринку кредитних ресурсів та банківських послуг. | Презентувати результати побудови моделей | Самостійно приймати ефективні управлінські рішення |

На вивчення навчальної дисципліни відводиться 150 годин (5 кредитів ЄКТС). Форма підсумкового контролю – залік.

2. Програма навчальної дисципліни

Тема 1. Поняття та роль фінансового ринку в розвитку міжнародного бізнесу.

1.1. Сутність і значення фінансового ринку в ринковій економіці.

Поняття щодо фінансового ринку та його ролі в ринковій економіці. Предмет, мета та завдання статистики фінансових ринків. Роль статистичних досліджень в аналізі процесів та явищ на фінансовому ринку.

1.2. Сегментація фінансового ринку та його структура. Інформаційно-методичне забезпечення дослідження фінансового ринку.

Сегментація фінансового ринку. Класифікація фінансового ринку. Дослідження структури фінансового ринку. Роль статистичних досліджень в аналізі різних видів фінансових ринків. Інформаційно-методичне забезпечення дослідження фінансового ринку. Основні джерела статистичної інформації. Методи роботи з різними видами інформації.

1.3. Визначення та види фінансових активів, їх властивості.

Загальна характеристика активів, які звертаються на фінансовому ринку. Поняття щодо основних фінансових інструментів. Поняття про похідні фінансові інструменти.

Тема 2. Методи фінансових розрахунків щодо інструментів фінансового ринку.

2.1. Статистичне оцінювання основних фінансових інструментів.

Ринок капіталів: власний та позичковий капітал. Цінні папери, як основні інструменти фінансових ринків. Система статистичних показників оцінювання основних фінансових інструментів.

2.2. Статистичні характеристики оцінювання облігацій.

Види облігації, їх використання в економіці. Показники статистичного оцінювання характеристик облігацій. Оцінювання вартості облігацій, їх дохідності та ризиковості.

2.3. Статистичні характеристики оцінювання акцій.

Види акцій, їх використання в економіці. Показники статистичного оцінювання характеристик акцій. Оцінювання вартості акцій, їх дохідності та ризиковості.

Тема 3. Статистичне забезпечення міжнародного ринку цінних паперів.

3.1. Ринок цінних паперів як об'єкт статистичних досліджень.

Об'єкт, предмет та задачі статистики цінних паперів. Система статистичних показників. Основи функціонування фондового ринку. Фондові ринки та фондові біржі світу. Фондовий ринок України.

3.2. Індикатори ринку цінних паперів. Розрахунок фондових індексів та фондових середніх.

Поняття про фондові індекси та фондові середні. Методи розрахунків найбільш відомих у світі індексів. Фондові індекси українського ринку. Аналіз ринку за допомогою індикаторів.

3.3. Статистичний аналіз ринку цінних паперів. Фундаментальний та технічний аналіз.

Статистичне дослідження динаміки змін показників фондового ринку (цінових показників окремих інструментів, індикаторів ринку в цілому). Основні принципи та статистичні інструменти. Фундаментальний та технічний аналіз ринка цінних паперів. Макроекономічні індикатори та їх використання для фундаментального аналізу. Прогнозування стану ринка. Основні теорії і принципи технічного аналізу. Статистичний інструментарій.

Тема 4. Ринок похідних фінансових інструментів.

4.1. Статистичне оцінювання похідних фінансових інструментів.

Визначення та суть строкових угод. Напрямки їх використання, організація ринку похідних фінансових інструментів.

4.2. Статистичне оцінювання ф'ючерсних та форвардних контрактів.

Ф'ючерсні угоди, основні показники їх оцінки. Форвардні угоди та їх характеристики. Хеджування операцій за допомогою ф'ючерсних та форвардних контрактів. Визначення фінансових результатів від строкових угод.

4.3. Статистичне оцінювання опціонних контрактів.

Ринок опціонів, види опціонів. Оцінювання дохідності опціонних контрактів. Формування різних біржових стратегій на ринку строкових угод.

Змістовний модуль 2.

Ринок кредитних ресурсів та банки, як основні його учасники.

Тема 5. Статистичне дослідження грошового ринку.

5.1. Організація грошового обігу в Україні.

Поняття про грошовий ринок та фінансові інструменти грошового ринку. Нормативні акти, що регламентують роботу цього ринку. Учасники ринку. Статистичні форми звітності НБУ щодо стану грошового ринку.

5.2. Основні показники статистики грошового ринку.

Макроекономічні показники аналізу грошового ринку. Види грошів. Грошові агрегати та їх використання. Статистичні показники оцінювання готівкового грошового ринку.

Тема 6. Оцінка та управління ризиками фінансового ринку.

6.1. Формування процентних ставок на фінансові активи залежно від рівню їх ризиковості.

Процентний ризик. Середні процентні ставки фінансових інструментів на фінансовому ринку. Статистичні методи їх дослідження. Чутливість фінансових інструментів до зміни процентних ставок.

Складові щодо формування процентної ставки в залежності від оцінки ризику фінансового інструменту.

6.2. Поняття та основні види ризиків. Підходи щодо оцінювання ризиків.

Види ризиків на фінансових ринках. Основні підходи щодо оцінювання ризиків. Поняття про валютний, кредитний ризику, ризик репутації. Методи управління ризиками.

6.3. Оцінка ризику портфеля інвестицій.

Ринковий ризик. Вибір стратегії на фінансовому ринку з врахуванням ризику. Використання математичних методів при розрахунках вартісних характеристик фінансових інструментів та оцінці ризику. Оцінка ризику портфеля інвестицій.

Тема 7. Статистичне дослідження ринку кредитних ресурсів.

7.1. Основи статистики кредитного ринку.

Об'єкт, предмет та задачі статистики кредитного ринку. Взаємозв'язок кредитного ринку з іншими видами фінансових ринків.

7.2. Основні кредитні операції.

Кредитні операції комерційних банків на ринку України. Групи кредитів. Державний кредит. Статистичні показники щодо оцінки кредитних операцій.

Тема 8. Статистичне дослідження ринку банківських послуг.

8.1. Основи побудови та функціонування банківського ринку України.

Роль Національного банку України в організації та контролі функціонування банківського ринку. Нормативні документи, що регламентують функціонування банківського ринку. Роль комерційних банків на фінансовому ринку.

8.2. Операції комерційних банків на фінансовому ринку.

Кредитні та депозитні операції комерційних банків. Статистичне дослідження ринку основних банківських послуг.

3. Теми лабораторних занять

Лабораторне заняття – форма навчального заняття, за якої студент під керівництвом викладача особисто проводить імітаційні експерименти чи досліди з метою практичного підтвердження окремих теоретичних положень навчальної дисципліни. У ході лабораторних робіт студент набуває професійних компетенцій та практичних навичок роботи з комп'ютерним обладнанням відповідними програмними продуктами. За результатами виконання завдання на лабораторному занятті студенти оформляють індивідуальні звіти про його виконання та захищають ці звіти перед викладачем (табл. 3.1).

Таблиця 3.1

Перелік тем лабораторних занять

| Назва теми | Програмні питання |
|--|---|
| Змістовний модуль 1. Основні та похідні інструменти фінансового ринку | |
| Тема 1. Поняття та роль фінансового ринку в розвитку економіки. | Завдання 1. Побудова схеми взаємодії сегментів фінансового ринку. |
| Тема 2. Методи фінансових розрахунків щодо інструментів фінансового ринку. | Завдання 2. Дослідження методів фінансових розрахунків щодо інструментів фінансового ринку. |
| Тема 3. Статистичне забезпечення ринку цінних паперів. | Завдання 3. Визначення привабливих цінних паперів для формування портфелю ЦП |
| Тема 4. Ринок похідних фінансових інструментів. | Завдання 4. Побудова моделей визначення опціонів та ф'ючерсів |

| Змістовний модуль 2. Ринок кредитних ресурсів та банки, як основні його учасники | |
|---|---|
| Тема 5. Статистичне дослідження грошового ринку. | Завдання 5. Формування моделей для статистичне дослідження грошового ринку. |
| Тема 6. Оцінка та управління ризиками фінансового ринку. | Завдання 6. Моделі управління ризиками |
| Тема 7. Статистичне дослідження ринку кредитних ресурсів. | Завдання 7. Дослідження кредитного ринку за допомогою моделей часового ряду |
| Тема 8. Статистичне дослідження ринку банківських послуг. | Завдання 8. Побудова моделей дослідження банківського сектору |

4. Самостійна робота

Самостійна робота студента (СРС) – це форма організації навчального процесу, за якої заплановані завдання виконуються студентом самостійно під методичним керівництвом викладача.

Основні види самостійної роботи, які запропоновані студентам для засвоєння теоретичних знань та формування практичних навичок з навчальної дисципліни, наведені в табл. 4.1.

Таблиця 4.1

Завдання для самостійної роботи студентів та форми її контролю

| Назва теми | Зміст самостійної роботи студентів | Форми контролю СРС |
|--|--|-------------------------|
| 1 | 2 | 4 |
| Змістовний модуль 1. Основні та похідні інструменти фінансового ринку | | |
| Тема 1. Поняття та роль фінансового ринку в | Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до лабораторного заняття. Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою. Підготовка за питаннями: 1. Нормативна база щодо організації | Презентація результатів |

| | | |
|---|---|-------------------------|
| міжнародному бізнесі. | <p>фінансового ринку України та окремих його складових.</p> <p>2. Поточна статистична інформація про індикатори фінансового ринку. Методи роботи з інформацією.</p> | |
| Тема 2. Методи фінансових розрахунків щодо інструментів фінансового ринку. | <p>Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до лабораторного заняття. Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою.</p> <p>Підготовка за питаннями:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Статистичне оцінювання державних цінних паперів. 2. Статистичні характеристики оцінювання векселів. 3. Економіко-математичні методи оцінювання вартісних характеристик основних цінних паперів | Презентація результатів |
| Тема 3. Статистичне забезпечення міжнародного ринку цінних паперів. | <p>Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до лабораторного заняття. Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою.</p> <p>Підготовка за питаннями:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Нормативна база щодо організації статистичної звітності про роботу ринку цінних паперів. Обробка інформації. 2. Економіко-математичні методи аналізу динамічних рядів даних щодо роботи ринку цінних паперів та окремих його інструментів. 3. Методи технічного аналізу ринку цінних паперів | Презентація результатів |
| Тема 4. Ринок похідних фінансових інструментів. | <p>Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до лабораторного заняття. Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою.</p> <p>Підготовка за питаннями:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Стан розвитку ринку похідних фінансових інструментів в Україні. 2. Організація торгівлі ф'ючерсами на біржі. 3. Робота з пакетами опціонів, формування стратегії на ринку за допомогою опціонів. 4. Економіко-математичні методи оцінювання похідних фінансових інструментів | Презентація результатів |
| Змістовний модуль 2. Ринок кредитних ресурсів та банки, як основні його учасники | | |
| Тема 5. Статистичне дослідження грошового ринку. | <p>Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до лабораторного заняття. Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою.</p> <p>Підготовка за питаннями:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Вивчення нормативних документів, які регламентують діяльність суб'єктів грошового ринку. 2. Операції комерційних банків з готівкою | Презентація результатів |

| | | |
|--|--|--------------------------------|
| <p>Тема 6. Оцінка та управління ризиками фінансового ринку.</p> | <p>Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до лабораторного заняття. Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою. Підготовка за питаннями: 1. Вивчення нормативної бази, яка визначає стратегію управління ризиками при роботі на фінансовому ринку. 2. Економіко-математичні методи оцінювання ризику. 3. Оцінювання ризику окремих фінансових інструментів</p> | <p>Презентація результатів</p> |
| <p>Тема 7. Статистичне дослідження ринку кредитних ресурсів.</p> | <p>Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до лабораторного заняття. Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою. Підготовка за питаннями: 1. Вивчення нормативної бази щодо організації та функціонування кредитного ринку. 2. Сутність та методи здійснення кредитних операцій банками</p> | <p>Презентація результатів</p> |
| <p>Тема 8. Статистичне дослідження ринку банківських послуг.</p> | <p>Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до лабораторного заняття. Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою. Підготовка за питаннями: 1. Стратегія функціонування банку на банківському ринку. 2. Підходи к оцінюванню ринка банківських послуг за різними видами показників</p> | <p>Презентація результатів</p> |

5. Методи навчання

У процесі викладання навчальної дисципліни для активізації навчально-пізнавальної діяльності студентів передбачене застосування як активних, так і інтерактивних навчальних технологій, серед яких: лекції проблемного характеру, міні-лекції, робота в малих групах, семінари-дискусії, мозкові атаки, кейс-метод, презентації, ознайомлювальні (початкові) ігри, метод проектної роботи, комп'ютерні симуляції, метод Дельфі, метод сценаріїв, банки візуального супроводу (табл. 7.1 і 7.2).

**Розподіл форм та методів активізації процесу навчання
за темами навчальної дисципліни (лекційні заняття)**

| Тема | Практичне застосування навчальних технологій |
|--|---|
| 1 | 2 |
| Тема 1. Поняття та роль фінансового ринку в міжнародному бізнесі. | <i>Проблемна лекція</i> з питання «Перспективи розвитку фінансового ринку України. Взаємозв'язок фінансового ринку України та світового фінансового ринку». |
| Тема 2. Методи фінансових розрахунків щодо інструментів фінансового ринку. | <i>Міні-лекція, семінар-дискусія</i> з питання «Методи роботи з основними фінансовими інструментами в сучасних умовах України». <i>Презентація роботи в малих групах.</i> |
| Тема 3. Статистичне забезпечення міжнародного ринку цінних паперів. | <i>Міні-лекція, семінар-дискусія</i> з питання «Формування бізнес-стратегії на ринку цінних паперів». <i>Презентація роботи в малих групах.</i> |
| Тема 4. Ринок похідних фінансових інструментів. | <i>Міні-лекція, семінар-дискусія</i> з питання «Фактичне використання похідних фінансових інструментів на фінансовому ринку України та перспективи розвитку ринку похідних фінансових інструментів». <i>Презентація роботи в малих групах.</i> |
| Тема 5. Статистичне дослідження грошового ринку. | <i>Проблемна лекція</i> з питання: «Стан грошового ринку, методи монетарної політики держави щодо управління грошовим ринком». |
| Тема 6. Оцінка та | <i>Проблемна лекція</i> з питання: |

| | |
|---|---|
| управління ризиками фінансового ринку. | «Управління фінансовими ризиками, впровадження підходів ризик-менеджменту у поточну діяльність фінансових установ». |
| Тема 7. Статистичне дослідження ринку кредитних ресурсів. | <i>Проблемна лекція</i> з питання: «Державний борг України. Перспективи взаємодії фінансової системи країни зі світовими фінансовими організаціями». |
| Тема 8. Статистичне дослідження ринку банківських послуг. | <i>Міні-лекція, семінар-дискусія</i> з питання «Сучасні банківські операції та напрямки перспективного розвитку ринку банківських операцій». <i>Презентація роботи в малих групах.</i> |

8. Рекомендована література

8.1. Основна

1. Стрижиченко К.А. Державне регулювання фінансового ринку в умовах нової економіки. Бердянськ, ФО-П Ткачук О.В., 2013. – 384 с.
2. Шелудько В.М. Фінансовий ринок: Навчальний посібник. – К.: Знання-Прес, 2002. – 535 с.
3. Статистика финансов: Учебник/ под ред. Проф. В.Н. Салина. – М.: Финансы и статистика, 2000. – 816 с.
4. Гусаров В.М. Статистика: Учебное пособие для вузов. – М.: ЮНИТИ – ДАНА, 2001. – 463 с.
5. Молдавська О.В. Статистика фінансового ринку. Конспект лекцій для студентів спеціальності 6.050110 „Економічна статистика” всіх форм навчання. – Х.: Вид. ХНЕУ, 2005. – 60 с.

8.2. Додаткова література

1. Закон України „Про Національний банк України”
2. Закон України „Про цінні папери та фондову біржу”
3. Закон України „Про банки та банківську діяльність”

4. Закон України „Про державний внутрішній борг України”
5. Інструкція про касові операції в банках України. Постанова Правління Національного банку України від 14 серпня 2003 року N 337.
6. Положення про ведення касових операцій у національній валюті в Україні. Постанова Правління Національного банку України від 15 грудня 2004 року N 637.
7. Правила організації статистичної звітності, що подається до Національного банку України. Постанова Правління Національного банку України від 19 березня 2003 року N 124.
8. Есипов В.Е. Ценообразование на финансовом рынке. – Спб: Из-во “Питер”, 2000. – 176 с.
9. Ценные бумаги: Уч. – М.: Финансы и статистика, 2001. – 448 с.
10. Найман Э.-Л. Малая энциклопедия трейдера. - К.: Альфа Капитал: Логос, 1997. – 236 с.
11. Уотшем Т.Дж., Паррамоу К. Количественные методы в финансах: Учеб. Пособие для вузов / перевод с англ. Под ред. М.Р. Ефимовой. – М.: Финансы, ЮНИТИ, 1999. – 527 с.
12. Мишкин Ф. Экономическая теория денег, банковского дела и финансовых рынков: Учеб. Пособие для вузов / пер. с англ. – М.: Аспект Пресс, 1999. – 820 с.
13. Киндуэлл Д.С., Петерсон Р.Л., Блэкуэлл Д.У. Финансовые институты, рынки и деньги. – Спб.: Изд-во “Питер”, 2000. – 725 с.
14. Четыркин Е.М. Методы финансовых и коммерческих расчетов. - 2-е изд., испр. и доп. - М.: “Дело Лтд”, 1995. - 320 с.
15. Мелкумов Я.С. Финансовые вычисления. Теория и практика: Учебно-справочное пособие. - М.: ИНФРА-М, 2002. - 383 с.
16. Колби Р.В., Мейерс Т.А. Энциклопедия технических индикаторов рынка: Пер. с англ. - М.: Издательский дом “Альпина”, 1998. - 581 с.
17. Мозговой О.Н. Фондовый рынок Украины. - К.: УАННП “Феникс”, 1998.

8.3. Інформаційні ресурси

1. Сервер Верховної Ради України // www.rada.gov.ua

2. Ліга Бізнес Інформ. www.liga.net
3. Нормативні акти України www.nau.kiev.ua
4. Сайт Національного банку України www.bank.gov.ua
5. Фінансовий сайт www.finance.com.ua
6. Фінансовий сайт www.abcd.com.ua
7. Пошуково-інформаційний сайт цінних паперів та емітентів України www.istock.com.ua
8. Банківський сервер www.uabankir.com
9. Фінансовий ринок України www.finmarket.info
10. Сайт асоціації банків України www.aub.com.ua
11. Фінансовий сайт www.ufs.kiev.ua

8.4. Методичне забезпечення

1. Робоча програма навчальної дисципліни «Статистика фінансового ринку» для студентів спеціальності «Прикладна статистика» денної форми навчання / Укл. О.В. Молдавська – Харків: Вид. ХНЕУ, 2010. – 48 с. (Укр. мов.)

2. Практичні завдання з навчальної дисципліни "Статистика фінансового ринку" для студентів спеціальності 6.030506 "Прикладна статистика" денної форми навчання / укл. О.В. Молдавська – Харків: Вид. ХНЕУ, 2014. – 56 с. (Укр. мов.)

3. Молдавська О.В. Статистика фінансового ринку. Конспект лекцій для студентів спеціальності 6.050110 „Економічна статистика” всіх форм навчання. – Х.: Вид. ХНЕУ, 2005. – 60 с.