

Назва: Моделювання фінансового ринку

Шифр: 10504

Тип: Професійна вибіркова

Рік навчання: 2019-2020

Семестр: II

Кількість кредитів ЄКТС: 5

ШБ викладачів: Стрижиченко К.А.

Результати навчання.

Здатність до цілісного уявлення основних засад функціонування фінансового ринку та окремих його складових. Здатність до цілісного розуміння сутності та видів основних інструментів ринку цінних паперів та найважливіших засад щодо оцінки ринку, на якому вони звертаються . Здатність до цілісного розуміння сутності та видів похідних інструментів фінансового ринку. Здатність до проведення економіко-статистичного аналізу окремих частин фінансового ринку. Здатність до побудови економіко-математичних моделей прогнозування розвитку індикаторів валютного, кредитного, страхового та фондового ринків. Здатність до розробки сценаріїв розвитку складових фінансового ринку. Здатність до визначення стабільності розвитку складових фінансового ринку. Здатність до формування управлінських рішень щодо поведінки агентів економічних відносин на складових фінансового ринку.

Обов'язкові попередні навчальні дисципліни

«Фінанси», «Економетрика», «Статистика».

Зміст.

Поняття економіко-математичного моделювання. Його принципи. Сучасні підходи до моделювання фінансового ринку. Класифікація моделей дослідження фінансового ринку. Оптимізаційні моделі. Модель Марковіца. Модель Шарпа. Модель Тобіна. Формування оптимальних портфелів цінних

паперів. Поняття технічного аналізу на фінансовому ринку. Гіпотеза щодо ефективного ринку. Визначення елементів технічного аналізу фінансового ринку. Моделі аналізу часових рядів. Перевірка наявності взаємозалежностей на фінансовому ринку. Дослідження коінтеграційних ефектів на фінансовому ринку. Визначення впливів елементів фінансового ринку між собою. Побудова сценаріїв розвитку фінансового ринку. Визначення циклічних складових розвитку та випадкових флуктуацій.

Рекомендовані джерела

1. Шелудько В.М. Фінансовий ринок: Навчальний посібник. – К.: Знання-Прес, 2002. – 535 с.
2. Статистика финансов: Учебник/ под ред. Проф. В.Н. Салина. – М.: Финансы и статистика, 2000. – 816 с.
3. Гусаров В.М. Статистика: Учебное пособие для вузов. – М.: ЮНИТИ – ДАНА, 2001. – 463 с.
4. Адамик Б.П. Національний банк і грошово-кредитна політика: Навчальний посібник. – Тернопіль: Карт-бланш, 2002. – 278 с.
5. Стрижиченко К.А. Державне регулювання фінансового ринку. Бердянськ, 2013 – 456 с.
6. Молдавська О.В. Статистика фінансового ринку. Конспект лекцій для студентів спеціальності 6.050110 „Економічна статистика” всіх форм навчання. – Х.: Вид. ХНЕУ, 2005. – 60 с.
7. Закон України „Про Національний банк України”
8. Закон України „Про цінні папери та фондову біржу”
9. Закон України „Про банки та банківську діяльність”
10. Закон України „Про державний внутрішній борг України”
11. Інструкція про касові операції в банках України. Постанова Правління Національного банку України від 14 серпня 2003 року N 337.
12. Положення про ведення касових операцій у національній валюті в Україні. Постанова Правління Національного банку України від 15 грудня 2004 року N 637.
13. Правила організації статистичної звітності, що подається до Національного банку України. Постанова Правління Національного банку України від 19 березня 2003 року N 124.

14. Есипов В.Е. Ценообразование на финансовом рынке. – Спб: Из-во “Питер”, 2000. – 176 с.
15. Ценные бумаги: Уч. – М.: Финансы и статистика, 2001. – 448 с.
16. Найман Э.-Л. Малая энциклопедия трейдера. - К.: Альфа Капитал: Логос, 1997. – 236 с.
17. 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.
18. Мишкин Ф. Экономическая теория денег, банковского дела и финансовых рынков: Учеб. Пособие для вузов / пер. с англ. – М.: Аспект Пресс, 1999. – 820 с.
19. Киндуэлл Д.С., Петерсон Р.Л., Блэкуэлл Д.У. Финансовые институты, рынки и деньги. – Спб.: Изд-во “Питер”, 2000. – 725 с.
20. Четыркин Е.М. Методы финансовых и коммерческих расчетов. - 2-е изд., испр. и доп. - М.: “Дело Лтд”, 1995. - 320 с.

Методи навчання:

Лекційні заняття, лабораторні заняття, тестові завдання, есе, презентації

Методи оцінювання:

Поточний контроль (активна робота на парі, захист лабораторних робіт, захист завдань, проведення поточного тестування)

Модульний контроль (письмова контрольна робота)

Підсумковий контроль (залік)

Мова навчання: українська