

Міністерство освіти і науки України
Київський національний торговельно-економічний університет
Харківський торговельно-економічний інститут КНТЕУ

Кафедра міжнародного бізнесу, фінансів та обліку

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Фінансовий ринок

повна назва навчальної дисципліни

для підготовки
студентів освітнього
ступеня

бакалавр

року набору

2017

молодший бакалавр, бакалавр
чи магістр

галузі знань

07 Управління та адміністрування

шифр і назва галузі знань

спеціальності

072 Фінанси, банківська справа та страхування

шифр і найменування спеціальності

освітня програма /
спеціалізація

Державні фінанси

назва освітньої програми / спеціалізації

академічні групи

Ф-17, ЗФ-17

шифр академічних груп

статус дисципліни

обов'язкова

обов'язкова чи вибіркова

Харків, 2020 рік

Розробник:

Ярмак Ольга Віталіївна,
доцент кафедри міжнародного бізнесу,
фінансів та обліку, кандидат економічних наук,
доцент

прізвище, ім'я, по батькові повністю, посада повністю,
науковий ступінь, вчене звання повністю

09.09.2020 р.

Керівник (гарант)
освітньої програми

Шелест Олексій Леонідович,
доцент кафедри міжнародних економічних
відносин та фінансів, кандидат економічних
наук, доцент

прізвище, ім'я, по батькові повністю, посада повністю,
науковий ступінь, вчене звання повністю

09.09.2020 р.

Програму обговорено та схвалено на засіданні кафедри
міжнародного бізнесу, фінансів та обліку

назва кафедри

протокол від 09.09.2020 р. № 1.

Програму розглянуто та затверджено на засіданні методичної комісії інституту,
протокол від 11.09.2020 р. № 1.

1. ОПИС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Робоча програма навчальної дисципліни «Фінансовий ринок» розроблена відповідно до освітньої програми підготовки бакалаврів спеціальності 072 Фінанси, банківська справа та страхування галузі знань 07 Управління та адміністрування.

Метою викладання навчальної дисципліни є формування загальних та фахових компетентностей з функціонування та розвитку фінансового ринку як підсистеми фінансових відносин.

Предметом вивчення навчальної дисципліни є фінансовий ринок як економічний простір, де формуються і функціонують відносини купівлі-продажу фінансових інструментів, цінні папери як інструмент фінансового ринку.

Міждисциплінарні зв'язки вивчення навчальної дисципліни ґрунтуються на знаннях з навчальних дисциплін «Грошово-кредитні системи зарубіжних країн», «Фінансові та кредитні системи зарубіжних країн» та є основою для подальшого засвоєння навчальної дисципліни «Міжнародні кредитно-розрахункові валютні операції».

Мова викладання – українська.

2. ЗАПЛАНОВАНІ РЕЗУЛЬТАТИ НАВЧАННЯ

Навчальна дисципліна забезпечує набуття студентами:

загальних компетентностей:

ЗК 1. Здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу, пошуку, оброблення та аналізу інформації з різних джерел;

ЗК 7. Здатність бути критичним і самокритичним.

фахових компетентностей:

ФК 1. Здатність досліджувати тенденції розвитку економіки за допомогою інструментарію макро- та мікроекономічного аналізу, оцінювати сучасні економічні явища;

ФК 5. Здатність застосовувати знання законодавства у сфері монетарного, фіскального регулювання та регулювання фінансового ринку;

ФК 11. Здатність підтримувати належний рівень знань та постійно підвищувати свою професійну підготовку.

програмних результатів навчання:

ПРН 3. Визначати особливості функціонування сучасних світових та національних фінансових систем та їх структури;

ПРН 5. Володіти методичним інструментарієм діагностики стану фінансових систем (державні фінанси, у т.ч. бюджетна та податкова системи, фінанси суб'єктів господарювання, фінанси домогосподарств, фінансові ринки, банківська система та страхування);

ПРН 7. Розуміти принципи, методи та інструменти державного та ринкового регулювання діяльності в сфері державних фінансів;

ПРН 12. Використовувати професійну аргументацію для донесення інформації, ідей, проблем та способів їх вирішення до фахівців і нефахівців у фінансовій сфері діяльності;

ПРН 13. Володіти загальнонауковими та спеціальними методами дослідження фінансових процесів;

ПРН 16. Застосовувати набуті теоретичні знання для розв'язання практичних завдань та змістовно інтерпретувати отримані результати.

3. ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Тема 1. Фінансовий ринок: сутність, функції та роль в економіці

Фінансовий ринок як економічний простір, на якому формуються відносини купівлі-продажу фінансових фондів. Структура фінансового ринку, її характеристика. Функції фінансового ринку. Суб'єкти відносин – учасники фінансового ринку: держава, інвестори, позичальники, фінансові посередники. Об'єкти фінансового ринку. Історичні та економічні особливості становлення фінансового ринку в Україні.

Тема 2. Регулювання фінансового ринку

Основи правового регулювання фінансового ринку в Україні. Необхідність державного регулювання фінансового ринку. Методи регулювання банківської діяльності, банківський нагляд, форми банківського регулювання. Регулювання валютного ринку, митний контроль в сфері валютного регулювання, методи регулювання валютного курсу. Регулювання ринку цінних паперів, характеристика вповноважених органів по регулюванню ринку цінних паперів. Правові основи регулювання банківського кредитування. Правові аспекти регулювання ринку цінних паперів.

Тема 3. Фінансові посередники

Загальне поняття фінансового посередництва. Характеристика основних типів банків. Класифікація банків. Характеристика небанківських кредитних інститутів. Діяльність контрактних фінансових інститутів.

Тема 4. Ринок капіталів

Сутність та структура ринку капіталів. Суть і функції кредиту. Банки, як основні учасники ринку капіталів. Класифікація банківського кредиту. Цінні папери, як головний інструмент фінансового ринку, їх характеристика та види. Сутність та класифікація акцій. Сутність та класифікація облігацій, доходність облігацій. Характеристика векселів, та проблеми вексельного обігу в Україні. Сутність приватизаційних та банківських цінних паперів.

Тема 5. Похідні цінні папери

Сутність та характеристика 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. Характеристика процентних свопів.

Тема 6. Ризик та ціна капіталу

Завдання і принципи ціноутворення на фінансовому ринку. Види і функції цін. Характеристика ціноутворення на різні фінансові інструменти. Методи ціноутворення. Специфіка ціноутворення на фінансовому ринку. Поняття і класифікація фінансових ризиків. Методи оцінки ризику на фінансовому ринку. Методи управління фінансовими ризиками.

Тема 7. Валютний ринок

Поняття і структура валютного ринку. Сутність валютних операцій. Валютні інтервенції. Валютний курс. Валютне регулювання та валютний контроль. Здійснення операцій на міжбанківському валютному ринку.

Тема 8. Грошовий ринок та ринок банківських позичок

Структура і суть грошового ринку. Суб'єкти і об'єкти грошового ринку. Особливості облікового ринку. Характеристика міжбанківського ринку. Операції на міжбанківському ринку.

Тема 9. Фондова біржа та біржові операції

Основи організації фондових бірж. Члени фондової біржі. Права та обов'язки учасників фондових бірж. «Бики» та «ведмеді», брокери та дилери у біржовій грі. Процедура лістингу. Простий та безперервний аукціон. Основні схеми укладання угод на біржі. Історія розвитку фондових бірж. Розвиток фондових бірж в Україні. Типи фондових бірж.

4.2. Структура навчальної дисципліни за формами навчання

Теми дисципліни	Обсяг у годинах																										
	денна форма											заочна форма															
	повна					скорочена						повна						скорочена									
	усього	у тому числі					усього	у тому числі					усього	у тому числі					усього	у тому числі							
Л		СЗ	ПЗ	ЛЗ	СРС	Л		СЗ	ПЗ	ЛЗ	СРС	Л		СЗ	ПЗ	ЛЗ	СРС	Л		СЗ	ПЗ	ЛЗ	СРС				
Тема 1. Фінансовий ринок: сутність, функції та роль в економіці	18	2		2		14										22	2		2			18					
Тема 2. Регулювання фінансового ринку	18	2		2		14										18						18					
Тема 3. Фінансові посередники	22	4		4		14										20						20					
Тема 4. Ринок капіталів	20	4		4		12										22	2		2			18					
Тема 5. Похідні цінні папери	20	4		4		12										20						20					
Тема 6. Ризик та ціна капіталу	20	2		2		16										18						18					
Тема 7. Валютний ринок	20	4		4		12										20						20					
Тема 8. Грошовий ринок та ринок банківських позичок	22	4		4		14										22	2		2			18					
Тема 9. Фондова біржа та біржові операції	20	2		2		16										18						18					
Усього годин / кредитів ECTS	180/6	28		28		124										180/6	6		6			168					

Навчальні матеріали з освітнього компоненту доступні на Порталі навчальних ресурсів та інформаційної підтримки освітнього процесу інституту:

для денної форми навчання – <https://edu.htei.kh.ua/course/view.php?id=4074>

для заочної форми навчання – <https://edu.htei.kh.ua/course/view.php?id=4073>

5. ЗАВДАННЯ ДЛЯ САМОСТІЙНОЇ РОБОТИ

Тема 1. Фінансовий ринок: сутність, функції та роль в економіці

1. Функції фінансового ринку.
2. Учасники фінансового ринку.
3. Об'єкти фінансового ринку.
4. Історичні та економічні особливості становлення фінансового ринку в Україні.

Тема 2. Регулювання фінансового ринку

1. Методи регулювання валютного курсу.
2. Регулювання ринку цінних паперів.
3. Правові основи регулювання банківського кредитування.
4. Правові аспекти регулювання ринку цінних паперів.

Тема 3. Фінансові посередники

1. Класифікація банків.
2. Характеристика небанківських кредитних інститутів.
3. Діяльність контрактних фінансових інститутів.

Тема 4. Ринок капіталів

1. Класифікація та доходність облігацій.
2. Характеристика векселів.
3. Проблеми вексельного обігу в Україні.
4. Сутність приватизаційних та банківських цінних паперів.

Тема 5. Похідні цінні папери

1. Відмінності форвардів від ф'ючерсів.
2. Визначення та види опціонів та свопів.
3. Дохідність опціонів.
4. Характеристика процентних свопів.

Тема 6. Ризик та ціна капіталу

1. Специфіка ціноутворення на фінансовому ринку.
2. Поняття і класифікація фінансових ризиків.
3. Методи оцінки ризику на фінансовому ринку.
4. Методи управління фінансовими ризиками.

Тема 7. Валютний ринок

1. Валютні інтервенції.
2. Валютний курс.
3. Валютне регулювання та валютний контроль.
4. Здійснення операцій на міжбанківському валютному ринку.

Тема 8. Грошовий ринок та ринок банківських позичок

1. Особливості облікового ринку.
2. Характеристика міжбанківського ринку.
3. Операції на міжбанківському ринку.

Тема 9. Фондова біржа та біржові операції

1. “Бики та «ведмеді», брокери та дилери у біржовій грі.
2. Процедура лістингу.
3. Простий та безперервний аукціон.

4. Основні схеми укладання угод на біржі.

Зміст, порядок виконання та критерії оцінювання самостійної роботи студентів наведено на Порталі навчальних ресурсів та інформаційної підтримки освітнього процесу інституту:

для денної форми навчання – <https://edu.htei.kh.ua/course/view.php?id=4074>
 для заочної форми навчання – <https://edu.htei.kh.ua/course/view.php?id=4073>

Організація самостійної роботи студентів регламентується наступними нормативними документами:

- Положенням про самостійну роботу студентів Харківського торговельно-економічного інституту КНТЕУ;
- Положенням про організацію освітнього процесу у Харківському торговельно-економічному інституті КНТЕУ.

6. ІНДИВІДУАЛЬНІ ЗАВДАННЯ, ПЕРЕДБАЧЕНІ НАВЧАЛЬНИМ ПЛАНОМ

Не передбачено навчальним планом

7. ФОРМИ ТА МЕТОДИ ОЦІНЮВАННЯ

Для визначення рівня засвоювання студентами навчального матеріалу використовуються наступні форми оцінювання та схема розподілу балів:

Осінь 2020/2021 н. р.

№	Рейтингові оцінки	Макс. бали за формами навчання	
		денна	заочна
1	Поточний контроль	60	60
1.1	<i>Тема 1 Фінансовий ринок: сутність, функції та роль в економіці</i>		
	Тестування на порталі	8	20
1.2	<i>Тема 2 Регулювання фінансового ринку</i>		
	Виконання практичного завдання	3	
	Тестування на порталі	3	
1.3	<i>Тема 3 Фінансові посередники</i>		
	Виконання практичного завдання	3	
	Тестування на порталі	3	
1.4	<i>Тема 4 Ринок капіталів</i>		

№	Рейтингові оцінки	Макс. бали за формами навчання	
		денна	заочна
	Виконання практичного завдання	3	10
	Тестування на порталі	4	10
1.5	<i>Тема 5 Похідні цінні папери</i>		
	Виконання практичного завдання	3	
	Тестування на порталі	3	
1.6	<i>Тема 6 Ризик та ціна капіталу</i>		
	Виконання практичного завдання	3	
	Тестування на порталі	3	
1.7	<i>Тема 7 Валютний ринок</i>		
	Виконання практичного завдання	3	
	Тестування на порталі	4	
1.8	<i>Тема 8 Грошовий ринок та ринок банківських позичок</i>		
	Виконання практичного завдання	3	10
	Тестування на порталі	4	10
1.9	<i>Тема 9 Фондова біржа та біржові операції</i>		
	Виконання практичного завдання	3	
	Тестування на порталі	4	
2	Підсумковий семестровий контроль (письмова екзаменаційна робота)	40	40
2.1	Завдання на оцінювання теоретичних знань (комп'ютерне тестування)	20	20
2.2	Завдання на оцінювання практичних навичок (розрахунково-аналітичне або ситуаційне завдання)	10	10
2.3	Завдання на оцінювання професійних вмінь (розрахунково-аналітичне або ситуаційне, або творче завдання)	10	10
3	Оцінка з дисципліни	100	100

Оцінювання результатів навчання студентів здійснюється за 100-бальною шкалою та шкалою ЄКТС. Умовою допуску до підсумкового семестрового Контролю є виконання програми навчальної дисципліни і отримання оцінки за виконання завдань поточного контролю не менше ніж 36 балів. Мінімальна загальна кількість балів для отримання позитивної оцінки з дисципліни – 60.

Організація та проведення контрольних заходів регламентується наступними нормативними документами:

- положенням про оцінювання результатів навчання студентів у Харківському торговельно-економічному інституті КНТЕУ;
- положенням про організацію освітнього процесу у Харківському торговельно-економічному інституті КНТЕУ.

9. РЕКОМЕНДОВАНІ ДЖЕРЕЛА ІНФОРМАЦІЇ

9.1. Основні джерела інформації

1. Коваленко Ю. М. Фінансовий ринок : підручник / Ю. М. Коваленко. – Ірпінь, 2018. – 441 с.
2. Шелудько В. М. Фінансовий ринок : підручник / В. М. Шелудько. – Київ : Ліра, 2015. – 535 с.

9.2. Додаткові джерела інформації

3. Шкварчук Л. О. Фінансовий ринок : навчальний посібник / Л. О. Шкварчук. – Київ : Ліра, 2013. – 382 с
4. Черкасова С. В. Фінансовий ринок : навчальний посібник / С. В. Черкасова. – Київ : Ліра, 2014. – 336 с
5. Базилевич В. Д. Цінні папери : навчальний посібник / В. Д. Базилевич. – Київ : Ліра, 2013. – 791 с.
6. Поважний О. С. Цінні папери і фондовий ринок : навчальний посібник / О. С. Поважний. – Київ : Ліра, 2014. – 364 с.