

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
Львівський національний університет імені Івана Франка
Економічний факультет
Кафедра статистики

Затверджено

на засіданні кафедри статистики
економічного факультету
Львівського національного університету ім. Івана Франка
(протокол № 1 від серпня 2021 р.)

Завідувач кафедри _____ проф. Матковський С.О.

СИЛАБУС

навчальної дисципліни «**Статистичний аналіз фінансових ринків**»,
що викладається в межах дисциплін вільного вибору студентів
другого (магістерського) рівня вищої освіти
за спеціальністю 051 «Економіка»
спеціалізації «Економічна аналітика та бізнес-статистика»

Львів - 2021 р.

| | |
|--|--|
| Назва курсу | Статистичний аналіз фінансових ринків |
| Адреса викладання дисципліни | м. Львів, пр. Свободи, 18 |
| Факультет та кафедра, за якою закріплена дисципліна | Економічний факультет, кафедра статистики |
| Галузь знань, шифр і назва спеціальності | 05 «Соціальні та поведінкові науки», 051 «Економіка», спеціалізація «Економічна аналітика та бізнес-статистика» |
| Викладач дисципліни | Миرونюк Ауріка Кузьмівна, к.е.н., доцент кафедри статистики |
| Контактна інформація викладача | aurika.myronyuk@lnu.edu.ua +38 032 239 40 29 |
| Консультації з питань навчання | Консультації проводяться згідно розкладу, затверджуються кожного семестру, а також за погодженим часом у дні практичних та лабораторних занять. |
| Сторінка курсу | https://econom.lnu.edu.ua/course/statystychnyj-analiz-finansovyh-rynkiv |
| Інформація про дисципліну | Дисципліна «Статистичний аналіз фінансових ринків» - є вибірковою компонентою ОП, викладається в 1 семестрі. |
| Коротка анотація дисципліни | Основний фокус навчальної дисципліни спрямовано на використання кількісних методів і прийомів для аналітичного дослідження економічних явищ і процесів у сфері фінансових ринків, а також теоретичні та практичні питання аналізу фінансового ринку, статистичного інструментарію його дослідження і прогнозування, кон'юнктури фінансового ринку та його окремих сегментів. |
| Мета та цілі дисципліни | Мета: формування у студентів цілісної системи знань щодо методологічних засад статистичного дослідження фінансових ринків, а також здобуття сукупності вмінь і практичних навичок застосування статистичних методів до вирішення складних практичних завдань у фінансовій сфері. Цілі: засвоєння методології статистичного дослідження фінансових ринків, оволодіння статистичними методами оцінки та аналізу показників фінансових ринків, а також розвинути здатності їх використовувати для інформаційно-аналітичного забезпечення управлінських рішень. |
| Література для вивчення дисципліни | Основна література 1. Monetary and financial statistics manual and compilation guide/ International Monetary Fund, Bank for International Settlements, European Central Bank.— Washington, D.C.: International Monetary Fund, 2017. – 430 p. |

2. Арутюнян С.С., Йоргачова М.І. та ін.; за заг. ред. С.С. Арутюнян, М.І. Йоргачова. Ринок фінансових послуг: навч. посіб. – Харків: «Діса плюс», 2020. – 312 с.
 3. Гапонюк М.А., Буряченко А.Є., Дегтярьова Н.В. та ін. /за заг ред. М.А.Гапонюка Фінансовий ринок: підручник.– К.: КНЕУ, 2014.– 419 с.
 4. Дегтярьова Н.В., Леонов Д.А., Січевлюк В.А. та ін. Фондовий ринок в Україні: Навчальний посібник/ за заг. ред. Леонова Д.А. - К.: УІРФР, 2015.- 600 с.
 5. Еш С. М. Фінансовий ринок. Навч. посіб. 2-ге вид. – К.: Центр учбової літератури, 2011. – 528 с.
 6. Зіненко А. В. R/S аналіз на фондовому ринку / к.т.н. А. В. Зіненко // Математичні моделі соціальних та економічних сієсту. - Бізнес-інформатика №3 (21), 2012. - С.24-30.
 7. Інформаційна ефективність фондового ринку України / [М. І. Карлін, Ю. В. Шулик, М. А. Ліпич та ін.] // Проблеми розвитку фінансової системи України та шляхи їх вирішення / [М. І. Карлін, Ю. В. Шулик, М. А. Ліпич та ін.]. – Луцьк: Вежа-Друк, 2014. - С. 323-343.
 8. Клименко В. В. Фінансовий ринок : навч. посіб. для студ. вищ. навч. закл. / В. В. Клименко, Л. М. Акімова, Л. М. Докієнко. – Київ: Центр учб. л-ри, 2015. – 357 с.
 9. Кравченко Ю.Я. Ринок цінних паперів: Навч. посіб. – К.: Дакор, КНТ, 2008. – 664 с.
 10. Лутчин, Н. П., Миронюк А.К. Статистика фінансів: навчальний посібник. – 2-ге вид., випр. і доп. – Львів : Новий світ– 2000, 2006 р. – 324 с.
 11. Торгівля цінними паперами в Україні: навчальний посібник / авт. кол. : С.О.Москвін, Н.В. Дегтярьова, К.К. Бовкун, Д.С.Бутенко [та ін.] - К. : АДС УМКЦентр, 2015. - 344 с.
 12. Шелудько В.М. Фінансовий ринок: Підручник, - К. : Знання, 2015. 535 с.
- Інформаційні ресурси**
13. Офіційний сайт Міністерства фінансів України. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <https://minfin.com.ua>
 14. Офіційний сайт Національного банку України. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <https://www.bank.gov.ua/>
 15. Офіційний сайт Національної комісії з цінних паперів та фондового ринку. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <https://www.nssmc.gov.ua/>
 16. Офіційний сайт АТ "Українська біржа". [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <http://www.ux.ua/>
 17. Офіційний сайт АТ «Фондова біржа ПФТС». [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <https://pfts.ua/>
 18. Офіційний сайт АТ «Фондова біржа Перспектива». [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <http://fbp.com.ua/>
 19. Офіційний сайт Національного рейтингового агентства «Рюрік». [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <http://rurik.com.ua/>
 20. Офіційний сайт Рейтингового агентства «Кредит-Рейтинг». [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <https://www.credit-rating.ua/>
 21. Офіційний сайт IOSCO - Міжнародної організації комісії цінних паперів. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <https://www.iosco.org/>
 22. Офіційний сайт ESMA - Європейського управління цінних паперів та ринків. Електронний ресурс]. – Режим доступу: <https://www.esma.europa.eu/>
 23. Офіційний сайт MSCI Inc. — американської фінансової компанії, рейтингової агенції. [Електронний ресурс]. - Режим доступу: <https://www.msci.com/>
 24. Офіційний сайт WFE – міжнародної галузевої групи бірж та клірингових палат. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <https://www.world-exchanges.org/>

| | |
|--------------------------------------|---|
| Обсяг дисципліни | Загальна кількість год. – 120 год. (4 кредити), з них 32 год. аудиторних занять (16 лекційні год., 16 год. семінарських (практичних) занять) і 88 год. самостійної роботи. |
| Очікувані результати навчання | <p>Після завершення курсу навчання студент буде:</p> <p>знати: методологічні підходи щодо способів збору, впорядкування та систематизації статистичних даних, які характеризують фінансові ринки; джерела інформаційного забезпечення статистичного аналізу фінансових ринків; аналітичну систему узагальнених макроекономічних характеристик формування, розподілу, перерозподілу фінансових ресурсів, їх використання; аналітичну систему макроекономічних показників розвитку національного та міжнародних фінансових ринків, їх взаємозв'язки, методи розрахунку та прогнозування.</p> <p>вміти: використовувати аналітичний та методичний інструментарій статистики для комплексного аналізу фінансових ринків; змістовно інтерпретувати отримані результати статистичного дослідження фінансових ринків та робити обґрунтовані висновки і пропозиції; застосовувати комп'ютерну техніку та спеціальні пакети прикладних програм обробки інформації для проведення статистичних досліджень, статистичного моделювання та прогнозування кількісних характеристик фінансових ринків.</p> <p>Компетентності і програмні результати навчання, які забезпечує дисципліна.</p> <p>Інтегральна компетентність. Здатність визначати та розв'язувати складні економічні задачі і проблеми, приймати відповідні аналітичні та управлінські рішення у сфері економіки або у процесі навчання, що передбачає проведення досліджень та/або здійснення інновацій за невизначених умов та вимог.</p> <p>Загальні компетентності:</p> <p>ЗК2: Здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу.</p> <p>Спеціальні компетентності:</p> <p>СК1. Здатність застосовувати науковий, аналітичний, методичний інструментарій для обґрунтування стратегії розвитку економічних суб'єктів та пов'язаних з цим управлінських рішень.</p> <p>СК3. Здатність збирати, аналізувати та обробляти статистичні дані, науково-аналітичні матеріали, які необхідні для розв'язання комплексних економічних проблем, робити на їх основі обґрунтовані висновки.</p> <p>Програмні результати навчання:</p> <p>РН1. Формулювати, аналізувати та синтезувати рішення науково-практичних проблем.</p> <p>РН7. Обирати ефективні методи управління економічною діяльністю, обґрунтовувати пропоновані рішення на основі релевантних даних та наукових та прикладних досліджень.</p> <p>РН8. Збирати, обробляти та аналізувати статистичні дані, науково-аналітичні матеріали, необхідні для вирішення комплексних економічних завдань</p> <p>РН17. Формувати системи статистичного моніторингу регіонального, національного та міжнародного бізнес-простору для розробки ефективних аналітично-консалтингових рішень.</p> <p>РН18. Застосовувати спеціальні статистичні пакети та методи</p> |

| | |
|---|---|
| | інтелектуального аналізу задля розробки ефективних управлінських рішень |
| Формат дисципліни | Денна форма навчання |
| Зміст навчальної дисципліни (Схема дисципліни наведена у Додатку) | <p>Модуль 1. Методологічні основи статистичного аналізу фінансових ринків.</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Фінансовий ринок, як об'єкт статистичного вивчення, завдання статистичного аналізу фінансових ринків. 2. Структуризація та сегментація фінансових ринків та розвиток ринкової інфраструктури у статистичному вимірі. 3. Фінансові посередники фінансових ринків та статистика їх діяльності. 4. Статистичний аналіз фінансових ризиків, визначення ціни капіталу. <p>Модуль 2. Статистика грошового, валютного ринку та ринку капіталів.</p> <ol style="list-style-type: none"> 5. Статистика грошового ринку. 6. Статистика валютного ринку. 7. Статистика ринку капіталів. 8. Статистика ринку банківських послуг. <p>Модуль 3. Статистика фондового ринку України.</p> <ol style="list-style-type: none"> 9. Основні поняття статистики цінних паперів. Статистичні характеристики сегментів ринку цінних паперів. 10. Статистичні оцінка якості цінних паперів. 11. Статистика ринку похідних фінансових інструментів. 12. Статистика фондових бірж та фондових операцій. <p>Модуль 4. Статистика міжнародних фінансових ринків.</p> <ol style="list-style-type: none"> 13. Інформаційно-статистичне забезпечення вивчення міжнародних фінансових ринків. 14. Інформаційно-статистичне забезпечення вивчення міжнародного ринку грошей. 15. Інформаційно-статистичне забезпечення вивчення міжнародного ринку кредитних ресурсів. 16. Інформаційно-статистичне забезпечення вивчення міжнародного фондового ринку. |
| Підсумковий контроль, форма | Залік |
| Пререквізити | Для вивчення дисципліни студенти потребують базових знань з дисциплін: статистика, економічна статистика, макроекономіка, мікроекономіка, фінанси, банківництво і страхування, фінансова аналітика. |

| Методи навчання | <p>Для досягнення мети та цілей навчання традиційні методи поєднуються з інноваційними технологіями:</p> <p>Лекції із використанням проблемного викладу, візуального супроводу; дискусій; лабораторні заняття проводяться з використанням тренінгу, обчислювальних практичних завдань.</p> <p>У рамках курсу передбачено виконання індивідуальних робіт.</p> <p>Дисципліна передбачає використання пакетів прикладних програм для статистичної обробки та аналізу даних під час лабораторних занять і виконання індивідуальних завдань.</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|---|---|-----------------------------------|-----------------|------------------|---|----|----------------------|--|----|-------|--|-----|-------------|--|------------------------|------------|-----|--------|------------|----|-------|---|---|------|---|
| Необхідні обладнання | <p>Проектор, інформаційно-комп'ютерне забезпечення, серед них програмні продукти - Microsoft Excel, мережа Інтернет</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Критерії оцінювання (окремо для кожного виду навчальної діяльності) | <p>Оцінювання проводиться за 100-бальною шкалою.</p> <table border="1" data-bbox="497 667 1417 851"> <thead> <tr> <th>Вид роботи</th> <th>Форма роботи і засоби діагностики</th> <th>Кількість балів</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Аудиторна робота</td> <td>Лабораторні заняття (виконання тестових і практичних завдань)</td> <td>88</td> </tr> <tr> <td>Індивідуальна робота</td> <td>Підготовка і захист звіту про виконання ІНДР</td> <td>12</td> </tr> <tr> <td>Разом</td> <td></td> <td>100</td> </tr> </tbody> </table> <p style="text-align: center;">Шкала оцінювання: Університету, національна та ECTS</p> <table border="1" data-bbox="488 891 1426 1093"> <thead> <tr> <th rowspan="2">Оцінка ECTS</th> <th rowspan="2">Сума балів за всі види навчальної діяльності</th> <th>За національною шкалою</th> </tr> <tr> <th>для заліку</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>A-E</td> <td>51-100</td> <td>Зараховано</td> </tr> <tr> <td>FX</td> <td>21-50</td> <td>Не зараховано з можливістю повторного складання</td> </tr> <tr> <td>F</td> <td>0-20</td> <td>Не зараховано з обов'язковим повторним вивченням дисципліни</td> </tr> </tbody> </table> | Вид роботи | Форма роботи і засоби діагностики | Кількість балів | Аудиторна робота | Лабораторні заняття (виконання тестових і практичних завдань) | 88 | Індивідуальна робота | Підготовка і захист звіту про виконання ІНДР | 12 | Разом | | 100 | Оцінка ECTS | Сума балів за всі види навчальної діяльності | За національною шкалою | для заліку | A-E | 51-100 | Зараховано | FX | 21-50 | Не зараховано з можливістю повторного складання | F | 0-20 | Не зараховано з обов'язковим повторним вивченням дисципліни |
| Вид роботи | Форма роботи і засоби діагностики | Кількість балів | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Аудиторна робота | Лабораторні заняття (виконання тестових і практичних завдань) | 88 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Індивідуальна робота | Підготовка і захист звіту про виконання ІНДР | 12 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Разом | | 100 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Оцінка ECTS | Сума балів за всі види навчальної діяльності | За національною шкалою | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | для заліку | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| A-E | 51-100 | Зараховано | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| FX | 21-50 | Не зараховано з можливістю повторного складання | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| F | 0-20 | Не зараховано з обов'язковим повторним вивченням дисципліни | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Індивідуальна робота | <p>Студенти виконують індивідуальні аналітичні роботи на основі статистичних та інших емпіричних даних згідно варіантів.</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Політики навчальної дисципліни | <p>Політика дотримання академічної доброчесності. Порушення принципів академічної доброчесності не толерується.</p> <p>Політика щодо відвідування та пропусків занять. Відвідування занять є складовою навчання. За об'єктивних обставин можливе он-лайн навчання за умови погодження з керівником курсу.</p> <p>Політика щодо виконання завдань пізніше встановленого терміну. Порушення без поважних причин термінів вказаних для виконання робіт не толерується.</p> <p>Детальніша інформація - у Робочій програмі навчальної дисципліни.</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

ДОДАТОК

СХЕМА КУРСУ «СТАТИСТИЧНИЙ АНАЛІЗ ФІНАНСОВИХ РИНКІВ»

Модуль 1. Методологічні основи статистичного аналізу фінансових ринків.

| Тиж. | Тема, короткий зміст | Форми діяльності, год. | Література (нумерація в основній таблиці силабусу) | Завдання, год. | Термін, тиждень |
|------|--|--|--|---|-----------------|
| 1 | Фінансовий ринок, як об'єкт статистичного вивчення, завдання статистичного аналізу фінансових ринків. <i>Сутність, основні поняття, структура, принципи та функції, суб'єкти та об'єкти фінансового ринку. Теоретичні засади територіальної організації фінансового ринку. Фінансовий ринок, як об'єкт статистичного вивчення. Класифікація фінансових ринків. Фінансові активи та фінансові інструменти. Завдання статистичного аналізу фінансових ринків.</i> | лекції (1), лабораторні заняття (1), сам. та інд. робота (4) | 2, 3, 5, 8, 9, 12 | Відповідь на контрольні запитання (2); розв'язування тестів (1), розв'язування прикладів (2), виконання лабораторної роботи (1). <u>Доповіді:</u> 1. Модель розвитку фінансового ринку континентальної Європи. 2. Англо-американська модель розвитку фінансового ринку | 2 |
| 1 | Структуризація та сегментація фінансових ринків та розвиток ринкової інфраструктури у статистичному вимірі. <i>Методи структуризації та сегментації фінансового ринку. Характеристика структури фінансового ринку (за основною групою фінансових активів). Поняття, елементи, показники розвитку ринкової інфраструктури ринків: фондового, страхового, валютного, дорогоцінних металів і каміння та інших об'єктів реального інвестування.</i> | лекції (1), лабораторні заняття (1), сам. та інд. робота (6) | 2, 3, 5, 8, 9, 12 | Відповідь на контрольні запитання (3); розв'язування тестів (2), розв'язування прикладів (3), виконання лабораторної роботи (1). <u>Доповіді:</u> 1. Інновації на ринку фінансових інструментів | 2 |
| 2 | Фінансові посередники фінансових ринків та статистика їх діяльності. <i>Статистика діяльності фінансових посередників: суб'єктів банківської системи, небанківських фінансово-кредитних інститутів, факторингових компаній, кредитних спілок, кас взаємодопомоги, страхових компаній, посередників депозитарно-клірингової системи.</i> | лекції (1), лабораторні заняття (1), сам. та інд. робота (6) | 2, 3, 5, 8, 9, 12 | Відповідь на контрольні запитання (3); розв'язування тестів (2), розв'язування прикладів (3), виконання лабораторної роботи (1). <u>Доповіді:</u> 1. Клірингові компанії. 2. Депозитарні розписки на фондовому ринку | 3 |
| 2 | Статистичний аналіз фінансових ризиків, визначення ціни капіталу. <i>Фінансові ризики, їх статистична оцінка і аналіз. Валютні ризики та їх види. Методи оцінки ризику на фінансовому ринку. Методи та критерії вимірювання міри фінансового ризику. Способи зниження міри фінансового ризику. Методи управління фінансовими ризиками. Поняття страхування та хеджування ризиків</i> | лекції (1), лабораторні заняття (1), сам. та інд. робота (6) | 2, 3, 5, 8, 9, 12 | Відповідь на контрольні запитання (3); розв'язування тестів (2), розв'язування прикладів (3), виконання лабораторної роботи (1). <u>Доповіді:</u> 1. Криптовалюти, їх особливості. 2. Еквайринг на ринку грошей. | 3 |

Модуль 2. Статистика грошового, валютного ринку та ринку капіталів.

| Тиж. | Тема, короткий зміст | Форми діяльності, год. | Література (нумерація в основній таблиці силабусу) | Завдання, год. | Термін, тиждень |
|------|---|--|--|---|-----------------|
| 3 | Статистика грошового ринку. <i>Зміст та структура, об'єкти та суб'єкти грошового ринку. Організація, особливості депозитного ринку. Послуги для здійснення грошових платежів та розрахунків. Інструменти облікового ринку. Операції з інструментами грошового ринку. Характеристика міжбанківського ринку. Статистично-інформаційне забезпечення і показники розрахункових операцій на грошовому ринку. Способи розв'язування фінансово-статистичних задач.</i> | лекції (1), лабораторне заняття (1), сам. та інд. робота (4) | 1, 2, 3, 5, 8-10, 12, 14 | Відповідь на контрольні запитання (2); розв'язування тестів (1), розв'язування прикладів (2), виконання лабораторної роботи (1). <u>Доповіді:</u> 1. Брокерські послуги на фондовому ринку. 2. Фондові індекси України. | 4 |
| 3 | Статистика валютного ринку. <i>Основні поняття, економічні категорії та структура валютного ринку. Класифікація валютних операцій. Конверсійні операції на валютному ринку. Ринок операцій спот. Методи статистичного аналізу валютного курсу та котирування. Стратегія валютного арбітражу. Види валютних курсів та угод. Визначення крос-курсу валют. Валютні операції на форвардному ринку, опціон і своп. Визначення ефективності операції, пов'язаних з конвертованістю валют. Методи та особливості статистичного прогнозування валютного курсу.</i> | лекції (1), лабораторне заняття (1), сам. та інд. робота (6) | 1, 2, 3, 5, 8-10, 12, 14 | Відповідь на контрольні запитання (3); розв'язування тестів (2), розв'язування прикладів (3), виконання лабораторної роботи (1). <u>Доповіді:</u> 1. Діяльність НБУ на валютному ринку. 2. Валютне регулювання в країнах з розвинутою ринковою економікою. | 4 |
| 4 | Статистика ринку капіталів. <i>Структура ринку капіталів. Банки, як основні учасники ринку капіталів. Банківський кредит та джерела його формування. Методологічні підходи щодо класифікації форм та видів грошових позичок. Забезпечення кредитів. Проблема ліквідації проблемних позик. Встановлення економічних показників регулювання діяльності комерційних банків. Побудова кредитних рейтингів. Критерії вибору банку вкладниками.</i> | лекції (1), лабораторне заняття (1), сам. та інд. робота (6) | 1, 2, 3, 5, 8-10, 12, 14 | Відповідь на контрольні запитання (3); розв'язування тестів (2), розв'язування прикладів (3), виконання лабораторної роботи (1). <u>Доповіді:</u> 1. Ринки срібла і золота. 2. Ринок платини та металів платинової групи. | 5 |
| 4 | Статистика ринку банківських послуг. <i>Види послуг комерційних банків. Система статистичних показників ринку банківських послуг. Методи і фінансування та кредитування капітальних вкладень комерційними банками. Фінансові послуги на ринку позичкового капіталу. Факторингові операції. Лізингові операції, селенг.</i> | лекції (1), лабораторне заняття (1), сам. та інд. робота (6) | 1, 2, 3, 5, 8-10, 12, 14 | Відповідь на контрольні запитання (3); розв'язування тестів (2), розв'язування прикладів (3), виконання лабораторної роботи (1). <u>Доповіді:</u> 1. Ринок монет. 2. Золоті країни світу. | 5 |

Модуль 3. Статистика фондового ринку України.

| Тиж. | Тема, короткий зміст | Форми діяльності, год. | Література (нумерація в основній таблиці силябусу) | Завдання | Термін, тиждень |
|------|---|---|--|---|-----------------|
| 5 | <p>Основні поняття статистики цінних паперів. Статистичні характеристики сегментів ринку цінних паперів.</p> <p><i>Предмет, завдання та інформаційне забезпечення статистики фондового ринку. Статистичні характеристики учасників фондового ринку. Інструменти фондового ринку. Система показників статистики цінних паперів. Особливості розрахунку показників ринку акцій, державних і корпоративних облігацій, казначейських та муніципальних цінних паперів. Статистичні показники, що використовуються для оцінки акцій та облігацій.</i></p> | <p>лекції (1), лабораторне заняття (1), сам. та інд. робота (4)</p> | <p>4, 6, 9, 11, 15-20</p> | <p>Відповідь на контрольні запитання (2); розв'язування тестів (1), розв'язування прикладів (2), виконання лабораторної роботи (1).</p> <p><u>Доповіді:</u> 1. Статистичний аналіз основних біржових індексів України 2. Порядок укладання та виконання біржових угод на українських фондових біржах.</p> | 6 |
| 5 | <p>Статистична оцінка якості цінних паперів.</p> <p><i>Показники, що характеризують якість акцій. Показники, що характеризують якість облігацій. Оцінка цінних паперів та розрахунок їх доходності. Ринок облігацій. Ринок акцій. Вексельного обіг, його характеристики та особливості в Україні. Приватизаційні цінні папери. Банківські цінні папери. Формування портфелю цінних паперів.</i></p> | <p>лекції (1), лабораторне заняття (1), сам. та інд. робота (6)</p> | <p>4, 6, 9, 11, 15-20</p> | <p>Відповідь на контрольні запитання (3); розв'язування тестів (2), розв'язування прикладів (3), виконання лабораторної роботи (1).</p> <p><u>Доповіді:</u> 1. Операції РЕПО в Україні.</p> | 6 |
| 6 | <p>Статистика ринку похідних фінансових інструментів.</p> <p><i>Економічна сутність похідних фінансових інструментів та їх класифікація. Характеристика та статистичні показники основних похідних фінансових інструментів: ф'ючерси, форварди, опціони, свопи. Створення ринку "синтетичних" цінних паперів. Статистичні оцінки похідних фінансових інструментів.</i></p> | <p>лекції (1), лабораторне заняття (1), сам. та інд. робота (6)</p> | <p>4, 6, 9, 11, 15-20</p> | <p>Відповідь на контрольні запитання (3); розв'язування тестів (2), розв'язування прикладів (3), виконання лабораторної роботи (1).</p> <p><u>Доповіді:</u> 1. Греки опціонів. 2. Екзотичні опціони і операції.</p> | 7 |
| 6 | <p>Статистика фондових бірж та фондових операцій.</p> <p><i>Основи організації фондових ринків в країнах з розвинутими ринковими відносинами. Біржовий та позабіржовий фондовий ринок України. Операції з цінними паперами, їх статистичні характеристики. Фондові індекси, методи побудови та розрахунку. Індекси українського фондового ринку. Рейтинги фондового ринку.</i></p> | <p>лекції (1), лабораторне заняття (1), сам. та інд. робота (6)</p> | <p>4, 6, 9, 11, 15-20</p> | <p>Відповідь на контрольні запитання (3); розв'язування тестів (2), розв'язування прикладів (3), виконання лабораторної роботи (1).</p> <p><u>Доповіді:</u> 1. Основні та похідні фінансові інструменти 2. Міжнародні рейтингові агенції.</p> | 7 |

Модуль 4. Статистика міжнародних фінансових ринків.

| Тиж. | Тема, короткий зміст | Форми діяльності, год. | Література (нумерація в основній таблиці силабусу) | Завдання | Термін, тиждень |
|------|--|--|--|--|-----------------|
| 7 | Інформаційно-статистичне забезпечення вивчення міжнародних фінансових ринків. <i>Основи функціонування міжнародних фінансових ринків, їх учасники. Фінансові інструменти міжнародних фінансових ринків. Міжнародні та регіональні фінансові установи. Статистичні показники діяльності міжнародних фінансових ринків. Вплив діяльності міжнародних фінансових інститутів на економічний розвиток України.</i> | лекції (1), лабораторне заняття (1), сам. та інд. робота (4) | 1, 3, 5, 8-10, 12-14, 23 | Відповідь на контрольні запитання (2); розв'язування тестів (1), розв'язування прикладів (2), виконання лабораторної роботи (1). <u>Доповіді:</u> 1. Виникнення та розвиток строккових фінансових ринків. 2. Золотовалютний резерв. Світовий рейтинг найбільших власників золотих запасів | 8 |
| 7 | Інформаційно-статистичне забезпечення вивчення міжнародного ринку грошей. <i>Місце валютного ринку у системі світової валютної системи. Світові й регіональні валютні ринки, їх статистичні характеристики. Ринок FOREX, операції, сегменти ринку, статистичні показники. Валютні клірингові розрахунки Криптовалюти, їх характеристики. Статистичні методи прогнозування показників валютного ринку.</i> | лекції (1), лабораторне заняття (1), сам. та інд. робота (6) | 1, 3, 5, 8-10, 12-14, 23 | Відповідь на контрольні запитання (3); розв'язування тестів (2), розв'язування прикладів (3), виконання лабораторної роботи (1). <u>Доповіді:</u> 1. Міжнародні розрахунки на валютному ринку. 2. Сучасний стан ринків криптовалют. 3. Офшорні банківські зони. | 8 |
| 8 | Інформаційно-статистичне забезпечення вивчення міжнародного ринку кредитних ресурсів. <i>Особливості міжнародного ринку кредитних ресурсів, його статистичні характеристики. Кредити міжнародних фінансових інституцій. Особливості організації міжнародних розрахунків. Основні форми міжнародних розрахунків. Кредитний рейтинг України.</i> | лекції (1), лабораторне заняття (1), сам. та інд. робота (6) | 1, 3, 5, 8-10, 12-14, 23 | Відповідь на контрольні запитання (3); розв'язування тестів (2), розв'язування прикладів (3), виконання лабораторної роботи (1). <u>Доповіді:</u> 1. Міжнародний досвід операцій РЕПО. 2. Світовий досвід хедж-фондів. | 9 |
| 8 | Інформаційно-статистичне забезпечення вивчення міжнародного фондового ринку. <i>Міжнародний ринок цінних паперів, його характеристики. Структура та інфраструктура світових фондових ринків. Фондові індекси міжнародного фондового ринку, їх побудова, використання, аналіз, прогнозування. Ринок єврооблігацій та євроакцій, їх статистичні характеристики.</i> | лекції (1), лабораторне заняття (1), сам. та інд. робота (6) | 1, 3, 5, 8-10, 12-14, 21-24 | Відповідь на контрольні запитання (3); розв'язування тестів (2), розв'язування прикладів (3), виконання лабораторної роботи (1). <u>Доповіді:</u> 1. Вимоги щодо лістингу цінних паперів на міжнародних біржах. 2. «Тотемні тварини» фондового ринку. | 9 |