

Львівський національний університет імені Івана Франка
Кафедра економіки підприємства

“ЗАТВЕРДЖУЮ”

Декан
економічного факультету
доц. Михайло Р. В.


"30" *april* 2017р.

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Сучасні технології біржової діяльності

галузь знань _____ (шифр і назва навчальної дисципліни)
07 – "Управління та адміністрування"
спеціальність _____ (шифр і назва галузі знань)
076 – "Підприємництво, торгівля та біржова діяльність"
факультет _____ (шифр і назва напрямку підготовки)
Економічний
(назва факультету)

Львів – 2017 рік

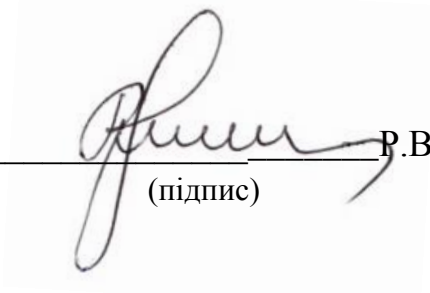
Робоча програма навчальної дисципліни “Сучасні технології біржової діяльності” для учасників освітнього процесу за спеціальністю 076 - “Підприємництво, торгівля та біржова діяльність”. – Львів: ЛНУ імені Івана Франка, 2017. – 10 с.

Розробник: Гукалюк Андрій Федорович, кандидат економічних наук,
доцент кафедри економіки підприємства

Робоча програма затверджена на засіданні кафедри економіки підприємства
Протокол № 1 від “30” серпня 2017 р.

Завідувач кафедри економіки підприємства  проф. Михасюк І.Р.
(підпис)

Схвалено Вченою радою економічного факультету Львівського національного
університету імені Івана Франка
Протокол № 1 від “30 ” серпня 2017 р

Голова  Р.В.Михайлишин
(підпис)

1. Опис навчальної дисципліни

Найменування показників	Галузь знань, спеціальність	Характеристика навчальної дисципліни	
		денна форма навчання	вечірня форма навчання
Кількість кредитів, – 3	Галузь знань 07 Управління та адміністрування	Вибіркова	
Модулів – 1	Спеціальність 076 «Підприємництво, торгівля та біржова діяльність»	<i>Рік підготовки:</i> 2018/2019	
Загальна кількість годин – 90	Спеціальність «Підприємництво, торгівля та біржова діяльність»	2-й	2-й
		<i>Семестр</i>	
		4 -й	42-й
		<i>Лекції</i>	
Тижневих годин для денної форми навчання: аудиторних – 3 самостійної роботи студента – 4,5	Освітньо-науковий ступінь: Доктор філософії	32 год.	12 год.
		<i>Практичні, семінарські</i>	
		16 год.	6 год.
		<i>Лабораторні</i>	
		год.	год.
		<i>Самостійна робота</i>	
		42 год.	72 год.
		ІНДЗ:	
Вид контролю: Залік			

2. Мета та завдання навчальної дисципліни.

Метою вивчення вибіркової дисципліни «Сучасні технології біржової діяльності» формування у учасників освітнього процесу теоретичних знань та практичних умінь щодо технології укладання біржових контрактів на міжнародних, фондових ф'ючерсних та валютних біржах з метою отримання доходів.

Основними завданнями вивчення дисципліни є вивчення особливостей розвитку біржових ринків; дослідження сутності та сучасних тенденцій здійснення біржової діяльності; оволодіння знаннями з організації діяльності та управління біржовими інструментами операцій; формування практичних навичок з проведення розрахунків для оцінки результативності біржових операцій; набуття навичок самостійного використання теоретичних знань у практичній діяльності.

Згідно з вимогами освітньо-наукової програми учасники освітнього процесу повинні:

знати

- місце та роль біржі в економіці;
- основні функції та характерні ознаки біржової торгівлі;
- види бірж, класифікацію біржових товарів, основні біржові товари та їх характеристику;
- специфіку сучасних технологій біржової діяльності та методики здійснення торгів;
- етапи створення товарної біржі та принципи її організації, засновників та членів бірж, їх права та обов'язки, категорії членства;
- суть і методику проведення фундаментального аналізу, розшифровувати офіційні котирування біржових цін та курсів;
- основні засоби технічного аналізу.

вміти:

- проводити аналіз біржових контрактів, знати основні риси біржової торгівлі, орієнтуватися у новітніх тенденціях на міжнародних біржових ринках;
- проводити розрахунки прибутковості/збитковості за операціями з біржовими інструментами;
- виявляти взаємозв'язки між ціновими та курсовими ризиками в біржовій діяльності;
- застосовувати елементи біржового електронного трейдингу та інших сучасних технологій біржової торгівлі.

3. Програма навчальної дисципліни

Тема 1. Роль біржової торгівлі у ринковій економіці.

Поняття, сутність та види бірж. Ознаки класифікації бірж. Принципи організації бірж. Організаційно-правова форма. Місце і роль бірж у світовій торгівлі. Види біржових угод. Основні риси біржової торгівлі. Основні етапи розвитку світової біржової торгівлі. Основні тенденції розвитку світової біржової торгівлі на сучасному етапі.

Тема 2. Сучасні міжнародні біржові ринки.

Визначення біржі та її функції. Особливості діяльності бірж в Україні. Функції бірж, їх класифікація. Види товарних бірж. Основні етапи розвитку бірж в Україні. Тенденції та завдання розвитку бірж в Україні.

Тема 3. Види біржових угод та операцій.

Поняття, сутність та класифікація біржових угод. Типи угод. Критерії класифікації біржових угод. Ф'ючерсні угоди та механізм їх здійснення. Стандартизація ф'ючерсного контракту. Порівняльна характеристика форвардних та ф'ючерсних контрактів. Опціонні угоди. Види опціонних угод. Порівняльна характеристика опціонних та ф'ючерсних контрактів. Біржові операції. Основні завдання біржових операцій. Види біржових операцій. Види операцій страхування цінового ризику.

Тема 4. Біржові товари і принципи формування товарної спеціалізації брокерів.

Особливості біржових товарів та їх класифікація. Вимоги до біржового товару. Класифікація сучасного асортименту біржових товарів. Критерії класифікації товарів, що реалізуються на товарній біржі. Принципи, етапи та послідовність формування товарної спеціалізації брокерів. Параметри дослідження товарного ринку. Біржовий потенціал товарного ринку України. Показники, що характеризують біржовий потенціал товарного ринку.

Тема 5. Формування та котирування цін на біржі.

Принципи формування цін на біржі. Види біржових цін. Додаткові умови, що обмежують виявлення функції пропозиції від ціни. Чинники, що обумовлюють зміну попиту на товари. Встановлення ціни рівноваги на біржі. Структура елементів біржової ціни на товар. Основні види цінових знижок, що використовуються у практиці біржової торгівлі. Види біржових цін: основні і

другорядні. Види цінової стратегії та політики продавця на товарній біржі. Форми цінової політики. Сутність та правила біржового котирування цін. Порядок розрахунку типових біржових цін. Система показників біржового котирування цін.

Тема 6. Аналіз та прогнозування біржової кон'юнктури.

Сутність, мета та етапи дослідження біржової кон'юнктури. Система показників моніторингу кон'юнктури біржового ринку. Аналіз поточної біржової кон'юнктури. Розрахунок системи аналітичних показників. Життєвий цикл біржового товару. Прогнозування біржової кон'юнктури. Стадії прогнозування біржової кон'юнктури.

Тема 7. Форми розрахунків та організація розрахункових операцій.

Сутність і функції клірингу та розрахунків. Класифікація клірингу та розрахунків. Характеристика умов платежу за біржовими угодами. Строки платежу. Форми розрахунків за біржовими угодами. Організація розрахункових операцій на біржі.. Методи здійснення грошових розрахунків. Основні етапи розрахунково-клірингового процесу на ринку ф'ючерсних контрактів.

Тема 8. Організація та проведення біржових торгів.

Порядок та правила ведення біржових торгів. Біржова сесія. Процедура біржового торгу. Роль маклера під час біржових торгів. Особливості укладання угоди. Види доручень клієнта брокеру. Види та форми біржових аукціонів.

4. Структура навчальної дисципліни

Назви тем	Кількість годин											
	Денна форма						Вечірня форма					
	Усього	у тому числі					Усього	у тому числі				
		л	п	Лаб	інд	ср		о	л	п	лаб	інд
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Тема 1. Роль біржової торгівлі у ринковій економіці.	11	4	2			5	10	1				9
Тема 2. Сучасні міжнародні біржові ринки.	11	4	2			5	11	2				9
Тема 3. Види біржових угод та операцій.	11	4	2			5	11	1	1			9
Тема 4. Біржові товари і принципи формування	12	4	2			6	12	2	1			9

товарної спеціалізації брокерів.												
Тема 5. Формування та котирування цін на біржі.	11	4	2			5	11	1	1			9
Тема 6. Аналіз та прогнозування біржової кон'юнктури.	11	4	2			5	12	2	1			9
Тема 7. Форми розрахунків та організація розрахункових операцій.	11	4	2			5	11	1	1			9
Тема 8. Організація та проведення біржових торгів	12	4	2			6	12	2	1			9
Усього годин	90	32	16			42	90	12	6			72

5. Теми семінарських занять

№ з/п	Назва теми	Кількість годин
1.	Не передбачено навчальним планом	

6. Тематика практичних занять

№з/п	Назва теми	Кількість годин	
		денна форма	вечірня форма
1	Тема 1. Роль біржової торгівлі у ринковій економіці.	2	
2	Тема 2. Сучасні міжнародні біржові ринки.	2	
3	Тема 3. Види біржових угод та операцій.	2	1
4	Тема 4. Біржові товари і принципи формування товарної спеціалізації брокерів.	2	1
5	Тема 5. Формування та котирування цін на біржі.	2	1
6	Тема 6. Аналіз та прогнозування біржової кон'юнктури.	2	1
7	Тема 7. Форми розрахунків та організація розрахункових операцій.	2	1
8	Тема 8. Організація та проведення біржових торгів	2	1
	Разом:	16	6

7. Теми лабораторних занять

№ з/п	Назва теми	Кількість годин
1.	Не передбачено навчальним планом	

8. Самостійна робота

№з/п	Назва теми	Кількість годин	
		денна форма	вечірня форма
1	Тема 1. Роль біржової торгівлі у ринковій економіці.	5	9
2	Тема 2. Сучасні міжнародні біржові ринки.	5	9
3	Тема 3. Види біржових угод та операцій.	5	9
4	Тема 4. Біржові товари і принципи формування товарної спеціалізації брокерів.	6	9
5	Тема 5. Формування та котирування цін на біржі.	5	9
6	Тема 6. Аналіз та прогнозування біржової кон'юнктури.	5	9
7	Тема 7. Форми розрахунків та організація розрахункових операцій.	5	9
8	Тема 8. Організація та проведення біржових торгів	6	9
	Разом:	42	72

9. Індивідуальні завдання

Індивідуальне завдання має форму наукової роботи, яка виконується кожним учасником освітнього процесу за вільно обраною темою із запропонованих викладачем.

10. Методи навчання

Основними методами навчання, що використовуються в процесі викладання навчальної дисципліни є:

- метод передачі і сприйняття навчальної інформації, пробудження наукового інтересу (розповідь, пояснення, бесіда, лекція, ілюстрація, демонстрація, спостереження);

- метод практичного засвоєння курсу з допомогою складання тестових завдань, вирішення задач та ситуацій з метою набування умінь і практичних навичок (практична робота, вправи);

- метод самостійного засвоєння навчального матеріалу у вигляді складання тестів, вирішення облікових задач, написання наукових робіт на підставі самостійно опрацьованої базової літератури та додаткових джерел інформації (в т.ч. законодавчих актів) з метою конкретизації й поглиблення базових знань, необхідних умінь та практичних навичок (самостійна робота).

11. Методи контролю

Для визначення рівня засвоєння учасниками освітнього процесу навчального матеріалу використовуються такі методи оцінювання знань:

- поточне тестування з врахуванням самостійної роботи та практичних занять;
- оцінка за самостійну роботу над вивченням теоретичного матеріалу;

Для діагностики знань використовується 100-бальна шкала.

Поточний контроль знань студентів проводиться за тестовими програмами.

Контроль самостійної роботи проводиться шляхом перевірки теоретичних знань з курсу та розв'язування практичних завдань.

Усі форми контролю включено до 100-бальної шкали оцінювання знань.

12. Розподіл балів, що присвоюється учасникам освітнього процесу

Критерії оцінювання (окремо для кожного виду навчальної діяльності)	60 балів - наукова робота (реферат) 40 балів - доповіді на семінарі 100 балів - загальна сума
--	--

Оцінювання знань студента здійснюється за 100-бальною шкалою.

При оформленні документів за екзаменаційну сесію використовується таблиця відповідності оцінювання знань за різними системами.

Шкала оцінювання: національна та ECTS

Сума балів за всі види навчальної діяльності	Оцінка ECTS	Оцінка за національною шкалою	
		для екзамену, курсового проекту (роботи), практики	для заліку
90 – 100	A	відмінно	зараховано
81-89	B	добре	
71-80	C		
61-70	D	задовільно	
51-60	E		
0-50	FX	незадовільно з можливістю повторного складання	не зараховано з можливістю повторного складання

13. Методичне забезпечення

Методичне забезпечення навчальної дисципліни “Сучасні технології біржової діяльності” включає:

- 1) Методичні рекомендації до вивчення дисципліни.
- 2) Опорний конспект лекцій.

- 3) Навчальні посібники, який містить ілюстративні матеріали та матеріали математичних формул, приклади розв'язування, а також практичні завдання для самостійної роботи.
- 4) Нормативні документи.

14. Рекомендована література

1. Господарський кодекс України [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <http://zakon1.rada.gov.ua/laws/show/436-15>.
2. Про цінні папери та фондовий ринок: Закон України № 3480-IV від 23.02.2006 р. // Відомості Верховної Ради України. – 2006. – № 31. – 268 с
3. Закон України «Про фінансові послуги та державне регулювання ринків фінансових послуг».
4. Берлач А.І. Біржове право України: [навч. посіб.] / А.І. Берлач. – К.: Університет «Україна», 2008. – 316 с. 9. Біржова діяльність: навчальний посібник / В. І. Крамаренко, Б. І. Холод, Ю. Н. Воробйов та ін. ; за ред. В. І. Крамаренко. – К. : ЦУЛ, 2003. – 264 с.
5. Коттл С. Анализ ценных бумаг Грэма и Додда / С. Коттл, Р. Ф. Мюррей, Ф. Е. Блок. — М. : Олимп Бизнес, 2000. — 782 с
6. Крамаренко В. І., Холод Б. І., Воробйов Ю. Н., Дудар А. П., Кантур С. Ф. Біржова діяльність: навч. посіб. для студ. вищих навч. закл. К. : ЦУЛ, 2003. 261с
7. Пепа Т.В. Біржова діяльність: навч. посібник. К.: Кондор, 2008. 540 с
8. Сохацька О. та ін. Біржова діяльність: Підручник за науковою редакцією О.М. Сохацької. Тернопіль: Видавничо-поліграфічний центр «Економічна думка ТНЕУ», 2014. 655с.
9. Сохацька О., Роговська-Іщук І., Вінницький С. Фундаментальний та технічний аналіз цін товарних та фінансових ринків. К.: Кондор, 2012. 305 с.
10. Суторміна В. М. Фінансовий ринок : навч.-метод. посіб. / В. М. Суторміна, Н. В. Дегтярьова. – 2-е. вид. – К. : КНЕУ, 2008. – 176 с.

Розробник:



А.Ф. Гукалюк