

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ

(найменування центрального органу виконавчої влади у сфері освіти і науки)

ЗАПОРІЗЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ ТЕХНІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ

(повне найменування вищого навчального закладу)

Кафедра Маркетингу та логістики

“ЗАТВЕРДЖУЮ”

Проректор з навчальної роботи

“ ” 2017 року

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

ПП 3.2.1 Біржова справа

(шифр і назва навчальної дисципліни)

галузь знань 07 «Управління та адміністрування»

(код і назва напрямку підготовки)

спеціальність 075 «Маркетинг»

(код і назва спеціальності)

освітня програма «Маркетинг»

(шифр і назва)

інститут, факультет Економіко-гуманітарний інститут,

факультет економіки та управління

(назва інституту, факультету)

Робоча програма з дисципліни Біржова справа

(назва навчальної дисципліни)

для студентів галузі знань 07 «Управління та адміністрування»
спеціальності 075 «Маркетинг» за освітньою програмою «Маркетинг».

„27” квітня 2017 року - 12 с.

Розробники: Козицька Г.В. доцент, к.е.н., доцент кафедри маркетингу та логістики

(вказати авторів, їхні посади, наукові ступені та вчені звання)

Робоча програма затверджена на засіданні кафедри Маркетингу та логістики

Протокол від. “27” квітня 2017 року № 9

Завідувач кафедри Маркетингу та логістики _____ (В.В. Лифар)

(підпис)

(прізвище та ініціали)

“ _____ ” _____ 2017_ року

Схвалено методичною комісією вищого навчального закладу за спеціальністю 075 «Маркетинг»

(код, назва)

Протокол від. “29” травня 2017 року № 10

“ _____ ” _____ 2017 року Голова _____ (В.В.Корольков)

(підпис)

(прізвище та ініціали)

1. Опис навчальної дисципліни

Найменування показників	Галузь знань, напрям підготовки, освітньо-кваліфікаційний рівень	Характеристика навчальної дисципліни	
		денна форма навчання	заочна форма навчання
Кількість кредитів – 3	Галузь знань 07 управління та адміністрування	Вибіркова	
Модулів – 2	Спеціальність 075 «Маркетинг» (шифр і назва) Маркетинг (назва освітньої програми)	Рік підготовки:	
Змістових модулів – 2		5-й	5-й
Індивідуальне науково-дослідне завдання: реферат		Семестр	
Загальна кількість годин - 90		10-й	9-й
Тижневих годин для денної форми навчання: аудиторних – 2 самостійної роботи студента – 4,429	Освітній ступінь: магістр	Лекції	
		14 год.	4 год.
		Практичні, семінарські	
		14 год.	2 год.
		Лабораторні	
		- год	- год.
		Самостійна робота	
		60 год.	82 год.
		Індивідуальні завдання:	
		2 год.	2 год.
		Вид контролю: залік	

Примітка.

Співвідношення кількості годин аудиторних занять до самостійної і індивідуальної роботи становить:

для денної форми навчання – 31,11 % до 68,89 %

для заочної форми навчання – 6,67 % до 93,33 %

2. Мета та завдання навчальної дисципліни

Мета: формування у майбутніх фахівців системи науково-теоретичних і практичних знань відносно механізму функціонування бірж і практичних навичок щодо укладання біржових угод та використання їх з метою хеджування

Завданнями дисципліни «Біржова справа» є:

- дослідження місця та значення біржового ринку в загальноекономічній системі;
- вивчення організаційних та правових основ функціонування біржового ринку;
- вивчення економічної сутності, форм і методів діяльності на біржі.

Вивчення навчальної дисципліни передбачає формування та розвиток у студентів **компетентностей**:

Загальних:

1. Здатність оперувати основними категоріями і методами дисципліни при вирішенні професійних завдань.
2. Здатність аналізувати значущі проблеми та процеси та знаходити шляхи вирішення проблем, які виникають під час професійної діяльності.
3. Здатність приймати обґрунтовані рішення.
4. Здатність застосовувати знання в практичних ситуаціях і проводити дослідження на професійному рівні.

Фахових:

1. Розуміння сутності біржі її видів та економічної природи. Функцій та характерних ознак біржової торгівлі.
2. Здатність застосовувати методи організації і технології торгів на товарних, фондових і ф'ючерсних біржах.
3. Розуміння економічних засад та різновидів біржових спекуляцій; сутності спекулятивних стратегій із застосуванням ф'ючерсних контрактів та опціонів.
4. Здатність застосовувати хеджеві операції для зменшення рівня курсових (цінових) ризиків на ринках реального товару та фінансових інструментів.
5. Здатність застосовувати теорії, методи та інструменти фундаментального і технічного аналізу з метою подальшого прогнозування рівня цін та курсів на біржових ринках.
6. Володіння спеціальною термінологією та лексикою даної дисципліни.

У результаті вивчення навчальної дисципліни здобувач вищої освіти повинен бути здатним демонструвати такі результати навчання:

1. Знати теоретичні засади діяльності на біржовому ринку.
2. Знати методи біржової діяльності.
3. Розуміти специфіку діяльності біржового ринку.

4. Вміти вести торги на товарній, фондовій та валютній біржах.

5. Вміти хеджувати цінові та курсові ризики за допомогою ф'ючерсної торгівлі.

6. Вміти виявляти та аналізувати фактори, що впливають на діяльність біржового ринку.

7. Вміти, враховуючи стан економічного розвитку і специфіку діяльності біржового ринку, визначати стратегії біржової діяльності.

Програма навчальної дисципліни

Змістовий модуль 1. Теоретичні засади біржової діяльності.

Тема 1. Сутність біржової діяльності

Розвиток і сучасний стан біржового ринку.
Формування національного біржового ринку.
Роль та місце біржі в економіці країни.
Сутність біржі та її економічна природа.
Функції та характерні ознаки біржової торгівлі. Види бірж.

Тема 2. Біржовий товар.

Класифікація біржових товарів.
Види біржових контрактів.
Характеристики біржових товарів.
Сільськогосподарська і промислова сировина.
Фінансові інструменти.

Тема 3. Товарна біржа.

Товарна біржа як елемент інфраструктури ринку.
Завдання і функції товарної біржі.
Класифікація товарних бірж.
Принципи діяльності та організаційна структура товарних бірж. Економічні засади функціонування товарної біржі.
Організація і технологія біржових торгів на вітчизняних біржах. Види угод на вітчизняних товарних біржах. Склад дій і послідовність їх виконання при укладанні біржових угод.
Котирування на товарній біржі.

Тема 4. Фондова біржа та її діяльність.

Фондова біржа і фондовий ринок.
Цінні папери як біржовий товар.
Учасники фондового ринку, фінансові посередники.
Сутність біржової угоди та її види. Види заявок на здійснення біржових угод. Процедура лістингу. Котирування цінних паперів. Оформлення і виконання біржової угоди.

Змістовий модуль 2. Методичні засади біржової діяльності.

Тема 5. Основи ф'ючерсної торгівлі.

Виникнення ф'ючерсної торгівлі. Технологія біржової ф'ючерсної торгівлі.
Характеристика ф'ючерсного контракту.
Основні риси ф'ючерсної торгівлі.
Товарні ф'ючерси як фінансові інструменти. Порядок укладання та виконання ф'ючерсних контрактів.
Концепція ціноутворення на ф'ючерсних ринках. Формування ф'ючерсних та майбутніх спотових цін.

Фінансові ф'ючерси.

Шляхи розвитку ф'ючерсної торгівлі в Україні.

Тема 6. Біржова спекуляція на ф'ючерсних ринках.

Економічна суть біржової спекуляції.

Історія становлення біржової спекуляції.

Види біржової спекуляції.

Види біржових спекулянтів.

Спекулятивні стратегії із застосуванням ф'ючерсних контрактів.

Спекулятивні стратегії із опціонами.

Діяльність спекулянтів на сучасних біржових ф'ючерсних ринках.

Тема 7. Хеджування цінових та курсових ризиків за допомогою ф'ючерсної торгівлі.

Суть та основні характеристики хеджування. Види хеджування.

Досконале хеджування цінових ризиків.

Здійснення хеджевих операцій з урахуванням реальних ситуацій на ринках.

Особливості хеджування цінових ризиків на ринку реального товару.

Хеджування курсових ризиків фінансових інструментів.

Тема 8. Фундаментальний та технічний аналіз біржових цін та курсів.

Суть фундаментального аналізу. Особливості здійснення фундаментального аналізу на фондових ринках.

Фундаментальний аналіз на ф'ючерсних ринках.

Суть технічного аналізу. Засоби технічного аналізу.

Основні фігури технічного аналізу.

Методи дотримання тренду. Осцилятори.

Теорія динамічної нерівноваги. Структурні теорії.

1. Структура навчальної дисципліни

Назви змістових модулів і тем	Кількість годин											
	денна форма						Заочна форма					
	усього	у тому числі					усьог о	у тому числі				
		л	п	ла б	інд	с.р.		л	п	ла б	інд	с.р.
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Модуль 1												
Змістовий модуль 1. Теоретичні засади біржової діяльності.												
Тема 1. Сутність біржової діяльності	11	1	1			9	11	0,5	0,25		0,25	10
Тема 2. Біржовий товар	11	1	1			9	11	0,5	0,25		0,25	10
Тема 3. Товарна біржа	11	2	2			7	11	0,5	0,25		0,25	10
Тема 4. Фондова біржа та її діяльність	12	2	2			8	12	0,5	0,25		0,25	11
Разом за змістовим модулем 1	45	6	6			33	45	2	1		1	41
Модуль 2												
Змістовий модуль 2. Методичні засади біржової діяльності.												
Тема 5. Основи ф'ючерсної торгівлі	11	2	2			7	11	0,5	0,25		0,25	10
Тема 6. Біржова спекуляція на ф'ючерсних ринках	11	2	2			7	11	0,5	0,25		0,25	10
Тема 7. Хеджування цінових та курсових ризиків за допомогою ф'ючерсної торгівлі	11	2	2			7	11	0,5	0,25		0,25	10
Тема 8. Фундаментальний та технічний аналіз біржових цін та курсів	12	2	2		2	6	12	0,5	0,25		0,25	11
Разом за змістовим модулем 2	45	8	8		2	27	45	2	1		1	41
Усього годин	90	14	14		2	60	90	4	2		2	82
ІНДЗ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Усього годин	90	14	14		2	60	90	4	2		2	82

5. Теми семінарських занять

№ з/п	Назва теми	Кількість годин
1	Сутність біржової діяльності	1
2	Біржовий товар	1
3	Товарна біржа	2
4	Фондова біржа та її діяльність	2

6. Теми практичних занять

№ з/п	Назва теми	Кількість годин
1	Основи ф'ючерсної торгівлі	2
2	Біржова спекуляція на ф'ючерських ринках	2
3	Хеджування цінкових та курсових ризиків за допомогою ф'ючерсної торгівлі	2
4	Фундаментальний та технічний аналіз біржових цін та курсів	2

7. Теми лабораторних занять

№ з/п	Назва теми	Кількість годин
1	-	-

8. Самостійна робота

№ з/п	Назва теми	Кількість годин
1	Сутність біржової діяльності	9
2	Біржовий товар	9
3	Товарна біржа	7
4	Фондова біржа та її діяльність	8
5	Основи ф'ючерсної торгівлі	7
6	Біржова спекуляція на ф'ючерських ринках	7
7	Хеджування цінкових та курсових ризиків за допомогою ф'ючерсної торгівлі	7
8	Фундаментальний та технічний аналіз біржових цін та курсів	6
	Разом	60

9. Індивідуальні завдання

Для студентів денної форми навчання – реферат на тему: «Фундаментальний та технічний аналіз біржових цін та курсів на прикладі...».

Для студентів заочної форми навчання – контрольна робота.

10. Методи навчання

Під час викладання курсу використовуються наступні методи навчання:

- розповідь – для оповідної, описової форми розкриття навчального матеріалу;
- пояснення – для розкриття сутності певного явища, закону, процесу;
- бесіда – для усвідомлення за допомогою діалогу нових явищ, понять;

- ілюстрація – для розкриття предметів і процесів через їх символічне зображення (малюнки, схеми, графіки);
- практична робота – для використання набутих знань у розв’язанні практичних завдань;
- аналітичний метод – мисленнєвого або практичного розкладу цілого на частини з метою вивчення їх суттєвих ознак;
- індуктивний метод – для вивчення явищ від одиничного до загального;
- дедуктивний метод – для вивчення навчального матеріалу від загального до окремого, одиничного;
- проблемний виклад матеріалу – для створення проблемної ситуації.

11. Методи контролю

Для студентів денної форми навчання: усне опитування на семінарських заняттях, розв’язування задач на практичних, захист індивідуального науково-дослідного завдання (реферату на тему, «Фундаментальний та технічний аналіз біржових цін та курсів на прикладі...»), аудиторна контрольна робота.

Для студентів заочної форми навчання: захист контрольної роботи.

12. Розподіл балів, які отримують студенти

Під час контролю враховуються наступні види робіт:

- активність роботи студента на практичному занятті оцінюється до 4 балів (всього 7 практичних занять по 4 бали = 28 балів);
- захист індивідуального домашнього завдання студента оцінюється до 22 балів;
- аудиторна контрольна робота – до 50 балів.

Розподіл балів, які отримують студенти при поточному оцінюванні знань (залік)

Поточне тестування та самостійна робота								Сума
Змістовний модуль 1				Змістовний модуль 2				
Т 1	Т 2	Т 3	Т 4	Т 5	Т 6	Т 7	Т 8	
25	25	25	25	25	25	25	25	200/2 100

Кожен змістовний модуль оцінюється за 100-бальною шкалою.

Підсумковий контроль визначається як середня двох контролів за перший та другий змістовні модулі.

Шкала оцінювання: національна та ECTS

Сума балів за всі види навчальної діяльності	Оцінка ECTS	Оцінка за національною шкалою
90 – 100	A	зараховано
82-89	B	
74-81	C	
64-73	D	
60-63	E	
35-59	FX	не зараховано з можливістю повторного складання
0-34	F	не зараховано з обов'язковим повторним вивченням дисципліни

13. Методичне забезпечення

1. Методичні вказівки до семінарських та практичних занять з курсу «Біржова справа» для студентів спеціальності 075 «Маркетинг» денної форми навчання / Укл. Г.В. Козицька. – Запоріжжя: ЗНТУ, 2016. – 46 с.

2. Методичні вказівки до виконання контрольних робіт з курсу «Біржова справа» для студентів спеціальності 075 «Маркетинг» заочної форми навчання / Укл. Г.В. Козицька. – Запоріжжя: ЗНТУ, 2014. – 50 с.

14. Рекомендована література

Базова

1. Про товарну біржу. Закон України // Законодавство України о торговле. Настольная книга продавца и покупателя: в 3-х частях. – К.: блиц-информ, 1997.

2. Про цінні папери і фондову біржу. Закон України // Акціонерні товариства та цінні папери в Україні. Збірник нормативних документів. – Запоріжжя: Емісія, 1998.

3. Биржевая деятельность: учебник / Под ред. проф. А.Г.Грязновой, проф. Р.В.Корнеевой. проф. В.А.Галанова. – М.: Финансы и статистика, 2005. – 568 с.

4. Биржевое дело: учебник / Под ред. В.А. Галанова, А.И.Басова. – М.: Финансы и статистика, – 2004. – 386 с.

5. Дегтярева О.И. Биржевое дело / О.И. Дегтярева, О.А. Кандинская. – М.: Банки и биржи, ЮНИТИ, 2006. – 624с.

6. Дегтярева О.И. Биржевое дело: учебник / О.И. Дегтярева. - М.: Банки и биржи, ЮНИТИ. 2000. – 487 с.

7. Масленников В.В. Биржевое дело: учеб. пособие / В.В. Масленников.- М.: ИНФРА-М, 2000. – 386 с.

8. Солодкий М.О. Біржовий ринок: навч. посібник / М.О. Солодкий. – Вид. 2-е, випр. – К.: Джерела-М, 2002. – 336 с.
9. Сохацька О.М. Біржова справа: підручник / О.М. Сохацька. – 2-ге вид. змін. й доп. – Тернопіль: Карт-бланш, К.: Кондор, 2008. – 632 с.

Допоміжна

1. Брызгин О. Основы биржевой деятельности / О. Брызгин. – К.: ОААУН, 2005. – 364 с.
2. Бердникова Т.Б. Рынок ценных бумаг и биржевое дело / Т.Б. Бердникова. – М.: ИНФРА-М, 2000. – 418 с.
3. Губський Б.В. Біржові технології ринку / Б.В. Губський. – К.: Нора прінт, 2004. – 452 с.
4. Иващенко А.А. Товарная биржа / А.А. Иващенко. – 2-е изд. – М.: Международные отношения, 2001. – 289 с.
5. Жуков Е.Ф. Ценные бумаги и фондовые рынки: учеб. пособие / Е.Ф. Жуков. – М. 2001. – 381с.
6. Каменева Н.Г. Организация биржевой торговли: учебник для вузов / Н.Г. Каменева. – М.: Банки и биржи, ЮНИТИ, 2007. – 375 с.
7. Рынок ценных бумаг: учебник / Под ред. В.А.Галанова, А.И.Басова. – М.: Финансы и статистика, 2006. – 306 с.
8. Петрашко Л.П. Валютні операції: навч. посіб. / Л.П. Петрашко – К.: КНЕУ, 2009. – 374 с.
9. Шелудько В.М. Фінансовий ринок / В.М. Шелудько. – К.: Знання-Прес, 2008. – 387 с.
10. Штилик О. Биржа и ее деятельность / О. Штилик. – С-Пб, 2002. – 281 с.

15. Інформаційні ресурси

1. Біржова справа. Сохацька О.М. [Електронний ресурс]. Режим доступу: library.tneu.edu.ua/files/EVD/birzh_sprava_sohatska.pdf
2. Біржова справа. [Електронний ресурс]. Режим доступу: osibnyky.vntu.edu.ua/b_s/index.../index.htm
3. Біржова справа. Дегтярева О.І., Кандінська О.А. [Електронний ресурс]. Режим доступу: toplutsk.com/bookcatalog-book_332.html.
4. Біржова справа. [Електронний ресурс]. Режим доступу: <http://thinbook.org/book/10-birzhova-diyalnist-navchalnij-posibnik-vv-rarovska/12-finansovi-instituti-rinku-cinnix-paperiv.html>
5. Біржова справа - під ред. Галанова Ст. А., Басова А. В. [Електронний ресурс]. Режим доступу: <http://bookscity.name/school/textbook2505.html>