

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ХАРКІВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ ЕКОНОМІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ІМЕНІ СЕМЕНА КУЗНЕЦЯ

МОДЕЛЮВАННЯ ФІНАНСОВИХ РИНКІВ

(назва навчальної дисципліни)

МЕТОДИЧНІ РЕКОМЕНДАЦІЇ
до проведення підсумкового контролю
з навчальної дисципліни
підготовки докторів філософії

зі спеціальності **072 «Фінанси, банківська справа та страхування»**

(шифр і назва спеціальності)

2016 рік

РОЗРОБЛЕНО ТА ВНЕСЕНО:

кафедрою управління фінансовими послугами ХНЕУ ім. С. Кузнеця,
протокол № 8 від 28.03.2016 р.

1. ЗАГАЛЬНІ ВІДОМОСТІ

Підсумковий контроль успішності навчання здобувачів з дисципліни «Моделювання фінансових ринків» та рівня сформованості у них компетентностей, які підтримуються даною навчальною дисципліною проводиться у формі семестрового диференційованого заліку відповідно до графіку навчального процесу спеціальності.

Семестровий залік – форма оцінки підсумкового засвоєння здобувачами теоретичного та практичного матеріалу з окремої навчальної дисципліни, що проводиться як контрольний захід.

Завданням *заліку* є перевірка розуміння здобувачем програмного матеріалу в цілому, логіки та взаємозв'язків між окремими розділами, здатності творчого використання накопичених знань, вміння формулювати своє ставлення до певної проблеми навчальної дисципліни тощо. В умовах реалізації компетентнісного підходу екзамен оцінює рівень засвоєння здобувачем компетентностей, що передбачені кваліфікаційними вимогами.

Під час семестрового контролю у формі диференційованого заліку підсумкова кількість балів з навчальної дисципліни (максимум – 100 балів) визначається як сума (проста) балів за результати успішності здобувача при поточному контролі.

2. РЕКОМЕНДОВАНА ЛІТЕРАТУРА

2.1. Основна

1. Стрижиченко К. А. Державне регулювання фінансового ринку в умовах нової економіки: Монографія / К. А. Стрижиченко. – Бердянськ : ФОП Ткачук О. В. – 2013. – 384 с. (рецензія д. е. н., проф. І. І. Рекуненка на монографію К. А. Стрижиченка надруковано: Бізнес Інформ. – 2015. – № 1. – С. 406).

2. Пономаренко В.С. Моделі поведінки інвестора на фондовому ринку // В.С. Пономаренко, Е. В. Раєвнева, К. А. Стрижиченко // Харк. держ. екон. ун-т. - Х. : ВД "ІНЖЕК", 2004. - 260 с

3. Статистичне моделювання та прогнозування: Навчальний посібник(гриф МОН). Під ред. д-ра екон. наук, проф. О. В. Раєвневої. Х.: ВД «ІНЖЕК», 2014. – 578 с.

2.2. Додаткова

4. Алексеєнко Л. М. Ринок фінансового капіталу: становлення, проблеми, перспективи розвитку : монографія / Л. М. Алексеєнко. – К. : Вид. дім «Максимум», 2004. – 424 С

5. Бланк И. А. Основы финансового менеджмента / И. А. Бланк. – К. : Ника-Центр, 1999. – Т.1 – 592 с.

6. Боголиб Т. М. Финансовые инструменты регулирования финансового рынка / Т. М. Боголиб // Теория и практика управления. – 2013. – № 2. – С. 34–42

7. Бочаров В. В. Финансовое моделирование / В. В. Бочаров. – СПб. : Питер, 2000. – 208 с.

8. Вильямс Б. Торговый хаос: Новые измерения в биржевой торговле / Б. Вильямс. – М. : ИК Аналитика, 2000. – 276 с

9. Винс Р. Математика управления капиталом. Методы анализа риска для трейдера и портфельных менеджеров / Р. Винс. – М. : Издательский дом «Альпина», 2000. – 401 с
10. Готовчиков И. Ф. Математический анализ стратегий поведения на рынках капитала / И. Ф. Готовчиков // Финансовый менеджмент. – 2003 – № 5. – С. 80–95
11. Грудзевич У. Я. Регіональні особливості формування і розвитку інфраструктури фінансового ринку України : монографія / У. Я. Грудзевич. – Львів : ЛБІ НБУ, 2004. – 182 с
12. Дербенцев В. Д. Синергетичні та екофізичні методи дослідження динамічних та структурних характеристик економічних систем / В. Д. Дербенцев, О. А. Сердюк, В. М. Соловійов. – Черкаси : Брама-Україна, 2010. – 300 с
13. Клебанова Т. С. Математичні методи і моделі ринкової економіки / Т. С. Клебанова, О. В. Раєвнева, К. А. Стрижиченко. – Х. : ВД «ІНЖЕК», 2010. – 450 с.
14. Кузнецов С. П. Динамический хаос (курс лекций) / С. П. Кузнецов. – М. : Издательство физико-математической литературы, 2001. – 256 с
15. Лебо Ч. Компьютерный анализ фьючерсных рынков / Ч. Лебо, Д. В. Лукас ; пер. с англ. – М. : Альпина, 2000. – 304 С
16. Моисеев С. Макроанализ валютного курса: от Касселя до Обстфельда и Рогоффа / С. Моисеев // Вопросы экономики. – 2004.– № 1. – С. 49–65
17. Anthony F. Herbst. Analyzing and forecasting futures prices. – New York: John Wiley & Sons, Inc., 1992. – 238 p
18. Beltrami E. Mathematics for Dynamic Modeling. – Boston: Academic Press, 1987. – 314 p.
19. Granger, C. W. .J. (1969) “Investigating Causal Relations by Econometric Models and Cross-Spectral Methods,” *Econometrica*, 37, 424–438

2.3. Ресурси Інтернет

20. Компанія КІНТО [Електронний ресурс]. – Режим доступу : www.kinto.com.
21. Офіційний сайт Organisation for Economic Co-operation and Development (OECD) [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <http://data.oecd.org/eduatt/population-with-tertiary-education.htm>
22. Офіційний сайт «Forex club» [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <http://www.forex.ua>
23. Офіційний сайт International Telecommunication Union [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <http://www.itu.int>.
24. Офіційний сайт Internet World Stats [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <http://www.internetworldstats.com/stats4.htm>.
25. Офіційний сайт Federal Reserve Economic Data [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <http://www.research.stlouisfed.org/fred2/>
26. Офіційний сайт Державної комісії з регулювання ринків фінансових послуг [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <http://nfp.gov.ua>
27. Офіційний сайт Державної комісії з цінних паперів та фондового ринку [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <http://www.ssmc.gov.ua>
28. Офіційний сайт Московської біржі [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <http://moex.com>

29. Офіційний сайт Національного банку України [Electronic resource]. – Режим доступу <http://www.bank.gov.ua>

30. Офіційний сайт ПФТС [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <http://www.pfts.com>

31. Офіційний сайт Фориншурер страхование [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <http://forinsurer.com/news>