

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

МОДЕЛЮВАННЯ ФІНАНСОВИХ РИНКІВ

(назва навчальної дисципліни)

ПРОГРАМА
навчальної дисципліни
підготовки докторів філософії

зі спеціальності **072 «Фінанси, банківська справа та страхування»**
(шифр і назва спеціальності)

2016 рік

РОЗРОБЛЕНО ТА ВНЕСЕНО:

**Харківський національний економічний університет імені Семена
Кузнеця, кафедра управління фінансовими послугами**
(повне найменування вищого навчального закладу, кафедри)

РОЗРОБНИК ПРОГРАМ: докт. екон. наук, професор Стрижиченко К.А.

Обговорено та рекомендовано до затвердження
Вченою радою ХНЕУ ім. С. Кузнеця
«25» квітня 2016 року, протокол № 9

ВСТУП

Програма вивчення навчальної дисципліни “ Моделювання фінансових ринків ” складена відповідно до освітньо-наукової програми підготовки докторів філософії зі спеціальності 072 «Фінанси, банківська справа та страхування».

Предметом вивчення навчальної дисципліни є комплекс економіко-математичних моделей дослідження та прогнозування фінансового ринку та його складових.

Міждисциплінарні зв'язки:

Математичні методи, моделі та інформаційні технології у наукових дослідженнях

Фінансовий менеджмент і контролінг у сфері бізнесу

Програма навчальної дисципліни складається з таких змістових модулів:

1. Теоретичні засади моделювання фінансового ринку
2. Прикладні аспекти моделювання фінансового ринку

1. Мета та завдання навчальної дисципліни

1.1. Метою викладання навчальної дисципліни «Моделювання фінансових ринків» є формування теоретичних знань та практичних навичок щодо дослідження фінансового ринку, побудови прогнозів та розробки сценаріїв поведінки агентів ринкових відношень на фінансовому ринку.

1.2. Основними завданнями вивчення дисципліни “ Моделювання фінансових ринків ” є

узагальнення інформації, щодо видів економіко-математичних моделей та їх використання в дослідженні фінансових ринків;

вивчення моделей поведінки інвестора на фінансовому ринку

дослідження моделей технічного аналізу на фінансовому ринку;

узагальнення сучасних моделей дослідження тенденцій на фінансовому ринку;

моделювання сценаріїв розвитку елементів фінансового ринку

1.3. Згідно з вимогами освітньо-наукової програми здобувачі освітньо-наукового ступеня "доктор філософії" набувають таких компетентностей:

Здатність розв'язувати проблеми розвитку фінансового ринку в сучасних економічних умовах;

Здатність будувати економіко-математичні моделі для аналізу, прогнозування та регулювання фінансового ринку.

На вивчення навчальної дисципліни відводиться 150 годин 5 кредитів ЄКТС.

2. Інформаційний обсяг навчальної дисципліни

Змістовий модуль 1. Теоретичні засади моделювання фінансового ринку

Тема 1. Методологічні засади моделювання фінансового ринку.

Поняття економіко-математичного моделювання. Його принципи. Сучасні підходи до моделювання фінансового ринку. Класифікація моделей дослідження фінансового ринку.

Тема 2. Моделі поведінки інвестора на фінансовому ринку.

Оптимізаційні моделі. Модель Марковіца. Модель Шарпа. Модель Тобіна. Формування оптимальних портфелів цінних паперів.

Тема 3. Моделі технічного аналізу на фінансовому ринку

Поняття технічного аналізу на фінансовому ринку. Гіпотеза щодо ефективного ринку. Визначення елементів технічного аналізу фінансового ринку

Змістовий модуль 2. Прикладні аспекти моделювання фінансового ринку

Тема 4. Сучасні моделі дослідження тенденцій на фінансовому ринку.

Моделі аналізу часових рядів. Перевірка наявності взаємозалежностей на фінансовому ринку. Дослідження коінтеграційних ефектів на фінансовому ринку. Визначення впливів елементів фінансового ринку між собою.

Тема 5. Моделювання сценаріїв розвитку елементів фінансового ринку.

Побудова сценаріїв розвитку фінансового ринку. Визначення циклічних складових розвитку та випадкових флуктуацій. Дослідження ефективності побудованих сценаріїв

3. Рекомендована література

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.

4. Форма підсумкового контролю успішності навчання - Залік

5. Засоби діагностики успішності навчання: тести, есе, колоквіуми