

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

МОДЕЛЮВАННЯ ФІНАНСОВИХ РИНКІВ

(назва навчальної дисципліни)

МЕТОДИЧНІ РЕКОМЕНДАЦІЇ
до самостійної роботи
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

Самостійна робота здобувача (СРЗ) – це форма організації навчального процесу, за якої заплановані завдання виконуються здобувачем самостійно під методичним керівництвом викладача.

Метою самостійної роботи здобувача в межах навчальної дисципліни «Моделювання фінансових ринків» є засвоєння в повному обсязі навчальної програми та формування у здобувачів загальних і професійних компетентностей, які відіграють суттєву роль у становленні майбутнього доктора філософії.

Навчальний час, відведений для самостійної роботи здобувачів очної форми навчання, визначається навчальним планом і становить 74,6 % (112 години) від загального обсягу навчального часу на вивчення дисципліни (150 годин).

У ході самостійної роботи здобувач має перетворитися на активного учасника навчального процесу, навчитися свідомо ставитися до оволодіння теоретичними і практичними знаннями, вільно орієнтуватися в інформаційному просторі, нести індивідуальну відповідальність за якість власної освітньо-наукової діяльності.

СРЗ в межах навчальної дисципліни «Моделювання фінансових ринків» включає:

- опрацювання лекційного матеріалу;
- опрацювання та вивчення рекомендованої літератури, основних термінів та понять за темами дисципліни;
- підготовку до лабораторних занять;
- поглиблене опрацювання окремих лекційних тем;
- пошук (підбір) та огляд літературних джерел за заданою проблематикою дисципліни;
- контрольну перевірку здобувачами особистих знань за запитаннями для самодіагностики;
- підготовку до контрольних робіт та інших форм поточного контролю;
- систематизацію вивченого матеріалу з метою підготовки до семестрових екзаменів.

2. ЗАВДАННЯ ДЛЯ САМОСТІЙНОЇ РОБОТИ

Завдання самостійної роботи, які передбачені навчальним планом і програмою навчальної дисципліни для засвоєння теоретичних знань і практичних навичок, наведені в табл. 2.1.

Таблиця 2.1

Завдання для самостійної роботи здобувачів та форми її контролю

№ з/п	Компетентності, які забезпечуються	Назва теми	Завдання для самостійної роботи	Кількість годин	Форми контролю СРЗ	Література
Змістовий модуль I. Теоретичні засади моделювання фінансових ринків						

№ з/п	Компетентності, які забезпечуються	Назва теми	Завдання для самостійної роботи	Кількість годин	Форми контролю СРЗ	Література
1.	Здатність розв'язувати проблеми розвитку фінансового ринку в сучасних економічних умовах Здатність будувати економіко-математичні моделі для аналізу, прогнозування та регулювання фінансового ринку	Тема 1. Методологічні засади моделювання фінансового ринку	Проаналізувати сучасні підходи до моделювання фінансового ринку	22	есе	Основна: [3]. Додаткова: [7]
2.		Тема 2. Моделі поведінки інвестора на фінансовому ринку	Дослідити переваги та недоліки моделей Марковіца, Шарпа та Тобіна	22	Есе, тести	Основна: [3]. Додаткова: [4, 6]
3.		Тема 3. Моделі технічного аналізу на фінансовому ринку	Провести компаративний аналіз сучасних методів технічного аналізу	22	Есе, тести	Основна: [1]. Додаткова: [4, 5]
Разом за змістовим модулем I				66		
Змістовий модуль II. Прикладні аспекти моделювання фінансових ринків						
4.	Здатність будувати економіко-математичні моделі для аналізу, прогнозування та регулювання фінансового ринку	Тема 4. Сучасні моделі дослідження тенденцій на фінансовому ринку	Визначити основні тенденції одного з сегментів фінансового ринку	23	Есе, тести	Основна: [3]. Додаткова: [5, 6]
5.		Тема 5. Моделювання сценаріїв розвитку елементів фінансового ринку	Дослідити критерії ефективності сценаріїв	23	Есе, тести	Основна: [2, 3]. Додаткова: [7, 8]
Разом за змістовим модулем II				46		
Разом з навчальної дисципліни				112		

3. СИСТЕМА ОЦІНЮВАННЯ УСПІШНОСТІ САМОСТІЙНОЇ РОБОТИ

Виконання кожного завдання для самостійної роботи оцінюється відповідно до Тимчасового положення "Про порядок оцінювання результатів навчання студентів за накопичувальною бально-рейтинговою системою" ХНЕУ ім. С. Кузнеця (табл. 3.1).

Шкала оцінювання: національна та ЄКТС

Сума балів за всі види навчальної діяльності	Оцінка ЄКТС	Оцінка за національною шкалою	
		для екзамену, курсового проекту (роботи), практики	для заліку
90 – 100	A	відмінно	зараховано
82 – 89	B	добре	
74 – 81	C		
64 – 73	D	задовільно	
60 – 63	E		
35 – 59	FX	незадовільно	не зараховано
1 – 34	F		

Розподіл балів за виконання завдань для самостійної роботи у межах тем змістових модулів навчальної дисципліни наведено в табл. 3.2.

Таблиця 3.2

Розподіл балів за завданнями та змістовними модулями

Завдання для самостійної роботи	Змістовий модуль 1			Змістовий модуль 2		Сума балів
	ЗСР1	ЗСР2	ЗСР3	ЗСР4	ЗСР5	
Максимальна кількість балів	3	3	3	3	3	15

ЗСР– завдання для самостійної роботи здобувача.

Оцінки за цією шкалою заносяться до відомостей обліку успішності та іншої академічної документації.

4. РЕКОМЕНДОВАНА ЛІТЕРАТУРА**4.1. 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. Раєвнєвої. Х.: ВД «ІНЖЕК», 2014. – 578 с.

4.2. 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. Раєвнєва, 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

4.3. 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>