

Силабус навчальної дисципліни
«Управління фінансовими активами на фондовому ринку»

Ступінь вищої освіти – *доктор філософії*

Рік навчання: 2, Семестр: 3

Кількість кредитів: 5

Мова викладання: українська

Підсумковий контроль: диференційований залік

Форма проведення занять: лекції, семінарські заняття

Назва курсу	Управління фінансовими активами на фондовому ринку
Електронна версія курсу	https://moodle.dpu.edu.ua/course/view.php?id=1306

Коротка анотація до курсу:

Дисципліна «Управління фінансовими активами на фондовому ринку» спрямована на формування знань та практичних навичок щодо управління фінансовими активами на фондовому ринку, методи та підходи його аналізу, вмінь та навичок щодо застосування цих знань у роботі в режимі реального часу..

1. Схема дисципліни (приклад)

№ з/п	Тема
Тема 1	Діяльність з управління активами на фондовому ринку
Тема 2	Фінансові активи та їх оцінювання
Тема 3	Інституційні інвестори як суб'єкти управління фінансовими активами на фондовому ринку
Тема 4	Фінансова політика і фінансова стратегія в управлінні активами
Тема 5	Показники та методи фундаментального (класичного) аналізу
Тема 6	Основні засади технічного аналізу фондових ринків
Тема 6	Портфельна теорія і управління ризиком
Тема 7	Модель оцінювання капітальних активів і теорія ринків капіталу

2. Формат курсу:

Змішаний

3. Компетентності, які мають бути сформовані у результаті опанування навчальної дисципліни

Інтегральна компетентність: здатність розв'язувати комплексні проблеми в галузі професійної та/або дослідницько-інноваційної діяльності, що передбачає глибоке переосмислення наявних та створення нових цілісних концептуальних та методологічних знань та/або професійної практики у сфері фінансів, банківської справи, страхування та фондового ринку чи на межі галузей знань або професійної діяльності.

Загальні компетентності:

- Здатність до започаткування, планування, реалізації та коригування послідовного процесу ґрунтовного наукового дослідження з дотриманням належної академічної доброчесності, пошуку, оброблення та аналізу інформації з різних джерел з відповідним критичним аналізом, оцінкою і синтезом нових і комплексних ідей.

- Здатність до мотивації та досягнення спільної мети із безперервним саморозвитком та самовдосконаленням.

Спеціальні (фахові, предметні) компетентності (СК):

- Здатність обирати методи, необхідні для досягнення поставленої мети дослідження.

- Здатність до виконання наукових досліджень у сфері фінансів, банківської справи та страхування на відповідному фаховому рівні, досягнення наукових результатів, що створюють нові знання, для розв'язання актуальних проблем.

- Здатність вибудовувати ефективну систему управління фінансовими ризиками економічних суб'єктів, застосовувати моделі, методи та інструменти фінансового ризик-менеджменту, розробляти механізми управління фінансовими ризиками на макро-, мезо- та мікрорівнях.

4. Результати навчання:

- Здійснювати повний та різносторонній пошук інформації, її систематизацію та аналіз.

- Обирати методи для проведення досліджень у сфері фінансів, банківської справи та страхування, що забезпечують досягнення поставленої мети.

- Виконувати оригінальні наукові дослідження у сфері фінансів, банківської справи та страхування на відповідному фаховому рівні, досягати наукових результатів, що створюють нові знання, для розв'язання актуальних проблем.

- Бути спроможним реалізовувати проекти, включаючи результати власних досліджень, спрямовані на вирішення актуальних проблем у сфері фінансів, банківської справи та страхування.

5. Обсяг курсу

Вид заняття	Загальна кількість годин
Лекції	26
Семінарські заняття	24
Самостійна робота	100

Технічне й програмне забезпечення /обладнання – онлайн-платформи організаторів торгівлі

Неформальна освіта *передбачена*)

6. Політика оцінювання

Політика щодо дедлайнів та перескладання: Завдання, які виконуються із порушенням термінів без поважних причин, оцінюються на нижчу оцінку (-1 бал). Перескладання модулів відбувається із дозволу адміністрації факультету за наявності поважних причин (наприклад, лікарняний).

Політика щодо академічної доброчесності: письмові роботи перевіряються на наявність плагіату і допускаються до захисту із коректними текстовими запозиченнями не

більше 20%. Списування під час контрольних робіт та екзаменів заборонені (в т.ч. із використанням мобільних девайсів).

7.Рекомендована література

Основна:

1. Коваленко Ю. М. Управління фінансовими активами: підруч. Ірпінь: Університет ДФС України, 2019: у 2-х т.
2. Про затвердження Інструкції про порядок регулювання діяльності банків в Україні: Постанова НБУ: від 28.08.2001 № 368. URL: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/z0841-01#Text>
3. Про інститути спільного інвестування: Закон України: від 05.07.12 р. № 1057-IV. URL: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/5080-17#Text>
4. Про недержавне пенсійне забезпечення: Закон України: від 09.07.03 р. № 1057-IV. URL: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/1057-15#Text>
5. Про ринки капіталу та організовані товарні ринки: Закон України: від 23.02.06 р. № 3480-IV. URL: <http://zakon.rada.gov.ua/cgi-bin/laws/main.cgi?nreg=3480-15>
6. Про фінансові послуги та фінансові компанії: Закон України: від 14.12.21 р. № 1953-IX. URL: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/1953-20#Text>

Допоміжна:

7. Коваленко Ю. М., Біловус Т. В. Інвестиційні процеси на ринку цінних паперів: теорія та практика: монографія. Ірпінь, Державний податковий університет, 2023. 260 с.
8. Коваленко Ю.М., Гулей А.І., Унінець-Ходаківська В.П., Рябокін М.В. Сек'юритизація фінансових активів: сутність та причини поширення в економічних процесах. Проблеми і перспективи економіки та управління : науковий журнал. Чернігів: ЧНТУ, 2021. № 4(28). С. 177–185. URL: [https://doi.org/10.25140/2411-5215-2021-4\(28\)-177-185](https://doi.org/10.25140/2411-5215-2021-4(28)-177-185)
9. Коваленко Ю., Шевчук О., Ясентюк А. Особливості розвитку біржового ринку України в умовах пандемії COVID-19. Трансформація підходів в управлінні та маркетингу у постпандемічний період [текст]: [монографія] / під заг. ред. д.е.н., проф. Храпкіної В.В., к.е.н., доц. Пічик К.В. К.: Інтерсервіс, 2022. С. 65–73.

Міжнародні видання:

10. Keown, A.J., Scott, D.F., Martin, J.D., Petty, J.W. (2020) Financial Management. URL: <https://ecampus.unusia.ac.id/repo/handle/123456789/3214>
11. Kovalenko, Yu., Bilovus, T., Unynets-Khodakivska, V., Dombrovska, S., Faizov, A., Baranova, V. (2023) Information management systems in the systematization of indicators for assessing the effectiveness of investment processes in the securities market. *Journal of Information Technology Management*, 13 (1), 36–61. URL: <https://doi.org/10.22059/jitm.2023.90725>
12. On markets in financial instruments amending: Directive of the European Parliament and of the Council: of 21.04.04 № 2004/39/EC. URL: <http://www.mifidirective.com/mifid-directive.pdf>.
13. Tkachenko, N., Kovalenko, Yu., Bohrinovtseva, L. (2022) New Methods in Assessing the Risks and Solvency of Insurance Companies, *Journal of Eastern Europe Research in Business and Economics*, Vol. 2022 (2022), 1–16. URL: <https://doi.org/10.5171/2022.765785>

Інформаційні ресурси ІНТЕРНЕТ:

14. Національна комісія з цінних паперів та фондового ринку. URL: <http://www.nssmc.gov.ua>
15. Національний банк України. URL: <http://www.bank.gov.ua>
16. The European Bank Reconstruction and Development. URL: <http://www.ebrd.com>
17. The European Central Bank. URL: <http://www.ecb.int>
18. The Index of Economic Freedom. URL: www.heritage.org/index.
19. The Federal Reserve System (FRS). URL: <http://www.federalreserve.gov>
20. The Group of Thirty. URL: <http://www.group30.org>
21. The International Monetary Fund (IMF). URL: <http://www.imf.org>

22. The McKinsey & Company. URL: <http://www.mckinsey.com>
23. The United States Agency for International Development (USAID) / Ukraine
URL: ukraine.usaid.gov/ukr
24. The World Bank. URL: <http://worldbank.org>
25. The World Economic Forum. URL: www.weforum.org
26. The World Federation of Exchanges members. URL: <http://www.world-exchanges.org/member-exchanges>