

Силабус навчальної дисципліни «Управління фінансовими активами»



| | |
|---|---|
| Спеціальність | <i>073 Менеджмент</i> |
| Освітня програма | <i>Проектний Менеджмент</i> |
| Освітній рівень | <i>Другий (магістерський)</i> |
| Статус дисципліни | <i>Вибіркова</i> |
| Мова викладання, навчання та оцінювання | <i>Українська</i> |
| Кількість кредитів ЄКТС | <i>5 кредитів</i> |
| Розподіл годин за формами освітнього процесу та видами навчальних занять | <i>Лекції – 26 год. Практичні (семінарські) – 24 год. Лабораторні – 0 год. Самостійна робота – 98 год.</i> |
| Форма семестрового контролю | <i>Диференційований залік</i> |
| Кафедра | <i>Кафедра фінансових ринків та технологій: https://dpu.edu.ua/kafedra-publichnykh-finansiv</i> |
| Викладач (-і) | <i>Коваленко Юлія Михайлівна, доктор економічних наук, професор, академік Академії економічних наук України kovalenko0202@ukr.net</i> |
| Контактна інформація викладача (-ів) | |
| Дні навчальних занять | <i>Лекція: згідно діючого розкладу занять Практичні (семінарські): згідно діючого розкладу занять http://library.nusta.edu.ua/metod-ta-clos-menu</i> |
| Консультації | <i>Очні консультації: вівторок, 13.00-14.00, кафедра фінансових ринків та технологій Онлайн-консультації за потребою</i> |

Мета навчальної дисципліни: у сфері проектного менеджменту про управління активами фінансових корпорацій на ринках капіталу, методи та підходи його аналізу, вмінь та навичок щодо застосування цих знань у роботі на ринках капіталу, зокрема грошового, фондового ринку та ринку деривативних фінансових інструментів, у режимі реального часу.

Структурно-логічна схема вивчення навчальної дисципліни

| Пререквізити | Постреквізити |
|--|--|
| Фінанси підприємства, Організація та планування фінансової діяльності | Проектне бізнес-планування та фінансування, Фінансовий менеджмент |

Зміст навчальної дисципліни

Змістовий модуль 1. Основи діяльності з управління фінансовими активами

Тема 1. Діяльність з управління активами на фінансовому ринку

Тема 2. Фінансові активи та їх оцінювання

Тема 3. Інституційні інвестори як суб'єкти управління фінансовими активами.

Тема 4. Фінансова політика і фінансова стратегія в управлінні активами

Змістовий модуль 2. Реалізація діяльності з управління фінансовими активами

Тема 5. Показники та методи фундаментального (класичного) аналізу

Тема 6. Основні засади технічного аналізу фінансових ринків.

Тема 7. Портфельна теорія і управління ризиком.

Тема 8. Модель оцінювання капітальних активів і теорія ринку капіталу

Матеріально-технічне (програмне) забезпечення дисципліни:

Мультимедійний проєктор ДВНЗ ДПУ, Google Meet

Інформаційне забезпечення з фонду та репозиторію ДВНЗ ДПУ:

1. Коваленко Ю. М. Управління фінансовими активами: підруч. Ірпінь: Університет ДФС України, 2019: у 2-х т.

2. Коваленко Ю. М., Коваль І. А., Близненко Є. О. Вплив моделі сектору фінансових корпорацій і ринку цінних паперів на інвестиційні процеси в Україні. Проблеми і перспективи економіки та управління. 2020. № 2 (22). С. 98–118.

Форми та методи оцінювання

Університет використовує 100 бальну накопичувальну систему оцінювання результатів навчання здобувачів вищої освіти.

Поточний контроль здійснюється під час проведення лекційних, практичних (семінарських) занять і має на меті перевірку рівня підготовленості здобувача вищої освіти до виконання конкретної роботи і оцінюється сумою набраних балів. В кінці кожного змістовного модулю студенти виконують модульну контрольну роботу.

Підсумковий контроль включає семестровий контроль, який проводиться у формі диференційованого заліку. Максимально можлива кількість балів за поточний контроль упродовж семестру для дисципліни форма контролю якої іспит – 100.

Поточний контроль проводиться у вигляді усного та письмового опитування на семінарських заняттях, участі у тренінгах, підготовки індивідуальних завдань, написання контрольних робіт.

Політики навчальної дисципліни

Здобувачі вищої освіти другого (магістерського) рівня повинні дотримуватися академічної доброчесності відповідно до «Положення про організацію освітнього процесу в Державному податковому університеті», Кодексу академічної доброчесності Державного податкового університету».

Дотримання академічної доброчесності здобувачами освіти передбачає:

- самостійне виконання навчальних завдань, завдань поточного та підсумкового контролю результатів навчання (для осіб з особливими освітніми потребами ця вимога застосовується з урахуванням їхніх індивідуальних потреб і можливостей);
- посилення на джерела інформації у разі використання ідей, розробок, тверджень, відомостей;
- дотримання норм законодавства про авторське право і суміжні права;
- надання достовірної інформації про результати власної (наукової, творчої) діяльності, використанні методики досліджень і джерела інформації.

Більш детальну інформацію щодо компетентностей, результатів навчання, методів навчання, форм та методів оцінювання, самостійної роботи наведено у Робочій програмі навчальної дисципліни.