

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ТАВРІЙСЬКИЙ ДЕРЖАВНИЙ АГРОТЕХНОЛОГІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ІМЕНІ ДМИТРА МОТОРНОГО
Кафедра «Підприємництво, торгівля та біржова діяльність»

ЗАТВЕРДЖУЮ

Зав. кафедри

к.е.н. доцент Л.О. Болтянська

«_____» _____ 2020 р.

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

«Біржова справа»

для здобувачів першого (бакалаврського) рівня вищої освіти
зі спеціальності 076 "Підприємництво, торгівля
та біржова діяльність»
факультет економіки та бізнесу

2020– 2021 н.р.

Робоча програма навчального курсу “Біржова справа” для студентів спеціальності 076 "Підприємництво, торгівля та біржова діяльність» другого (магістерського) рівня вищої освіти, Мелітополь, ТДАТУ – 13 с.

Розробник: Терещенко М.А., к е н доцент

Робоча програма затверджена на засіданні кафедри «Підприємництво, торгівля та біржова діяльність»

Протокол від “25” серпня 2020 року № 1

Завідувач кафедри «Підприємництво, торгівля та біржова діяльність»

_____ (Болтянська Л.О.)
(підпис) (прізвище та ініціали)

Схвалено методичною комісією факультету економіки та бізнесу для спеціальності 076 "Підприємництво, торгівля та біржова діяльність» другого (магістерського) рівня вищої освіти

Протокол № 1 від « 31 » серпня 2020 року

Голова, доц. _____ А.А.Костякова

1. ОПИС ПРЕДМЕТА ДИСЦИПЛІНИ

Найменування показників	Галузь знань, напрям підготовки, освітньо-кваліфікаційний рівень	Характеристика навчальної дисципліни	
		денна форма навчання	
Кількість кредитів 4	Галузь знань 07"Управління та адміністрування" (шифр і назва)	Варіативна	
Загальна кількість годин – 120 годин	Напрямок підготовки другий (магістерський) рівень вищої освіти	Курс	Семестр
Змістових модулів - 2		5-й	2-й
Тижневе навантаження: аудиторних занять - 3 год. самостійна робота студента – 3 год.	Освітньо-кваліфікаційний рівень: «Бакалавр»	Вид занять	Кількість годин
		Лекції	28 год.
		Лабораторні заняття	-
		Практичні заняття	42 год.
		Семінарські заняття	-
		Самостійна робота	50 год.
		Форма контролю: іспит	

2 МЕТА ТА ЗАВДАННЯ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Мета курсу – формування системи знань з організації і функціонування біржового ринку як складового елемента інфраструктури ринку, технології здійснення біржових операцій.

Завданнями вивчення дисципліни є ознайомлення з узагальненим досвідом роботи зарубіжних і вітчизняних бірж, вивчення нормативних основ здійснення біржової діяльності України, опанування технології здійснення біржових операцій на різних видах бірж.

У результаті вивчення дисципліни студент повинен знати:

- зміст основних нормативних і законодавчих документів, що регулюють здійснення біржової діяльності;

- основні принципи організації та проведення біржових торгів на товарній і фондовій біржі;

- функцій і завдання посередників на біржах;

- технологію формування ланцюга руху замовлення від покупця до продавця на біржі;

- основи ф'ючерсної торгівлі;

- основні види цінних паперів, що обертаються на фондовому ринку й методи оцінки їх вартості;

вміти:

- розробляти стратегію поведінки гравця на фондовій і товарній біржі;

- розраховувати результат від здійснення певних видів біржових операцій;

- обчислювати рахунки клієнтів щодо ф'ючерсних контрактів;

- використовувати механізм хеджування;

- оцінювати ринкову вартість цінних паперів.

3 ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Змістовий модуль 1. “Теоретичні аспекти біржової справи”

Тема 1. “Суть біржі та її економічна природа”

Роль та місце біржі в економіці. Суть біржі та її економічна природа. Функції та характерні ознаки біржової торгівлі. Види бірж. Становлення біржової торгівлі в Україні. Суть та значення державного регулювання біржової торгівлі. Державне регулювання біржової торгівлі в Україні. Правила торгівлі на біржі.

Рекомендована література:

Основна: [1-3,6,8].

Допоміжна: [2-5,6,9].

Тема 2. “Біржовий товар”

Класифікація біржових товарів. Характеристика біржових товарів. Фінансові інструменти. Біржовий товар, характеристики біржових товарів, біржові стандарти, міжнародні стандарти, варант, індосамент, складське свідоцтво, якість продукції, фінансові інструменти, оферент, спотові і строкові інструменти, акції та їх види, дивіденди, інвестиційний сертифікат, облігація, вексель, депозитний сертифікат, лістинг.

Рекомендована література:

Основна: [1-4,7,9].

Допоміжна: [1-3,8,9].

Тема 3. “Порядок утворення біржі та управління біржовою діяльністю”

Порядок утворення біржі. Форми управління біржовою діяльністю. Організаційна структура управління біржею. Органи управління біржі. Ліцензування біржі. Державне управління діяльністю товарних бірж. Пряме або адміністративне управління. Непряме або економічне управління. Групи робочих органів біржі. Організаційна структура товарної біржі. Органи управління товарної біржі. Біржовий комітет. Котирувальна комісія. Біржовий бюлетень. Арбітражна комісія. Розрахункова палата. Виконачі органи біржі.

Рекомендована література:

Основна: [1,2,6,10].

Допоміжна: [1,2,6-9].

Тема 4. “Учасники біржових операцій”

Засновники та члени біржі. Їх права та обов'язки. Учасники біржових сесій (біржової торгівлі). Характеристика суб'єктів біржового посередництва. Роль, значення та функції брокерської служби на біржі. Винагороди за брокерську діяльність та ефективність їх здійснення.

Рекомендована література:

Основна:[1,4,8,10].

Допоміжна:[1,5,6-9].

Змістовий модуль 2. “Організаційні аспекти біржової справи”**Тема 5 “Організація біржових торгів”**

Організаційна структура управління біржею. Порядок укладання біржових угод. Організація діяльності брокерських фірм. Ведення рахунків клієнтів. Звітність щодо виконання наказів клієнтів. Методи ведення біржових торгів. Клірингові установи.

Рекомендована література:

Основна:[2,4,6,7,10].

Допоміжна:[1,6,7-9].

Тема 6 “Товарний ф’ючерсний контракт як інвестиційний інструмент біржового ринку”

Товарні ф’ючерси як фінансові інструменти. Порядок укладання та виконання ф’ючерсних контрактів. Товарні ф’ючерсні контракти. Хеджинг, хейджери. Ринок ф’ючерсів. Трейдери-спекулянти.

Рекомендована література:

Основна:[1-4,6,8,10].

Допоміжна:[1,4,6-9].

Тема 7 “Хеджування цінових та курсових ризиків за допомогою ф’ючерсної торгівлі”

Суть та основні характеристики хеджування. Основні види хеджування. Досконале хеджування цінових ризиків на ринках сільськогосподарської сировини. Здійснення хеджевих операцій з урахуванням реальних ситуацій на ринках. Особливості хеджування цінових ризиків на ринку реальних товарів. Хеджування курсових ризиків фінансових інструментів.

Рекомендована література:

Основна:[2-4,6,9].

Допоміжна:[1,3,5-8].

4 СТРУКТУРА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Номер тижня	Вид занять	Тема заняттябозавдання на самостійну роботу	Кількість			
			годин			балів
			Лк.	Пр.	СРС	
Змістовий модуль 1. «Теоретичні аспекти біржової справи»						
1-2	Лекція 1	Суть біржі та її економічна природа	4			2
	Практичне заняття 1	Суть біржі та її економічна природа		5		3
	Самостійна робота 1	Робота на навчально-інформаційному порталі			5	
3-4	Лекція 2	Біржовий товар.	3			2
	Практична робота 2	Біржовий товар.		5		2
	Самостійна робота 2	Виконання практичних завдань, робота на навчально-інформаційному порталі			5	2
5-6	Лекція 3	Порядок утворення біржі та управління біржовою діяльністю.	4			2
	Практична робота 3	Порядок утворення біржі та управління біржовою діяльністю.		6		3
	Самостійна робота 3	Виконання практичних завдань, робота на навчально-інформаційному порталі			5	2
7-8	Лекція 4	Учасники біржових операцій	3			2
	Практична робота 4	Учасники біржових операцій		5		2
	Самостійна робота 4	Виконання практичних завдань, робота на навчально-інформаційному порталі			5	3
	ПМК I	Підсумковий контроль за змістовий модуль I			10	10
Всього за змістовий модуль 1			14	21	30	35

Змістовий модуль 2. «Організаційні аспекти біржової справи»						
9-10	Лекція 5	Організація біржових торгів	5			3
	Практична робота 5	Організація біржових торгів		7		3
	Самостійна робота 5	Виконання практичного завдання та робота на навчально-інформаційному порталі			4	2
11-12	Лекція 6	Товарний ф'ючерсний контракт як інвестиційний інструмент біржового ринку	5			3
	Практична робота 6	Товарний ф'ючерсний контракт як інвестиційний інструмент біржового ринку		7		3
	Самостійна робота 6	Виконання практичного завдання та робота на навчально-інформаційному порталі			4	2
13-14	Лекція 7	Хеджування цінних та курсових ризиків за допомогою ф'ючерсної торгівлі	4			3
	Практична робота 7	Хеджування цінних та курсових ризиків за допомогою ф'ючерсної торгівлі		7		3
	Самостійна робота 7	Виконання практичного завдання та робота на навчально-інформаційному порталі			4	3
	ПМК II	Підсумковий контроль за модуль II			10	10
15	ПМК 2					
Всього за змістовний модуль 2			14	21	22	35
Разом ПМК1 та ПМК2			28	42	5	70
Екзамен						30
Разом						100

5. ПЕРЕЛІК ПИТАНЬ, ЩО ВІНОСЯТЬСЯ НА ПІДСУМКОВИЙ МОДУЛЬНИЙ КОНТРОЛЬ № 1

1. Роль та місце біржі в економіці.
2. Суть біржі та її економічна природа.
3. Функції та характерні ознаки біржової торгівлі.
4. Види бірж.
5. Історія формування бірж у Європі та США.
6. Розвиток біржі у дореволюційній Росії.
7. Становлення біржової торгівлі в Україні.
8. Особливості функціонування біржі у сучасному світі та в Україні в кінці ХХ – на початку ХХІ століття.
9. Класифікація біржових торгів.
10. Види біржових контрактів.
11. Характеристика біржових товарів.
12. Фінансові інструменти.
13. Основні правові засади, які регулюють діяльність бірж.
14. Нормативні документи, які регламентують діяльність бірж України.
15. Державно-правове та інституційно-правове регулювання біржової діяльності.
16. Види комерційної діяльності.
17. Організаційна структура управління біржами.
18. Порядок укладання біржових угод.
19. Організація діяльності біржової фірми.
20. Учасники торгів. Механізм біржової торгівлі.
21. Підготовка до проведення біржових торгів, аукціонів.
22. Порядок проведення біржових торгів, аукціонів.
23. Особливості функціонування клірингових палат ф'ючерсних бірж.
24. Засновники та члени біржі.
25. Права та обов'язки засновників та членів бірж.
26. Учасники біржової сесії.
27. Біржові посередники.

28. Сутність і види брокерської діяльності.
29. Правове регулювання брокерської діяльності.
30. Кліринг та система розрахунків за біржовими угодами.

ПЕРЕЛІК ПИТАНЬ, ЩО ВІНОСЯТЬСЯ НА ПІДСУМКОВИЙ МОДУЛЬНИЙ КОНТРОЛЬ № 2

1. Хеджування цінових та цукрових ризиків.
2. Біржова спекуляція на ф'ючерсних ринках.
3. Класифікація товарних бірж в Україні.
4. Створення умов для становлення ф'ючерсних ринків сировини.
5. Товарні ф'ючерси як фінансові інструменти.
6. Товарні опціони.
7. Державне регулювання біржової торгівлі в Україні.
8. Передумови виникнення аграрної біржі.
9. Особливості торговельних операцій на аграрній біржі.
10. Діяльність аграрних бірж в Україні.
11. Фондові біржі світу.
12. Особливості роботи фондових бірж України.
13. Законодавча база України по операціям на фондовій біржі.
14. Ринкові показники світового фондового ринку.
15. Теорія Доу-Джонса, фондові індекси.
16. Правове регулювання діяльності валютної біржі України.
17. Міжнародний валютний ринок.
18. Валютна біржа України.
19. Визначення біржового ринку.
20. Основні етапи розвитку бірж у дореволюційній Росії.
21. Основні етапи розвитку бірж в Україні.
22. Суть та відмінності спот та форвардних угод.
23. Види боргових цінних паперів як об'єктів біржової торгівлі.
24. Суть процедури лістингу на фондовій біржі.

25. Подвійна природа ф'ючерсного контракту.
26. Можливості арбітражу на реальному та ф'ючерських ринках.
27. Суть біржового клірингу.
28. Функції клірингової палати.
29. Основні характеристики опціонів.
30. Сутність, економічні можливості та причини відсутності ф'ючерських ринків в Україні.

6. РЕКОМЕНДОВАНА ЛІТЕРАТУРА

Основна:

1. Про цінні папері та фондовий ринок [Електронний ресурс]: Закон України від 23.02.2006 р. № 3480 –IVзі змінами та доповненнями. – Режим доступу:<http://zakon1.rada.gov.ua/cgi-bin/laws/main.cgi?nreg=3480-15>.
2. Габбард Р. Гроші, фінансова система та економіка / Пер. з англ.; Наук. ред. пер. – М.: Савлук, Д. Олесневич. – К.: КНЕУ, 2004. – 889 с.
3. Дудяк Р.П. Організація біржової діяльності: основи теорії і практикум: Навч. посібник / Р.П. Дудяк. - 2-ге вид., доп. – К.: Магнолія плюс, 2003. – 359с.
4. Зотов И.В. Биржевое дело: Учеб. пособие для студентов вузов / И.В. Зотов, В.И. Успенко. – Х.: Бурун Кн., 2008. – 256 с.
5. Кушнір Т.Б. Економіка і організація біржової торгівлі: Навч. посібник – Харків: Консул, 2003 – 216 с.
6. Пепа Т. В. Біржова діяльність: навч. посіб. для студ. вузів / Т. В. Пепа, Т. І. Пішеніна, В. В. Лавринович. – К.: Ліра – К.: 2009. – 540 с.
7. Солодкий М. О. Біржовий ринок: навч. посіб. / М. О. Солодкий. – К.: Аграрна освіта, 2010. – 565 с .
8. Сохацька О.М. Біржова справа: Підручник. – 2-ге вид. змін. й доп. – Тернопіль: Карт-бланш, К.: Кондор, 2008. – 632 с.
9. Чесноков В.Л. Біржові операції: навч. посібник для студ. вищ. навч. закладів / В.Л. Чесноков; Ред. М. А. Коваленко. – К.: Центр учбової літератури, 2008. – 191 с.
10. Штилик О. Биржа и ее деятельность / О. Штилик. - С-Пб, 2002. – 281 с.

Допоміжна:

1. Брызгин О. Основы биржевой деятельности / О. Брызгин. - К.: ОААУН, 2005. – 364 с.
2. Бердникова Т.Б. Рынок ценных бумаг и биржевое дело / Т.Б. Бердникова. - М.: ИНФРА-М, 2000. – 418 с.

3. Губський Б.В. Біржові технології ринку / Б.В. Губський. - К.: Нора прінт, 2004. – 452 с.
4. Иващенко А.А. Товарная биржа / А.А. Иващенко. - 2-е изд. - М.: Международные отношения, 2001. – 289 с.
5. Жуков Е.Ф. Ценные бумаги и фондовые рынки: Учеб. Пособие / Е.Ф. Жуков. - М. 2001. – 381с.
6. Каменева Н.Г. Организация биржевой торговли: Учебник для вузов / Н.Г. Каменева.- М.: Банки и биржи, ЮНИТИ, 2007. – 375 с.
7. Рынок ценных бумаг: Учебник/Под ред. В.А.Галанова, А.И.Басова.- М.: Финансы и статистика, 2006.– 306 с.
8. Петрашко Л.П. Валютні операції: Навч. посіб. / Л.П. Петрашко-К.: КНЕУ, 2009. – 374 с.
9. Шелудько В.М. Фінансовий ринок / В.М. Шелудько. - К.: Знання-Прес, 2008. – 387 с.

7. ІНФОРМАЦІЙНІ РЕСУРСИ

Література бібліотеки Університету і методичного кабінету кафедри.

Користування Internet.

Користування нормативно-технічною літературою мелітопольського центру стандартизації, метрології та сертифікації.