

УКРАЇНСЬКИЙ ДЕРЖАВНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ЗАЛІЗНИЧНОГО ТРАНСПОРТУ

Затверджено
на засіданні кафедри
фінансів, обліку і аудиту
прот. № 1 від 29.08.2024 р.



ТРЕЙДИНГ НА СВІТОВИХ ФІНАНСОВИХ РИНКАХ

**Силабус
2024/2025**

Галузь знань	07 Управління та адміністрування
Спеціальність	072 Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок
Освітня програма	Управління фінансами, банківська справа та страхування
Освітній рівень	перший (бакалавр)
Цикл підготовки	вибірковий
Кількість кредитів ЄКТС	6
Семестр	8
Сторінка курсу в MOODLE	
Лектор курсу – Єрмоленко Олексій Анатолійович (к.е.н., доцент)	
Профайл викладача – https://kart.edu.ua/staff/iermolenko-oa	
Контакти викладача (e-mail): yermolenko@kart.edu.ua	
Час та аудиторія проведення занять: згідно розкладу – http://rasp.kart.edu.ua/	
Додаткові інформаційні матеріали: http://lib.kart.edu.ua	

Світові фінансові ринки відкривають великі перспективи для кожної людини, а з розвитком інтернет-технологій ця сфера діяльності стала доступна всім. Одна з найбільш високодохідних і популярних професій наших днів, що пов'язана з отриманням прибутку на світових біржах, професія трейдера. Фінансисти корпорацій, аналітики, торговці фінансових інститутів та біржові спекулянти щоденно приймають багато рішень про купівлю-продаж різних фінансових і матеріальних активів. Для зменшення ризику таких операцій та отримання очікуваних прибутків від своїх вкладень кожен із них повинен знати і аналізувати цілий ряд факторів, що впливають на ринкові ціни та курси і породжують тенденції зростання чи зниження.

За умови незмінності попиту та пропозиції, коли ціни не коливаються, ринкова ситуація характеризується ціновою стабільністю. В останні 10-15 років на світових ринках цінова стабільність спостерігається надзвичайно рідко. Оскільки події на зарубіжних ринках впливають на становлення ринків в Україні, їх учасникам (продавцям, покупцям і посередникам) необхідно сприйняти цінову нестабільність як реальний факт та навчитися управляти відповідними ризиками.

Людство займається фінансами не так вже й довго, саме тому часто люди помиляються, адже фінанси – це сфера ризику й непевності. Врахувати та нейтралізувати ці ризики можна тільки за допомогою ретельного вивчення цікавого та дуже корисного курсу «Трейдинг на світових фінансових ринках», який допоможе оволодіти методами і прийомами фундаментального та технічного аналізу й їх практичного застосування при прийнятті зважених управлінських рішень на фінансових і товарних ринках.

Курс цей курс має на меті сформувати та розвинути наступні компетентності студентів:

Загальні компетентності

ЗК01. Здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу.

ЗК02. Здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях.

ЗК07. Здатність вчитися і оволодівати сучасними знаннями.

ЗК15 Здатність ухвалювати рішення та діяти, дотримуючись принципу неприпустимості корупції та будь-яких інших проявів недоброчесності.

Спеціальні (фахові, предметні) компетентності

СК01. Здатність досліджувати тенденції розвитку економіки за допомогою інструментарію макро- та мікроекономічного аналізу, оцінювати сучасні економічні явища.

СК02. Розуміння особливостей функціонування сучасних світових та національних фінансових систем та їх структури.

СК05. Здатність застосовувати знання законодавства у сфері монетарного, фіскального регулювання та регулювання фінансового ринку.

СК11. Здатність підтримувати належний рівень знань та постійно підвищувати свою професійну підготовку.

Програмні результати навчання

ПР01. Знати та розуміти економічні категорії, закони, причинно-наслідкові та функціональні зв'язки, які існують між процесами та явищами на різних рівнях економічних систем.

ПР02. Знати і розуміти теоретичні основи та принципи фінансової науки, особливості функціонування фінансових систем.

ПР03. Визначати особливості функціонування сучасних світових та національних фінансових систем та їх структури.

ПР04. Знати механізм функціонування державних фінансів, у т.ч. бюджетної та податкової систем, фінансів суб'єктів господарювання, фінансів домогосподарств, фінансових ринків, банківської системи, страхування та фондового ринку.

Вивчення даної дисципліни формує у здобувачів освіти соціальні навички (soft skills): комунікативність (реалізується через: метод роботи в парах та групах, метод самопрезентації), робота в команді (реалізується через метод проєктів), лідерські навички (реалізується через: робота в групах, метод самопрезентації).

Чому ви маєте обрати цей курс?

Трейдинг – це чесний бізнес, результати якого підтасувати неможливо, адже єдиним підсумком є отриманий прибуток, наявність якого цілком залежить від Вас. У роботі на фінансових ринках не існує поняття «максимальний дохід» – тут все індивідуально і залежить тільки від цілей, рівня підготовки та особистих якостей трейдера.

Якщо ви любите аналізувати і прогнозувати, довіряєте своїй інтуїції і хочете навчитися заробляти за допомогою власного інтелекту, трейдер – ідеальна професія для вас!

Методи навчання

Цей курс дає студентам глибоке розуміння теоретичних, організаційно-правових та практичних засад організації трейдингу.

Курс супроводжується текстовим матеріалом, презентаціями та груповими завданнями. Студенти самостійно зможуть працювати в умовах роботи фондової, товарної, валютної біржі, біржі криптовалют; управляти процесами біржових обігів відповідно до законодавчих і нормативних актів, статуту і правил фондової біржі; створювати інформаційну базу даних професійних учасників ринку цінних паперів; уміння формувати оптимальні напрямки інвестиційної діяльності, здійснювати її диверсифікацію; обмежувати фінансові ризики в інвестиційній діяльності; базувати діяльність інвестиційних фондів і компаній на принципі диверсифікації вкладень.

Практичні заняття курсу передбачають вивчення прийомів та методів оцінки статистичних показників із застосуванням інструментарію економіко-математичного моделювання та інформаційних технологій. Виконання завдань супроводжується зануренням у суміжні дисципліни, що доповнюють теми, та формує у студента інформаційну та комунікативну компетентності

Теми курсу

Тема 1 Основи фінансових ринків та їх роль у світовій економіці

- Огляд фінансових ринків і їх функцій
- Важливість фінансових ринків для світової економіки
- Взаємозв'язок фінансових ринків з економічними процесами

Тема 2 Типи фінансових інструментів та їх характеристика

- Основні види фінансових інструментів (акції, облігації, валютні пари)
- Характеристика ф'ючерсів, опціонів і товарних контрактів
- Ризики та можливості при використанні різних інструментів

Тема 3 Фундаментальний аналіз у трейдингу

- Основи макроекономічного аналізу для трейдерів
- Вивчення ключових економічних показників (ВВП, рівень інфляції, безробіття)
- Вплив новин та подій на фінансові ринки

Тема 4 Технічний аналіз у трейдингу

- Огляд основних інструментів технічного аналізу (графіки, індикатори)
- Визначення трендів та патернів на ринку
- Використання рівнів підтримки та опору в трейдингу

Тема 5 Психологія трейдингу та управління ризиками

- Роль емоцій у трейдингу та їх вплив на прийняття рішень

- Стратегії контролю за емоціями та дисципліна трейдера
- Методи управління ризиками та зниження збитків

Тема 6 Торгівля на валютному ринку (Forex)

- Особливості торгівлі на ринку Forex та механізми ціноутворення
- Вибір валютних пар для торгівлі
- Техніки та стратегії для успішної торгівлі на Forex

Тема 7 Торгівля на фондовому ринку

- Основи торгівлі акціями та облігаціями
- Стратегії інвестування в акції та фондові індекси
- Оцінка фондових ринків та вибір перспективних інструментів

Тема 8 Торгівля на товарних і ф'ючерсних ринках

- Особливості роботи з товарними ринками (нафта, золото, сільськогосподарські продукти)
- Вивчення ф'ючерсних контрактів та стратегій їх використання
- Хеджування ризиків на товарних ринках

Тема 9 Алгоритмічний трейдинг та автоматизація торгових процесів

- Основи алгоритмічного трейдингу та його переваги
- Використання торгових роботів та автоматичних систем
- Програмування для трейдингу та тестування торгових стратегій

Тема 10 Стратегії та методи успішного трейдингу

- Різноманітні стратегії трейдингу (трендові, контртрендові)
- Методи вибору торгових стратегій для різних ринків
- Техніки оптимізації і тестування торгових стратегій для підвищення ефективності.

Ресурси курсу

Інформація про курс розміщена на сайті Університету <https://kart.edu.ua> включаючи навчальний план, лекційні матеріали, завдання та правила оцінювання курсу.

Додатковий матеріал та посилання на електронні ресурси доступні на сайті Університету у розділі «дистанційне навчання» поряд із питаннями, над якими необхідно поміркувати підчас підготовки для обговорення в аудиторії.

- 1 <http://lib.kart.edu.ua/> (Електронний портал УкрДУЗТ)
- 2 <http://portal.rada.gov.ua> (Офіційний портал Верховної Ради України)
- 3 <http://kmu.gov.ua> (Єдиний веб-портал органів виконавчої влади України)
- 4 <http://minfin.gov.ua> (Міністерство фінансів України)
- 5 <https://www.nssmc.gov.ua> (Національна комісія з цінних паперів та фондового ринку)
- 6 <http://www.ux.ua> (Офіційний сайт Української біржі)
- 7 <http://www.pfts.ua> (Офіційний сайт Фондової біржі ПФТС)

Сфера реалізації набутих знань і вмінь в майбутній професії

Знання та вміння, набуті при вивченні дисципліни «Трейдинг на світових фінансових ринках» студенти зможуть застосувати, працюючи у державних установах, підприємствах різних форм власності й видів економічної діяльності, зокрема у структурних підрозділах Укрзалізниці. Вони можуть бути використані випускниками на посадах менеджерів у фінансових організаціях, фінансових консультантів, експертів, економістів, аналітиків, держслужбовців профільних установ.

Форми і методи оцінювання

При оцінюванні результатів навчання керуватися Положенням про контроль та оцінювання якості знань студентів в УкрДУЗТ

<https://kart.edu.ua/wp-content/uploads/2020/05/pologennya-pro-kontrol-ta-ocinuvannya-2015.pdf>

Методи контролю: усне опитування, поточний контроль, модульний контроль (тести),

підсумкове тестування, залік.

Згідно з Положенням про впровадження кредитно-модульної системи організації навчального процесу використовується 100-бальна шкала оцінювання.

Принцип формування оцінки за модуль у складі залікових кредитів I і II за 100- бальною шкалою показано у таблиці, де наведена максимальна кількість балів, яку може набрати студент за різними видами навчального навантаження.

Для контролю знань за практичною складовою дисципліни у вигляді письмової контрольної роботи. Письмові контрольні роботи – це ефективний метод перевірки й оцінки знань, вмінь і навичок студентів, а також їх творчих здібностей, що дає можливість у найбільш короткий термін одночасно перевірити засвоєння навчального матеріалу всіма студентами групи та визначити напрями для індивідуальної роботи з кожним. Однорідність робіт, що виконуються студентами, дозволяє пред'являти до всіх однакові вимоги й об'єктивно оцінювати результати навчання.

Максимальна кількість балів за модуль		
Поточний контроль	Модульний контроль (тести)	Сума балів за модуль
до 60	до 40	до 100
Поточний контроль		1 (2) семестр
Виконання практичних завдань (усне і письмове опитуване)		20
Виконання та захист самостійних робіт відповідно до варіанту		20
Тестові завдання за темами курсу		20
підсумок		60

Студент, який з поважних причин, підтверджених документально, не мав можливості брати участь у формах поточного контролю (не склав змістовий модуль), має право на його відпрацювання у двотижневий термін після повернення до навчання за розпорядженням декана відповідно до встановленого терміну.

При заповненні екзаменаційної відомості та залікової книжки (індивідуального навчального плану) студента, оцінка, виставлена за 100-бальною шкалою, повинна бути переведена до національної шкали (5, 4, 3) та шкали ECTS (A, B, C, D, E)

Визначення назви за державною шкалою(оцінка)	Визначення назви за шкалою ECTS	За 100 бальною шкалою	ECTS оцінка
ВІДМІННО – 5	Відмінно – відмінне виконання лише з незначною кількістю помилок	90-100	A
ДОБРЕ – 4	Дуже добре – вище середнього рівня з кількома помилками	82-89	B
	Добре – в загальному правильна робота з певною кількістю грубих помилок	75-81	C
ЗАДОВІЛЬНО - 3	Задовільно - непогано, але зі значною кількістю недоліків	69-74	D
	Достатньо – виконання задовольняє мінімальні критерії	60-68	E
НЕЗАДОВІЛЬНО - 2	Незадовільно – потрібно попрацювати перед тим як отримати залік (без повторного вивчення модуля)	35-59	FX
	Незадовільно - необхідна серйозна подальша робота (повторне вивчення модуля)	<35	F

Кодекс академічної доброчесності

Політика забезпечення дотримання учасниками освітнього процесу академічної доброчесності визначається Кодексом академічної доброчесності Українського державного університету залізничного транспорту <https://kart.edu.ua/wp-content/uploads/2020/06/kodex.pdf>

Основні заходи запобігання та виявлення академічного плагіату визначаються Положенням про організацію освітнього процесу Українського державного університету залізничного транспорту <https://kart.edu.ua/wp-content/uploads/2021/02/polozhennja-pro-oop-ukrduzt-2021.pdf>

Інтеграція студентів із обмеженими можливостями

Вища освіта є провідним чинником підвищення соціального статусу, досягнення духовної, матеріальної незалежності і соціалізації молоді з обмеженими функціональними можливостями й відображає стан розвитку демократичних процесів і гуманізації суспільства.

Для інтеграції студентів із обмеженими можливостями в освітній процес Українського державного університету залізничного транспорту створена система дистанційного навчання на основі сучасних педагогічних, інформаційних, телекомунікаційних технологій.

Доступ до матеріалів дистанційного навчання з цього курсу можна знайти за посиланням: <http://do.kart.edu.ua/>