

# СИЛАБУС ОСВІТНЬОЇ КОМПОНЕНТИ



## РИНОК ФОРЕКС (FOREX)

спеціальність	не обмежено	обов'язковість дисципліни	вибіркова
освітня програма	не обмежено	інститут, факультет	Інститут «Кіберпорт»
освітній рівень	перший (бакалаврський)	кафедра	фінансів, банківської справи та страхування

### ВИКЛАДАЧ

#### БЛИЗНЮК ОКСАНА ПАВЛІВНА



Вища освіта – спеціальність «Економіка торгівлі»

Науковий ступень – кандидат економічних наук 08.07.05 «Економіка торгівлі та послуг»

Вчене звання – доцент кафедри фінансів

Досвід роботи – більше 30 років

Показники професійної активності з тематики курсу:

- авторка більше ніж 190 наукових та навчально-методичних праць, в тому числі статей, що індексуються в наукометричних базах Scopus та Web of Science, навчальних посібників – 8, монографій – 6.
- напрям наукових досліджень: «Управління фінансовими ресурсами та інвестиційною діяльністю підприємств з використанням інструментів фінансового ринку»; під керівництвом захищено 1 дисертацію – кандидат економічних наук; 1 дисертацію – доктор філософії; керівництво аспірантами;
- співвиконавець 12 держбюджетних, бюджетних та госпдоговірних НДР;
- отримано 8 свідоцтв про реєстрацію авторського права на твір;
- учасниця наукових і методичних конференцій.

телефон	050-93-40-977	електронна пошта	bliznukoksanap@gmail.com	дистанційна підтримка	Moodle
---------	---------------	------------------	--------------------------	-----------------------	--------

## ЗАГАЛЬНА ІНФОРМАЦІЯ ПРО ОСВІТНЮ КОМПОНЕНТУ (ДИСЦИПЛІНУ)

Мета	формування компетентностей проведення конверсійних операцій на валютному (Forex) та фондовому ринках в системі світового фінансового ринку; розуміння особливостей функціонування ринку Forex, видів та методів конверсійних валютних операцій для ведення бізнесу в умовах нестабільної динаміки валютних курсів; володіти базовими основами трейдингу з використанням популярних фінансових інструментів, торговельних платформ та терміналів.
Формат	лекції, практичні заняття, самостійна робота, індивідуальні завдання, командна робота, тренінг
Деталізація результатів навчання і форм їх контролю	<ul style="list-style-type: none"> <li>розуміння особливостей функціонування та розвитку сучасного ринку Forex, сутності, функцій та особливостей валюти та валютних відносин; інститутів, суб'єктів та інструментів валютного ринку, формування валютного курсу, кон'юнктури валютного ринку, поняття конвертованості та котирування валют / <b>практичні заняття, індивідуальні завдання</b></li> <li>здатність аналізувати динаміку валютних курсів, розраховувати поточні валютні курси методами прямого та непрямого котирування, визначення крос-курсів / <b>практичні заняття, індивідуальні завдання, тренінг</b></li> <li>здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях, здійснювати поточні та строкові конверсійні валютні операції на умовах спот і форвард (ф'ючерси, форварди, опціони, свопи, арбітраж); застосовувати методикку хеджування валютних ризиків / <b>практичні заняття, індивідуальні завдання, тренінг</b></li> <li>володіти базовими основами трейдингу на валютному ринку з використанням популярних фінансових інструментів торговельних платформ та терміналів / <b>практичні заняття, індивідуальні завдання, тренінг</b></li> </ul>
Обсяг і форми контролю	3 кредити ECTS (90 годин): 12 годин – лекції, 18 годин – практичні; підсумковий контроль – залік.
Вимоги викладача	вчасне виконання практичних та індивідуальних завдань, активність, командна робота
Умови зарахування	вільне зарахування

## СТРУКТУРА ОСВІТНЬОЇ КОМПОНЕНТИ (ДИСЦИПЛІНИ)

Лекція 1	Економічна сутність, призначення, історія створення ринку Forex та його роль в розвитку світового валютного ринку	Практичне заняття 1	Історія створення ринку Forex та його роль в розвитку міжнародного валютного ринку. Характеристика структурних сегментів та основних учасників ринку Forex. Особливості сучасного світового ринку Forex та його розвиток в Україні	Самостійна робота	Класифікація та характеристика касових та строкових операцій на ринку Forex та фондового ринку: конверсійні, спот, форвардні, ф'ючерсні, опціонні, валютний своп і арбітраж.
Лекція 2	Механізм валютного котирування та формування валютних курсів	Практичне заняття 2	Сутність валюти та валютних відносин. Класифікація валют. Валютний ринок. Об'єкти та суб'єкти, попит та пропозиція на валютному ринку. Валютний курс, види валютних курсів. Методи котирування валют. Пряме та непряме котирування валют. Визначення крос-курсу валют. Оцінка ефективності операцій, пов'язаних з конвертованістю валют		Визначення ринкового курсу, рівня інвестиційного ризику та дохідності валютних та фондових інструментів.
Лекція 3	Характеристика конверсійних операцій на ринку Forex	Практичне заняття 3	Поняття конверсії валюти. Види конверсійних операцій на валютному ринку, їх класифікація на касові (поточні) та строкові (термінові). Поточні валютні операції: тод (tod), том (tom), спот (spot)		Види деривативів, їх класифікація, особливості використання та обігу.

		Практичне заняття 4	Строкові валютні операції: форвардні (forward), ф'ючерсні (futures), опціонні (options), валютний своп (swap), валютний арбітраж. Валютна позиція банку. Хеджування валютних ризиків	Самостійна робота	Основи організації та функціонування фондових бірж. Статут, правила, лістинг.
Лекція 4	Економічна сутність, функції, структура та інструменти фондового ринку	Практичне заняття 5	Економічна роль та структуризація фондового ринку: первинного, вторинного, біржового та позабіржового. Основні учасники фондового ринку: емітенти цінних паперів, інвестори, посередники (брокери, дилери), інститути державного регулювання. Класифікація основних інструментів фондового ринку та механізм їх функціонування: пайових (акцій), боргових (облігацій), похідних цінних паперів (деривативів)		Методичні аспекти, інструменти фундаментального та технічного аналізу, рейтингової оцінки інструментів ринку Forex та фондового ринку.
Лекція 5	Фундаментальний та технічний аналіз ринку Forex	Практичне заняття 6	Фундаментальний аналіз інструментів ринку Forex та фондового ринку, його методи та значення для прийняття інвестиційних рішень. Рейтингова та фінансова оцінка інструментів ринку Forex та фондового ринку. Формування курсової вартості валютних та фондових інструментів. Фінансово-економічні показники оцінки інвестиційної привабливості валютних та фондових інструментів, оцінка їх внутрішньої вартості		Фінансовий інжиніринг. Створення нових фінансових інструментів. Стелажна угода. Стренг, стреп, стріп, спред.
		Практичне заняття 7	Технічний аналіз ринку Forex та фондового ринку. Методи аналізу. Побудова лінійних та стовпчикових біржових графіків. Фондові індекси. Значення технічного аналізу для прийняття інвестиційних рішень на ринку Forex та фондовому ринку		Глобальні інвестиційні сертифікати.  Міжнародні та зарубіжні фондові індекси: Dow Jones Global Indexes, MSCI, FTSE, DAX, Standard and Poors, MMVB, RTS.
Лекція 6	Основи трейдингу на ринку Forex з використанням торговельних платформ та інструментів трейдера	Практичне заняття 8	Фондова біржа. Основні функції та правила фондової біржі. Лістинг цінних паперів. Порядок котирування та визначення курсової ціни фондових інструментів. Включення до курсового бюлетеня, правила реєстрації угод. Міжнародні та зарубіжні фондові індекси. Фондові індекси України. Позабіржова фондова торговельна система України (ПФТС)	Фондові індекси України: UX, UTX, PFTS, UAI-50, KAC - 20 (W), SB50 Ukraine, KPDCI USD, «Wood-15».	
		Практичне заняття 9	Основи трейдингу на ринку Forex та фондовому ринку з використанням популярних фінансових інструментів, торговельних платформ та терміналів. Маржинальна торгівля. Дата валютування та похідні інструменти. Відкриття навчальних рахунків в терміналах InstaTrader та InstaForex. Навчання базовим основам торгівлі з використанням торговельних систем	Позабіржова фондова торговельна система (ПФТС), її роль. Організація торгівлі на ПФТС. Індекс, лістинг, кліринг ПФТС.	

## ОСНОВНА ЛІТЕРАТУРА ТА МЕТОДИЧНІ МАТЕРІАЛИ

Література

1. Фінансовий ринок : курс лекцій для здобувачів вищої освіти першого (бакалаврського) рівня спеціальності 072 Фінанси, банківська справа та страхування галузі знань 07 Управління та адміністрування / О. П. Близнюк. – Х.: ХДУХТ, 2019. – 176 с.
2. Арт Ян. Forex для скептиків. – ВД «Маковського», 2016. – 265 с.
3. Каверіна І. Forex – це просто. 2016. – 232 с. [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <https://readli.net/chitat-online/?b=272115&pg=1>
4. Мерфі Дж. Технічний аналіз фінансових ринків. [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <https://tradexperts.ru/knigi-foreks/knigi-po-tehnicheskomu-analizu/tehnicheskij-analiz-finansovyh-rynkov-dzhon-dzh-merfi>
5. Возний Д. Код Елліотта: хвильовий аналіз ринку Forex. – М.: Омега-Л, 2006. – 240 с.

Методичне забезпечення

1. Близнюк О.П., Іванюта О.М. Методичні рекомендації та завдання для самостійної роботи з дисципліни «Фінансовий ринок» для здобувачів вищої освіти першого (бакалаврського) рівня спеціальності 072 Фінанси, банківська справа та страхування галузі знань 07 Управління та адміністрування – Х.: Видавець Іванченко І.С., 2020. – 73 с.
2. Близнюк О.П. Збірник тестових завдань для самостійної роботи з дисципліни «Фінансовий ринок та ринок Forex» для здобувачів вищої освіти першого (бакалаврського) рівня спеціальності 072 Фінанси, банківська справа та страхування галузі знань 07 Управління та адміністрування – Х.: ДБТУ, 2022. – 71 с.
3. Forex-трейдинг: практичні аспекти торгівлі на світових ринках. – Вид-во «Смартбук», 2009. – 232 .
4. Трейдинг в TeleTrade [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <https://www.teletrade.com.ua/uk/education/materials>

## СИСТЕМА ОЦІНЮВАННЯ

СИСТЕМА		БАЛИ	ДІЯЛЬНІСТЬ, ЩО ОЦІНЮЄТЬСЯ
Підсумкове оцінювання	100 бальна ECTS (стандартна)	до 30	відповіді на тестові питання
		до 20	виконання індивідуальних завдань
		до 20	результат засвоєння блоку самостійної роботи
		до 30	підсумкове тестування

## НОРМИ АКАДЕМІЧНОЇ ЕТИКИ ТА ДОБРОЧЕСНОСТІ

Всі учасники освітнього процесу (в тому числі здобувачі освіти) повинні дотримуватися кодексу академічної доброчесності та вимог, які прописані у положенні «Про академічну доброчесність учасників освітнього процесу ДБТУ»: виявляти дисциплінованість, вихованість, поважати гідність один одного, проявляти доброзичливість, чесність, відповідальність.