



## Силабус курсу Аналіз та прогнозування макро- та мікрофінансових змінних

Ступінь вищої освіти: магістр

Освітньо-наукова програма: Аналітична економіка

Спеціальність: 051 Економіка

Галузь знань: 05 Соціальні та поведінкові науки

Рік навчання: I, Семестр: II

Кількість кредитів: 5      Мова викладання: українська

### Керівник курсу

ППП	к.е.н., доцент <b>Чирак Ірина Миколаївна</b>
Контактна інформація	<a href="mailto:i.chyrak@wunu.edu.ua">i.chyrak@wunu.edu.ua</a> +38 0352 47-50-50*13304

### Опис дисципліни

Дисципліна «Аналіз та прогнозування макро- та мікрофінансових змінних» спрямована на формування у студентів теоретичних знань та вироблення практичних навичок щодо використання сучасних прикладних методів аналізу та прогнозування макро- та мікрофінансових змінних, формування аналітичних та дослідницьких навичок економетричного дослідження динаміки активів на фінансових ринках, володіння інструментарієм фінансового аналізу оцінки інвестиційних рішень, системи навичок для виявлення структурних причинно-наслідкових зв'язків фінансових показників, які дозволять студентам самостійно орієнтуватися в складних проблемах функціонування фінансового ринку.

## Структура курсу

Години (лекц./ практ.)	Теми	Результати навчання	Завдання
2/2	1. Предмет і методологія вивчення дисципліни «Аналіз та прогнозування макро- та мікрофінансових змінних»	Розуміти зміст та завдання навчальної дисципліни «Аналіз та прогнозування макро- та мікрофінансових змінних», її взаємозв'язок з іншими навчальними дисциплінами; усвідомити зміст методів аналізу та прогнозування на сучасному етапі розвитку економіки	Тести, питання
4/4	2. Вартісна оцінка фінансових активів	Здійснювати оцінку та приймати управлінські рішення на основі максимізації вартості активів	Тести, питання, задачі
4/4	3. Оцінка справедливої вартості фінансових інструментів	Застосовувати оцінку справедливої вартості до фінансових активів та фінансових зобов'язань; опанувати методи оцінки справедливої вартості фінансових інструментів	Тести, питання, задачі
4/4	4. Аналіз моделей ціноутворення фінансових активів	Здійснювати аналіз сучасних моделей ціноутворення активів на фінансовому ринку	Тести, питання, задачі
4/4	5. Аналіз дохідності фінансових активів	Здійснювати портфельний аналіз, визначати ефективний і оптимальний фінансовий портфель	Тести, питання, задачі
4/4	6. Аналіз та управління фінансовими ризиками	Визначати вид та величину фінансових ризиків, розуміти особливості та принципи управління фінансовими ризиками	Тести, питання, задачі
4/4	7. Фінансове прогнозування як елемент управління фінансовими активами	Здійснювати прогнозування цін на фінансових ринках, прогнозування валютного курсу та процентних ставок	Тести, питання, задачі
4/4	8. Прогнозування та хеджування фінансових ризиків	Володіти методичним інструментарієм прогнозування ризиків та динаміки процентних ставок на фінансових ринках, здійснювати прогнозування валютного курсу та оцінювання валютного ризику	Тести, питання, задачі

## Літературні джерела

1. Базилінська, О. (2019). Фінансовий аналіз: теорія та практика. *Центр навчальної літератури*, 328 с.
2. Еш, С. (2019). Ринок фінансових послуг: підручник. Центр навчальної літератури, 400 с.
3. Лактіонова, О. (2019). Інвестування: навчальний посібник. Вінниця: 256 с.
4. Мойсеєнко, І., Рєвак, І. (2019). Інвестиційний аналіз :навч. посіб. Львів :ЛьвДУВС, 276 с.
5. Рузакова, О. (2022). Аналіз сучасних методик оцінювання фінансового стану підприємства. *Вісник Хмельницького національного університету*, № 2, с. 7-13.
6. Селіверстова, Л., Скрипник, О. (2019). Фінансовий аналіз: навчальний посібник. Центр навчальної літератури, 274 с.
7. Beattie, A. (2020). *Business Forecasting: Understanding the Basics*. Investopedia, 432 p.
8. Beckett-Camarata, J. (2020), "References", *Public-Private Partnerships, Capital Infrastructure Project Investments and Infrastructure Finance*, Emerald Publishing Limited, Bingley, pp. 225-241.
9. Blokdyk, G. (2020). *Fixed Assets Management A Complete Guide - Edition Paperback*, 317 p.
10. Green, F. (2021). *How To Make Money In Stocks: A Guide To Stock Market Investing For Beginners To Show That Wealthy People And Hedge Funds Shouldn't Have All The Fun Paperback*, 150 p.
11. Hamilton, Ch. (2021). *Stock Market Terminology for Beginners: A Complete Guide to learning the Stock Market Lingo Paperback*, 84 p.
12. He, S. (2020). *Real Estate Investing Quick Start Guide: The Simplified Beginner's Guide to Successfully Securing Financing, Closing Your First Deal, and Building ... Real Estate*, 313 p.
13. Hyndman, R.J., & Athanasopoulos, G. (2021) *Forecasting: principles and practice*, 3rd edition, OTexts: Melbourne, Australia.
14. Mladjenovic, P. (2020). *Stock Investing for Dummies Paperback*, 400 p.
15. Shang, Z. (2021). *The Research of Financial Forecasting and Valuation Models*. Graduate School of Management, Atlantis Press. URL: [file:///C:/Users/%D0%86%D1%80%D0%B0/Downloads/The\\_Research\\_of\\_Financial\\_Forecasting\\_and\\_Valuatio.pdf](file:///C:/Users/%D0%86%D1%80%D0%B0/Downloads/The_Research_of_Financial_Forecasting_and_Valuatio.pdf).

## Політика оцінювання

● **Політика щодо дедлайнів та перескладання:** роботи, які здаються із порушенням термінів без поважних причин, оцінюються на нижчу оцінку (-20 балів). Перескладання модулів відбувається із дозволу деканату за наявності поважних причин (наприклад, лікарняний).

● **Політика щодо академічної доброчесності:** списування під час контрольних робіт та екзаменів заборонені (в т.ч. із використанням мобільних девайсів). Мобільні пристрої дозволяється використовувати лише під час он-лайн тестування.

● **Політика щодо відвідування:** відвідування занять є обов'язковим компонентом оцінювання, за яке нараховуються бали. За об'єктивних причин (наприклад, хвороба, міжнародне стажування) навчання може відбуватись в онлайн формі за погодженням із керівником курсу.

### Оцінювання

Остаточна оцінка за курс розраховується наступним чином:

Заліковий модуль 1	Заліковий модуль 2	Заліковий модуль 3
<i>30%</i>	<i>40%</i>	<i>30%</i>
Опитування під час занять (теми 1-6 по 10 балів) – <i>макс. 60 балів.</i>  Письмова робота (теми 1-6) – <i>макс. 40 балів.</i>	Опитування під час занять (теми 7-8 по 10 балів) – <i>макс. 20 балів.</i>  Письмова робота (теми 7-8) – <i>макс. 80 балів.</i>	Підготовка КПІЗ – <i>макс. 40 балів</i>  Захист КПІЗ – <i>макс. 40 балів</i>  Участь у тренінгах – <i>макс. 20 балів</i>

### Шкала оцінювання студентів

ECTS	Бали	Зміст
A	90-100	відмінно
B	85-89	добре
C	75-84	добре
D	65-74	задовільно
E	60-64	достатньо
FX	35-59	незадовільно з можливістю повторного складання
F	1-34	незадовільно з обов'язковим повторним курсом