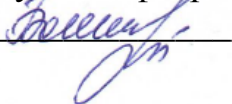


МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
Донецький національний університет економіки і торгівлі
імені Михайла Туган-Барановського

ЗАТВЕРДЖЕНО

На засіданні кафедри економіки та
міжнародних економічних відносин
Протокол №2 від 02.09.2019 р.

Завідувач кафедри


_____ Ю.Г. Бочарова

РОБОЧА ПРОГРАМА ДИСЦИПЛІНИ
«ОСНОВИ ФУНДАМЕНТАЛЬНОГО АНАЛІЗУ»

Ступінь: бакалавр

(заочна форма навчання)

Кількість кредитів ECTS 4

Розробник: Бочарова Ю.Г.
к.е.н., доцент

2019 – 2020 навчальний рік

1. Опис дисципліни

| Найменування показників | Характеристика дисципліни |
|----------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|
| Обов'язкова (для студентів спеціальності "назва спеціальності") / вибіркова дисципліна | Обов'язкова для студентів спеціальності 051 «Економіка» |
| Семестр (осінній / весняний) | осінній |
| Кількість кредитів | 4 |
| Загальна кількість годин | 120 |
| Кількість модулів | 1 |
| Лекції, годин | 6 |
| Практичні / семінарські, годин | 6 |
| Лабораторні, годин | - |
| Самостійна робота, годин | 108 |
| Вид контролю | екзамен |

2. Програма дисципліни

Ціль – надання теоретичних знань та формування практичних навичок зі встановлення та дослідження каузальних зв'язків між варіацією факторів, що впливають на валютний курс, та розвитком національної економіки в умовах глобалізації.

Завдання: ознайомлення із сутністю та принципами фундаментального аналізу; визначення сутності валютного курсу та його ролі в економіці; ознайомлення із сутністю та механізмом регулювання облікової ставки, інфляції та їх впливом на економіку; дослідження взаємозв'язку ВВП/ВНП та інших фундаментальних факторів та показників; ознайомлення із складовими, показниками, факторами та механізмом регулювання ринку праці та його впливом на економіку; ознайомлення механізмом регулювання неекономічних показників фундаментального аналізу та їх впливом на економіку.

Предмет: вивчення динаміки макроекономічних показників та наявних взаємозв'язків між ними.

Зміст дисципліни розкривається в темах:

1. Фундаментальний аналіз: сутність та принципи
2. Валютний курс та його роль в економіці
3. Офіційна облікова ставка та її значення у фундаментальному аналізі
4. Інфляція та її значення у фундаментальному аналізі
5. ВВП, ВНП та їх значення у фундаментальному аналізі
6. Показники ринку праці та їх значення у фундаментальному аналізі
7. Інші економічні фактори та показники та їх значення у фундаментальному аналізі
8. Некономічні фактори та показники фундаментального аналізу

3. Структура дисципліни

| Назви змістових модулів і тем | Кількість годин (денна форма навчання) | | | | |
|-----------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------|--------------|------------|----------|------------|
| | усього | у тому числі | | | |
| | | лекц. | пр./сем. | лаб. | СРС |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| Змістовий модуль 1. Теоретичні основи фундаментального аналізу. | | | | | |
| 1. Фундаментальний аналіз: сутність та принципи | 13 | 0,5 | 0,5 | | 12 |
| 2. Валютний курс та його роль в економіці | 17 | 1 | 1 | | 15 |
| Разом за змістовим модулем 1 | 30 | 1,5 | 1,5 | 0 | 27 |
| Змістовий модуль 2. Фундаментальні фактори та індикатори | | | | | |
| 3. Офіційна облікова ставка та її значення у фундаментальному аналізі | 17 | 1 | 1 | | 15 |
| 4. Інфляція та її значення у фундаментальному аналізі | 17 | 1 | 1 | | 15 |
| 5. ВВП, ВНП та їх значення у фундаментальному аналізі | 17 | 1 | 1 | | 15 |
| 6. Показники ринку праці та їх значення у фундаментальному аналізі | 13 | 0,5 | 0,5 | | 12 |
| 7. Інші економічні фактори та показники та їх значення у фундаментальному аналізі | 13 | 0,5 | 0,5 | | 12 |
| 8. Некономічні фактори та показники фундаментального аналізу | 13 | 0,5 | 0,5 | | 12 |
| Разом за змістовим модулем 2 | 90 | 4,5 | 4,5 | 0 | 81 |
| Усього годин | 120 | 6 | 6 | 0 | 108 |

4. Теми семінарських/практичних/лабораторних занять

| № з/п | Вид та тема семінарського заняття | Кількість годин |
|---------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|
| 1 | Семінар – розгорнута бесіда Фундаментальний аналіз: сутність та принципи | 0,5 |
| 2 | Семінар – розгорнута бесіда Валютний курс та його роль в економіці | 1 |
| 3 | Семінар – дискусія Офіційна облікова ставка та її значення у фундаментальному аналізі | 1 |
| 4 | Семінар з виконанням розрахункових задач Інфляція та її значення у фундаментальному аналізі | 1 |
| 5 | Семінар запитань і відповідей ВВП, ВНП та їх значення у фундаментальному аналізі | 1 |
| 6 | Семінар запитань і відповідей Показники ринку праці та їх значення у фундаментальному аналізі | 0,5 |
| 7 | Семінар з виконанням розрахункових задач Інші економічні фактори та показники та їх значення у фундаментальному аналізі | 0,5 |
| 8 | Семінар з виконанням розрахункових задач Неекономічні фактори та показники фундаментального аналізу | 0,5 |
| Всього | | 6 |

5. Індивідуальні завдання

1. Огляд періодичної і монографічної наукової літератури.
2. Підготовка рефератів, доповідей, статей за обраною темою.
3. Добір статистичної інформації, підготовка аналітичних довідок.
4. Підготовка тез доповідей з метою виступу на університетських, всеукраїнських та міжнародних семінарах та конференціях.

6. Обсяги, зміст та засоби діагностики самостійної роботи

| Вид та тема семінарських занять | Кількість годин самостійної роботи | Зміст самостійної роботи | Засоби діагностики |
|------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Змістовий модуль 1. Теоретичні основи фундаментального аналізу. | 27 | 1.Опрацювання конспекту лекцій та рекомендованої літератури для обговорення питань. 2. Смотестування 3. Розв'язати запропоновані керівником курсу ситуаційні завдання. 4. Виконання індивідуального завдання | Тестування, фронтальне та індивідуальне опитування, розв'язання ситуаційних завдань та задач; виконання індивідуального завдання |
| Змістовий модуль 2. Фундаментальні фактори та індикатори | 81 | Опрацювання конспекту лекцій та рекомендованої літератури для обговорення питань. 2. Смотестування 3. Розв'язати запропоновані керівником курсу ситуаційні завдання. 4. Виконання індивідуального завдання | Тестування, фронтальне та індивідуальне опитування, розв'язання ситуаційних завдань та задач; виконання індивідуального завдання |
| Разом | 108 | | |

7. Результати навчання

| | |
|----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. | Розуміння сутності фунда-ментального аналізу, його пред-мету та об'єкту |
| 2. | Знання принципів, методів та факторів фунда-ментального ана-лізу |
| 3. | Знання факторів, що впли-вають на валютний курс, облікову ставку, рівень інфляції, ВВП/ВНП, показники ринку праці та ін. |
| 4. | Розуміння теорії валютного курсу |
| 5. | Знання видів інфляції, методів розрахунку ВВП та ВНП |
| 6. | Знання поняття, складових та показників розвитку ринку праці |
| 7. | Знання переліку факторів динаміки некомічних показників фунда-ментального аналізу |
| 8. | Уміння визначати основні фактори, що обумовили стан та особливості розвитку національної та міжнародної економіки |
| 9. | Уміння встановлювати кау-зальні зв'язки між валютною політикою держави, особливостями варіації облікової ставки, рівня інфляції, показників ринку праці, інших фунда-ментальних факторів й показників та особ-ливостями зростання та розвитку національної та міжнародної економіки |

8. Методи викладання

Лекції, семінарські заняття, самостійна робота (підготовка презентацій, рефератів, самостійне опрацювання додаткових питань за наведеним переліком літератури).

9. Методи оцінювання

Екзамен.

10. Розподіл балів, які отримують студенти

| | | | | |
|-----------------------------------------|--------------------|------------------------|----------------------------|--------------|
| Поточне тестування та самостійна робота | | | Підсумковий тест (екзамен) | Сума в балах |
| Змістовий модуль 1 | Змістовий модуль 2 | Індивідуальне завдання | 50 | 100 |
| 15 | 20 | 15 | | |

Шкала оцінювання: національна та ECTS

| Оцінка | | |
|------------------|------------|-------------------|
| 100-бальна шкала | Шкала ECTS | Національна шкала |
| 90-100 | A | 5, «відмінно» |
| 80-89 | B | 4, «добре» |
| 75-79 | C | |
| 70-74 | D | 3, «задовільно» |
| 60-69 | E | |
| 35-59 | FX | 2, «незадовільно» |
| 0-34 | F | |

11. Методичне забезпечення

1. Електронний конспект лекцій.
2. Методичні вказівки з вивчення дисципліни.
3. Комплекти індивідуальних завдань.
4. Навчальна та наукова література, нормативні документи.

12. Рекомендована література

Базова

1. Фундаментальний аналіз [Текст] : конспект лекцій / Ю.Г. Бочарова ; ДонНУЕТ. – Кривий Ріг, 2016. – 102 с.
2. Колмыкова Л.И. Фундаментальный анализ финансовых рынков. – М., 2008. – 276 с.
3. Международные валютно-кредитные и финансовые отношения: Учебник / Под ред. Л.Н. Красавиной. – 2-е изд., перераб. и доп. – М.: Финансы и статистика, 2000. – 608 с.
4. Михайлушкин А. И., Шимко П. Д. Международная экономика. – М.: Высшая школа, 2002. – 336 с.
5. Якимкин В. Фундаментальный анализ / В. Якимкин. – М.: Изд-во Омега-Л, 2008 – 640 с.
6. Лиховидов В. Н. Фундаментальный анализ мировых валютных рынков: методы прогнозирования и принятия решений. – г. Владивосток – 1999 г. – 234 с.
7. Фундаментальный анализ финансовых рынков. – СПб.: Питер, 2005. – 288 с.
8. Яморони Р. Ключевые экономические индикаторы. Руководство трейдера. – М.: Интрент-трейдинг, 2004. – 328 с.
9. Макконелл К., Брю С. Экономикс: принципы, проблемы и политика: Пер. с 13-го англ. изд. – М.: ИНФРА-М, 1999. – 974 с.
10. Макроекономічний аналіз : навчальний посібник [Електронний ресурс] / М. С. Бріль, О. М. Кліменко, М. А. Машенко та ін. – Харків : ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2017. – 275 с.

Допоміжна

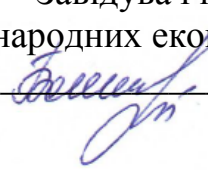
11. Бочарова Ю.Г. Вступ до фундаментального аналізу [Текст] : метод. рек. до вивч. дисц. / Ю.Г. Бочарова ; Донец. нац. ун-т економіки і торгівлі ім. М. Туган-Барановського, Каф. міжнар. економіки . – Донецьк : ДонНУЕТ, 2019. – 42 с.
12. Кондратьев Н.Д. Большие циклы конъюнктуры и теория предвидения. Избранные труды/Н. Д. Кондратьев; Международный фонд Н. Д. Кондратьева и др.; Ред. колл.: Абалкин Л. И. (пред.) и др.; сост. Яковец Ю. В. – М.: ЗАО "Издательство "Экономика", 2002. – 767 с.
13. Бжезинский З. Великая шахматная доска. – М.: Международные отношения, 2010. – 256 с.

14. Махлуп Ф. Теория валютного курса [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://mill-trader.com/wp-content/uploads/2013/06/frits-mahlup.doc>.
15. Бретт М. Как читать финансовую информацию. Простое объяснение того, как работают деньги / Пер. с 5-го англ. изд. - М.: Проспект, 2004. – 464 с.
16. Сорос Дж. Мыльный пузырь американского превосходства [Электронный ресурс]. – Режим доступа: ftp://cord.ws/media/books/ru/_/_%F0%E0%E7%ED%E5/_%EA%F0%E8%E7%E8%F1/%F1%EE%F0%EE%F1%20%E4%E6%EE%F0%E4%E6/%F1%EE%F0%EE%F1%20%20%EC%FB%EB%FC%ED%FB%E9%20%EF%F3%E7%FB%F0%FC%20%E0%EC%E5%F0%E8%EA%E0%ED%F1%EA%EE%E3%EE%20%EF%F0%E5%E2%EE%F1%F5%EE%E4%F1%F2%E2%E0.pdf.
17. Фридмен М. Количественная теория денег [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://mexalib.com/download/24211>.
18. Новиков В. Руководство по рыночной экономике [Электронный ресурс]. – Режим доступа: http://forex-mmcis.ru/books/Textbook_and_lectures/V.Novikov._A_management_on_market_economics.pdf

Інформаційні ресурси

19. Офіційний сайт інформаційної системи Global Financial Data [Електронний ресурс]. – Режим доступа: <https://www.globalfinancialdata.com>
20. Офіційний сайт міжнародного агентства новин і фінансової інформації Reuters [Електронний ресурс]. – Режим доступа: www.reuters.com/
21. Офіційний сайт міжнародного агентства фінансової інформації Bloomberg [Електронний ресурс]. – Режим доступа: <http://www.bloomberg.com/>
22. Офіційний сайт ООН (розділ «Статистика») [Електронний ресурс]. – Режим доступа: <http://unstats.un.org/unsd/databases.htm>.

ЗАТВЕРДЖЕНО
Завідувач кафедри економіки
та міжнародних економічних відносин
Ю.Г. Бочарова



КАЛЕНДАРНО-ТЕМАТИЧНИЙ ПЛАН З ДИСЦИПЛІНИ НА 2019-2020 Н.Р.

| № | Назва змістового модулю | Кількість годин за видами занять та період вивчення дисципліни | | | | | | Дата поточного контролю |
|---|--------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|-----------------|-----------|--------------|-------------------|--------------------|-------------------------|
| | | Лекції | | Практичні | | Самостійна робота | | |
| | | год. | дата | год. | дата | год. | дата | |
| 1 | Змістовий модуль 1. Теоретичні основи фундаментального аналізу. | 2 | жовтень 2019 р. | 1,5 | жовтень 2019 | 34 | листопад 2019 року | 20.11.2019 р. |
| 2 | Змістовий модуль 2. Фундаментальні фактори та індикатори | 6 | | 4,5 | | 102 | Грудень 2019 року | 20.12.2019 р. |
| 3 | Індивідуальне завдання | | | | | | 09.01.2020 р. | |