

КИЇВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ ІМЕНІ ТАРАСА ШЕВЧЕНКА

МЕХАНІКО-МАТЕМАТИЧНИЙ ФАКУЛЬТЕТ

Кафедра теорії ймовірностей, статистики та актуарної математики



«ЗАТВЕРДЖУЮ»

Заступник декана

з навчальної роботи

Харитонов О.М.

« » 2020 року

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Теорія фінансів для студентів

галузь знань	11 «Математика та статистика»
спеціальність	112 «Статистика»
освітній рівень	перший (бакалавр)
освітня програма	«Статистика»
вид дисципліни	обов'язкова

Форма навчання	денна
Навчальний рік	2020/2021
Семестр	3
Кількість кредитів ECTS	4
Мова викладання, навчання та оцінювання	українська
Форма заключного контролю	іспит

Викладачі: доцент Голомозий В. В., канд.ф.-м.н., доцент кафедри теорії ймовірностей та актуарної математики

Пролонговано: на 20 /20 н.р. () « » 20 р.
на 20 /20 н.р. () « » 20 р.

КИЇВ – 2020

Розробник: Голомозий В.В., к.ф.м.н., доцент кафедри теорії ймовірностей, статистики та актуарної математики.

ЗАТВЕДЖЕНО
Зав. кафедри
кафедри теорії ймовірностей,
статистики та актуарної математики
Мішура Мішура Ю.С.

Протокол № 1 від 28.08.2020 р.

Схвалено науково-методичною комісією механіко-математичного факультету

Протокол від "31" 08 2020 року № 1

Голова науково-методичної комісії Олійник професор, д.ф.-м.н. Олійник А.С.
(підпис)

1. Мета дисципліни – оволодіння сучасними методами, теоретичними положеннями та основними застосуваннями теорії фінансів, зокрема, основами макрофінансів, оподаткування, фінансів підприємства та фондових ринків.

2. Попередні вимоги до опанування або вибору навчальної дисципліни:

1. *Знати:* основи математичного аналізу, фінансового аналізу.
2. *Вміти:* знаходити суму членів геометричної прогресії, обчислювати параметри облігацій та кредитів.
3. *Володіти елементарними навичками:* робота з електронними таблицями.

3. Анотація навчальної дисципліни:

Навчальна дисципліна «Теорія фінансів» є складовою освітньої програми підготовки фахівців за освітнім рівнем «бакалавр» галузі знань 11 Математика та статистика зі спеціальності 112 Статистика освітньої програми «Статистика».

Дана дисципліна є обов'язковою. Дисципліна «Теорія фінансів» вивчає основні принципи функціонування фінансових систем, фондових ринків а також основи фінансової звітності підприємств.

Викладається у 3 семестрі в обсязі 120 год. (*4 кредити ECTS¹*) зокрема: *лекції – всього 28 год, практичні 28 год., самостійна робота – 64 год.* У курсі передбачено 2 змістових модулі, колоквиум та 1 модульну контрольну роботу. Завершується дисципліна **іспитом у третьому семестрі.**

4. Завдання (навчальні цілі): формування здатності розв'язувати складні спеціалізовані математичні та статистичні задачі, що характеризується комплексністю і невизначеністю умов і передбачає застосування теоретико-ймовірнісних і статистичних методів; набуття знань, умінь та навичок (компетентностей) на рівні новітніх досягнень у математиці та статистиці, відповідно до освітнього рівня «Бакалавр». Зокрема, професійне оволодіння компетентностями:

- 1) Здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу (ЗК-3).
- 2) Здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях (ЗК-4).
- 3) Знання й розуміння предметної області та професійної діяльності (ЗК-5).
- 4) Здатність спілкуватися українською мовою як усно, так і письмово (ЗК-6).
- 5) Здатність вчитися і оволодівати сучасними знаннями (ЗК-9).
- 6) Здатність до пошуку, обробки та аналізу інформації з різних джерел (ЗК-10).
- 7) Здатність приймати обґрунтовані рішення (ЗК-11).
- 8) Здатність працювати автономно (ЗК-14).
- 9) Визначеність і наполегливість щодо поставлених завдань і взятих обов'язків. (ЗК-15).
- 10) Здатність оцінювати та забезпечувати якість виконуваних робіт (ЗК-16).
- 11) Здатність діяти на основі етичних міркувань (мотивів). (ЗК-17).
- 12) Здатність застосовувати у професійній діяльності знання та навички в галузях теорії ймовірностей, математичної статистики, теорії випадкових процесів (СК-2).
- 13) Здатність здійснювати логічні математичні міркування із чітким зазначенням припущень та висновків (СК-3).

¹ кредитів ECTS – кредит кратний 30 годинам.

- 14) Здатність до математичного формулювання задач та вибору методів їх розв'язання (СК-4).
- 15) Здатність до кількісно-статистичного мислення (СК-5).
- 16) Здатність до ймовірнісного мислення, що передбачає сприйняття стохастичної природи явищ (СК-6).
- 17) Здатність робити якісні висновки з кількісних даних (СК-7).
- 18) Здатність розробляти експериментальні та спостережувальні дослідження та аналізувати дані цих досліджень (СК-9).
- 19) Здатність проводити дослідження ймовірнісно-статистичних моделей та інтерпретувати одержані результати (СК-10).
- 20) Здатність використання обчислювальної техніки, спеціалізованих мов програмування та програмних засобів для розв'язання задач і здобуття додаткової інформації (СК-11).
- 21) Здатність застосовувати ймовірнісно-статистичні методи в міждисциплінарному контексті (СК-12).
- 22) Здатність подавати статистичні процедури та результати їхнього застосування у формі, придатній для цільової аудиторії, до якої звертаються, як усно, так і письмово (СК-13).
- 23) Здатність до аналізу основ і властивостей статистичних алгоритмів та розуміння переваг тих чи інших підходів, у тому числі до оцінки їх обґрунтованості й ефективності (СК-14).
- 24) Здатність застосовувати в професійній діяльності знання теорії фінансів, фінансового аналізу та актуарної математики (СК-15).

5. Результати навчання за дисципліною:

Результат навчання (РН) (1. знати; 2. вміти; 3. комунікація; 4. автономність та відповідальність)		Форми (та/або методи і технології) викладання і навчання	Методи оцінювання та пороговий критерій оцінювання (за необхідності)	Відсоток у підсумковій оцінці з дисципліни
Код	Результат навчання (Формуються розробником)			
РН 1.1	Знати складові компоненти фінансової системи та інституції які на неї впливають.	<i>Лекція, практичне заняття</i>	<i>Іспит, активна робота на лекції, усні відповіді, колоквиум</i>	5%
РН 1.2	Знати системи оподаткування та види податків.			5%
РН 1.3	Знати види цінних паперів.			10%
РН 1.4	Знати основні принципи фінансової звітності.			10%
РН 1.5	Знати яка інформація входить до основних видів фінансових звітів.			10%
РН 2.1	Вміти пояснювати роль фінансової системи, та її складових, розрізняти банківські та резервні гроші, прогнозувати вплив рішень органів державної влади на фінансові системи.	<i>Практичне заняття, самостійна робота</i>	<i>Контрольна робота 1 (60% правильних відповідей), розв'язання задач на практичних заняттях</i>	15%

PH 2.2	Вміти обчислювати розмір податків та їх вплив на економіку та фінансовий сектор держави.		<i>іспит, виконання завдань, винесених на самостійну роботу</i>	15%
PH 2.3	Вміти аналізувати балансовий звіт, рахунок прибутків та витрат, звіт про рух грошей, звіт про зміни у власному капіталі. Вміти обчислювати важіль активів та прибутку, покриття прибутком та покриття активами.		<i>Контрольна робота 2 (60% правильних відповідей), розв'язання задач на практичних заняттях іспит, виконання завдань, винесених на самостійну роботу</i>	25%
PH 3.1	Здатність грамотно будувати комунікацію, виходячи з мети і ситуації спілкування	<i>Практичне заняття</i>	<i>активна робота практичних заняттях, усні відповіді</i>	2.5%
PH 3.2	Вироблення навиків командної роботи	<i>Практичне заняття</i>	<i>активна робота практичних заняттях, усні відповіді</i>	2.5%

6. Співвідношення результатів навчання дисципліни із програмними результатами навчання

Результати навчання дисципліни	PH 1.1	PH 1.2	PH 1.3	PH 1.4	PH 1.5	PH 2.1	PH 2.2	PH 2.3	PH 3.1	PH 3.2
	Програмні результати навчання									
PH-1 - Здійснювати професійну письмову й усну комунікацію українською мовою та, принаймні, однією з іноземних мов	+	+	+	+	+	+	+	+	+	+
PH-22 - Вміти використовувати знання з теорії фінансів – типи капіталу, фінансові інструменти – та принципи фінансової звітності в практичній діяльності	+	+	+	+	+	+	+	+	+	+

7. Схема формування оцінки.

7.1. Форми оцінювання студентів:

- оцінювання впродовж навчального періоду

1. *Активна робота на лекції, усні відповіді:* PH1.1, PH1.2, PH1.3, PH1.4, PH1.5, PH2.1, PH2.2, PH2.3, PH3.1, PH3.2 – 5 балів/3 бали;
2. *Виконання завдань, винесених на самостійну роботу:* PH2.1, PH2.2 – 5 балів/3 бали;
3. *Контрольна робота:* PH1.1, PH1.2, PH1.3, PH1.4, PH2.1, PH2.2 – 20 балів/12 балів;

5. Колоквіум: РН1.1, РН1.2, РН1.3, РН1.4 – 20 балів/12 балів

6. Розв'язання задач та виступи на практичних заняттях: РН2.1, РН2.2, РН2.3, РН3.1, РН3.2 – 10 балів/5 балів;

Разом 60/35

- підсумкове оцінювання: іспит.

- максимальна кількість балів, які можуть бути отримані: 40 балів;

- результати навчання, які будуть оцінюватись: РН1.1, РН1.2, РН1.3, РН1.4, РН1.5, РН2.1, РН2.2, РН2.3

- форма проведення і види завдань: письмова робота.

7.2. Організація оцінювання:

Критично-розрахунковий мінімум балів за навчання впродовж семестру становить **20** балів, рекомендований мінімум, розрахований з урахуванням специфіки дисципліни становить **35** балів. Студенти, які протягом семестру набрали сумарно меншу кількість балів ніж рекомендований мінімум **35** балів для підвищення балів отримують можливість написати додаткову контрольну роботу та доскласти домашні завдання. Мінімальна кількість балів, які додаються до семестрових – 24 бали, тобто, якщо оцінка студента на іспиті є нижчою від мінімального порогового рівня (24 бали), то бали за іспит не додаються до семестрової оцінки (вважаються рівними нулю), а підсумкова оцінка із дисципліни є незадовільною;

У випадку відсутності студента з поважних причин відпрацювання та перездачі форм контролю здійснюються у відповідності до „Положення про організацію освітнього процесу в Київському національному університеті імені Тараса Шевченка” (2018), <http://www.univ.kiev.ua/pdfs/official/Organization-of-the-educational-process.pdf>.

Форма іспиту – письмово-усна. Іспит складається з тесту та екзаменаційного білету. Тест складається з 20 запитань. Кожне запитання оцінюється в 1 бал. Екзаменаційний білет іспиту складається із 2 завдань, перше є теоретичними, друге – задача. Задача оцінюється в 10 балів, теоретичне питання в 5 балів. Додатково від 0 до 5 балів студент отримує за усне опитування. Всього за іспит можна отримати від 0 до 40 балів.

Терміни проведення форм оцінювання:

1. Контрольна робота: на 10-му тижні навчального періоду.

2. Колоквіум: на 12-му тижні навчального періоду.

7.3. Шкала відповідності оцінок

Відмінно / Excellent	90-100
Добре / Good	75-89
Задовільно / Satisfactory	60-74
Незадовільно / Fail	0-59

8. СТРУКТУРА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ. ТЕМАТИЧНИЙ ПЛАН ЛЕКЦІЙ І ПРАКТИЧНИХ ЗАНЯТЬ

теми	Назва теми	Кількість годин				
		Лекції	Практичні заняття	Самост. робота	Контр. модульна робота	Інші форми контролю
Змістовий модуль 1 „Макрофінанси та податки.”						
1	Банківська система держави. Національний Банк.	6	6	10		
2	Фіскальна політика держави, державні фінанси.	8	8	10		
3	Оподаткування. Види та функції податків.	4	8	10		
Змістовий модуль 2 „Фондові ринки та фінансова звітність.”						
1	Фондові ринки, основні та похідні цінні папери.	4	4	10		
2	Корпоративні фінанси, товариство з обмеженою відповідальністю.	4	2	10	2	
3	Основні фінансові звіти та коефіцієнти.	4	2	10		2
Всього годин за III семестр		28	28	64	2	2

**Загальний обсяг 120 годин, у тому числі:
лекції – 28 годин,
практичні заняття – 28 годин,
самостійна робота – 64 годин.**

9. Рекомендовані джерела

Основні: Мішура Ю.С., Шевченко Г.М. Математика фінансів. – ВПЦ «Київський університет», 2009. – 352 с.

1. Борисенко О.Д., Мішура Ю.С., Радченко В.М., Шевченко Г.М., Збірник задач з фінансової математики. – ВПЦ «Київський університет», 2007.- 255 с.

Додаткові:

1. Леоненко М.М., Мішура Ю.С., Пархоменко В.М., Ядренко М.Й., Теоретико-ймовірнісні та статистичні методи в економетриці та фінансовій математиці. – К.: Інформтехніка, 1995.