



## СИЛАБУС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ «ФІНАНСОВИЙ ІНЖИНІРИНГ»

Компонента освітньої програми – вибіркова (3 кредити)

Освітньо-професійна програма	Фінанси, банківська справа та страхування
Спеціальність	072 Фінанси, банківська справа та страхування
Галузь знань	07 Управління та адміністрування
Рівень вищої освіти	перший (бакалаврський)
Мова навчання	українська
Профайл викладача (-ів)	Грубляк Оксана Михайлівна – кандидат економічних наук, доцент кафедри фінансів і кредиту <a href="https://finance.chnu.edu.ua/nasha-kafedra/kolektyv/hrubliak-oksana-mykhailivna/">https://finance.chnu.edu.ua/nasha-kafedra/kolektyv/hrubliak-oksana-mykhailivna/</a>
Контактний тел.	+380505066560
E-mail:	<a href="mailto:o.grublyak@chnu.edu.ua">o.grublyak@chnu.edu.ua</a>
Сторінка курсу в Moodle	<a href="https://moodle.chnu.edu.ua/course/view.php?id=7320">https://moodle.chnu.edu.ua/course/view.php?id=7320</a>
Консультації	вівторок з 12.00 до 13.00

### АНОТАЦІЯ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Навчальна дисципліна є важливою складовою частиною комплексу дисциплін бакалаврського рівня. Фінансовий інжиніринг – наука про фінансові нововведення, які дають можливість учасникам фінансового ринку ефективніше реагувати на зміни, що відбуваються в економіці, пристосовуючи для цих цілей вже існуючі або розробляючи нові фінансові інструменти чи операційні схеми. Навчальна дисципліна сформувалася на стику фінансової науки, інформатики та математики. Знання, отримані в результаті вивчення дисципліни «Фінансовий інжиніринг», допоможуть здобувачам вирішувати широке коло задач – від елементарного нарахування відсотків до аналізу складних інвестиційних, комерційних і кредитних проблем. Все це вимагає належного рівня теоретичного обґрунтування та практичного вивчення дисципліни. Дисципліна «Фінансовий інжиніринг» належить до блоку вибіркових освітніх компонент, запропонованих здобувачам освітньої програми «Фінанси, банківська справа та страхування» першого (бакалаврського) рівня галузі знань 07 «Управління та адміністрування».

*Мета навчальної дисципліни:* сформувати у здобувачів теоретичні та практичні знання у галузі конструювання складних фінансових продуктів для управління ризиками, ліквідністю і прибутковістю, створення нових фінансових інструментів і отримання практичних навичок з їх використання при ухваленні фінансових рішень.

Дисципліни, обов'язкові для вивчення здобувачем вищої освіти до початку роботи над курсом «Фінансовий інжиніринг», - це «Фінанси», «Банківська система», «Фінансовий ринок», «Банківські операції та технології».

### НАВЧАЛЬНИЙ КОНТЕНТ ОСВІТНЬОЇ КОМПОНЕНТИ

МОДУЛЬ 1. Теоретичні основи та практика фінансового інжинірингу	
Тема 1	Суть фінансового інжинірингу та фінансових інновацій
Тема 2	Фінансові технології на фінансовому ринку
Тема 2	Форвард як інструмент фінансового інжинірингу
Тема 4	Ф'ючерсний контракт як інструмент фінансового інжинірингу
Тема 5	Опціон як інструмент фінансового інжинірингу
МОДУЛЬ 2. Інноваційні технології фінансового інжинірингу	
Тема 6	Своп як інструмент фінансового інжинірингу
Тема 7	Фінансові інструменти власного капіталу

<b>Тема 8</b>	Фінансові інструменти з фіксованим доходом
<b>Тема 9</b>	Гібридні та екзотичні фінансові інструменти
<b>Тема 10</b>	Ринок віртуальних активів

## ОСВІТНІ ТЕХНОЛОГІЇ, ФОРМИ ТА МЕТОДИ НАВЧАННЯ

У процесі вивчення навчальної дисципліни використовуються традиційні та інноваційні освітні технології (інформаційно-комунікаційні, технології студентоцентрованого навчання; проектна діяльність), традиційні та інтерактивні форми і методи навчання (зокрема, лекція-візуалізація, практичне заняття, самостійно-дослідницька робота тощо).

## ФОРМИ Й МЕТОДИ КОНТРОЛЮ ТА ОЦІНЮВАННЯ

**Поточний контроль:** усне та письмове опитування, тестування, практичні завдання, творча робота, презентація тощо.

**Підсумковий контроль** – залік.

## КРИТЕРІЇ ОЦІНЮВАННЯ РЕЗУЛЬТАТІВ НАВЧАННЯ

Оцінювання програмних результатів навчання здобувачів освіти здійснюється за шкалою європейської кредитно-трансферної системи (ECTS).

Критерієм успішного оцінювання є досягнення здобувачем вищої освіти мінімальних порогових рівнів (балів) за кожним запланованим результатом навчання.

## ПОЛІТИКА ЩОДО АКАДЕМІЧНОЇ ДОБРОЧЕСНОСТІ

Дотримання політики щодо академічної доброчесності учасниками освітнього процесу при вивченні навчальної дисципліни регламентовано такими документами: «Етичний кодекс Чернівецького національного університету імені Юрія Федьковича» [https://www.chnu.edu.ua/media/jxdfs0zb/etychnyi-kodeks\\_chernivets\\_koho-natsionalnoho-universytetu.pdf](https://www.chnu.edu.ua/media/jxdfs0zb/etychnyi-kodeks_chernivets_koho-natsionalnoho-universytetu.pdf); «Положенням про виявлення та запобігання академічного плагіату у Чернівецькому національному університету імені Юрія Федьковича» [https://www.chnu.edu.ua/media/vupnho4k/polozhennya-pro-zapobihannia-plahiatu\\_2024.pdf](https://www.chnu.edu.ua/media/vupnho4k/polozhennya-pro-zapobihannia-plahiatu_2024.pdf).

Здобувачі повинні самостійно виконувати навчальні завдання, завдання поточного та підсумкового контролю результатів навчання. В разі використання чужих ідей, розробок, тверджень, обов'язковим є посилання на джерела інформації. Списування під час контрольних заходів має наслідком отримання незадовільної оцінки за відповідний вид роботи.

## ІНФОРМАЦІЙНІ РЕСУРСИ

1. Офіційний сайт Чиказької торговельної палати. URL: <https://www.cme.com>.
2. Офіційний сайт Банку міжнародних розрахунків. URL: <https://www.bis.org>.
3. Офіційний сайт Національного банку України. URL: <https://www.bank.gov.ua>.
4. Офіційний сайт Євронекст. URL: <https://www.euronext.com>.
5. Офіційний сайт Нью-Йоркської фондової біржі. URL: <https://www.nyse.com>.
6. Офіційний сайт Української біржі. URL: <https://www.ux.ua>
7. Офіційний сайт Інформаційної агенції Рейтерс. URL: <https://www.reuters.com>.
8. Офіційний сайт International Swap and Derivatives Association. URL: <https://www.isda.org/>.
9. Global Financial Development Database. URL: <https://databank.worldbank.org/source/>.
10. Цифровий портал даних IMF. URL: [https://www.imf.org/en/Data?utm\\_source](https://www.imf.org/en/Data?utm_source).
11. Bank for International Settlements. URL: [https://data.bis.org/?utm\\_source](https://data.bis.org/?utm_source).
12. World Bank Open Data. URL: <https://data.worldbank.org/>.
13. Yahoo Finance – світові фондові індекси. URL: <https://finance.yahoo.com/markets/world-indices>.

14. Investing.com – Major World Indices. URL: <https://www.investing.com/indices/major-indices>.
15. Reuters – Global Market Data. URL: <https://www.reuters.com/markets/global-market-data>.
16. SIFMA Capital Markets Fact Book. URL: <https://www.sifma.org/resources>.
17. World Federation of Exchanges. URL: <https://www.world-exchanges.org/>.
18. LSEG. URL: <https://www.lseg.com/content/dam/data-analytics>.
19. Financial Times. URL: <https://www.ft.com/>.
20. Cbonds.com. URL: <https://cbonds.com/>.

*Детальна інформація щодо вивчення курсу «Фінансовий інжиніринг»  
висвітлена у [робочій програмі](#) навчальної дисципліни*