



**РОБОЧА ПРОГРАМА ВИБІРКОВОЇ
НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ (СИЛАБУС)
«ТЕХНІЧНИЙ АНАЛІЗ ФІНАНСОВОГО РИНКУ»**

Відомості про викладача

ПІБ	Гончаренко Яніна Володимирівна професор, кандидат фізико-математичних наук, доцент
Профіль викладача	https://moodle.udu.edu.ua/course/view.php?id=1682
Електронна адреса	ya.v.honcharenko@udu.edu.ua

I. Основна мета навчальної дисципліни:

ознайомлення студентів із сучасними науковими концепціям, поняттями, специфічними методами технічного аналізу фінансового ринку та технологій графічного аналізу, застосуванням математичних методів аналізу та прогнозування цін фінансових інструментів, принципами обчислення індикаторів, що описують стан фінансового ринку; методами та засобами прогнозування фінансових процесів в умовах суперечливих цілей, невизначеностей та ризиків різних типів; методів підтримки прийняття рішень за використання методів технічного аналізу.

II. Місце навчальної дисципліни в програмі підготовки фахівців

Галузь знань	II Математика та статистика
Освітній рівень	Магістр
Спеціальність	III Математика
Освітня програма	Математика (фінансова та актуарна математика)
Рік впровадження	2022
Шифр навчальної дисципліни	BB2.05
Семестр навчання	3

III. Обсяг навчального навантаження і терміни навчання

Рік і семестр навчання	2 рік, 3 семестр
Кількість кредитів	3 кредити
Загальна кількість годин	90
Лекційні заняття	10
Семінарські заняття	11
Самостійна робота	69

IV. Короткий зміст навчальної дисципліни

Тема 1. Теоретико-методичні засади функціонування фінансового ринку.
Тема 2. Фондовий ринок як складова фінансового ринку.
Тема 3. Біржова діяльність. Статистичний аналіз біржової діяльності.
Тема 4. Біржове ціноутворення. Фондові індекси.
Тема 5. Постулати технічного аналізу. Графічні методи технічного аналізу.
Тема 6. Застосування «барів» та «японських свічок» у технічному аналізі.
Тема 7. Фігури технічного апарату. Сигнали.
Тема 8. Тренди. Лінії тренду та трендові канали.
Тема 9. Індикатори.
Тема 10. Теорія циклів. Цикли в технічному аналізі.
Тема 11. Хвилі Еліота.

V. Результати навчання:

1. Володіти математичними методами аналізу, прогнозування та оцінки параметрів моделей, математичними способами інтерпретації числових даних та принципами функціонування природничих процесів.
2. Уміти використовувати фундаментальні математичні закономірності у професійній діяльності.
3. Інтегрувати знання з різних галузей для вирішення теоретичних та/або практичних задач і проблем.
4. Застосовувати нові підходи для вироблення стратегії прийняття рішень у складних непередбачуваних умовах.
5. Використовувати раціональні способи пошуку та використання науково-технічної інформації, включаючи засоби електронних інформаційних мереж; застосовувати інформаційні ресурси, у тому числі електронні, для пошуку відповідних математичних моделей.

VI. Основні інформаційні джерела

1. Фундаментальний та технічний аналіз міжнародних ринків / О. М. Сохацька [та ін.] – Тернопіль: ЗУНУ, 2022. – 309 с. – Режим доступу: <http://dspace.wunu.edu.ua/handle/316497/46103>
2. Підприємництво, торгівля та біржова діяльність : підручник / [за заг. ред.: І. М. Сотник, Л. М. Таранюка]. – Суми : ВТД «Університетська книга», 2018. – 572 – Режим доступу: <http://sites.znu.edu.ua/science-earth/assets/documents/principles/PidruchnykPidpryyemnytstvo-torhivl-ya-birzhova-diyalnist.pdf>
3. Могилевська, О. Ю. Біржова діяльність : навч. посібник / О. Ю. Могилевська, Н. П. Резнік, А. Д. Остапчук. – Київ : КиМУ, 2018. – 136 с.
4. Приходько Д. О. Основи біржової діяльності: підручник / Д. О. Приходько. – Харків : ФОП Бровін О. В., 2021. – 280 с. – Режим доступу: https://fmab.khadi.kharkov.ua/fileadmin/FFUB/Економіка_і_підприємництва/ek_predpriyatiy/Publications/Prykhodko_D.-Основи_біржової_діяльності-ПІДРУЧНИК.pdf
5. Сохацька О. Фундаментальний та технічний аналіз цін товарних та фінансових ринків./ О. Сохацька, І. Роговська-Іщук, С. Вінницький — Київ: Кондор, 2012. — 305 с. – Режим доступу: <http://dspace.wunu.edu.ua/handle/316497/608>
6. Коваленко Ю. М. Управління фінансовими активами : підручник : у 2-х ч. Ч. 1 / Ю. М. Коваленко. – Ірпінь: Університет ДФС України, 2019. – 498 с. – Режим доступу: <https://drive.google.com/file/d/1BbY6ljm2YQlWOXpeTSGLbiJ4tyssSDH/view>
7. Національний банк України [Електронний ресурс]: – Режим доступу: <https://bank.gov.ua>.
8. Урядовий портал [Електронний ресурс]: – Режим доступу: <https://www.kmu.gov.ua>
9. Українська біржа [Електронний ресурс]: – Режим доступу: <http://www.ux.ua/s223>
10. Міністерство фінансів України [Електронний ресурс]: – Режим доступу: <https://www.mof.gov.ua/uk>
11. Національна комісія з цінних паперів та фондового ринку [Електронний ресурс]: – Режим доступу: <https://www.nssmc.gov.ua>
12. Українська універсальна біржа [Електронний ресурс]: – Режим доступу: <https://www.uub.com.ua>
13. ПрАТ “Українська міжбанківська валютна біржа” [Електронний ресурс]: – Режим доступу: <https://www.uicegroup.com>

VII. Система оцінювання

Виконання практичних занять	5*4=20
Виконання індивідуальних завдань (СРС)	20
Контрольна робота	20
Виконання і захист проєктів	4*10=40
Підсумковий контроль	залік

Критерії оцінювання

Під час усних відповідей та виконання письмових завдань враховуються: повнота розкриття питання, логіка викладення та аргументованість.

Рівень відповідності критеріям

Творчий рівень (90 – 100 балів). Здобувач виконав програму навчальної дисципліни повністю, вільно володіє навчальним матеріалом, успішно і креативно розв'язує завдання різних видів складності, аргументовано висловлює свої думки, займається самоосвітою, може брати активну участь в наукових проєктах і конкурсах.

Високий рівень (80 – 89 балів). Здобувач виконав програму навчальної дисципліни в повному обсязі, володіє навчальним матеріалом у межах програми навчальної дисципліни, виконав завдання до кожної теми, проте у відповідях допускає деякі неточності.

Достатній рівень (70 – 79 балів). Здобувач виконав програму в повному обсязі, але нерівномірно володіє навчальним матеріалом, здатний його аналізувати, проте не може сформулювати висновки досить ґрунтовно.

Задовільний рівень (65 – 69 балів). Здобувач загалом виконав програму, але більшість тем засвоїв поверхово.

Низький рівень (60 – 64 балів). Здобувач засвоїв теми з навчальної дисципліни, але дуже поверхово, володіє навчальним матеріалом на елементарному рівні і фрагментарно, не може самостійно викласти зміст більшості питань курсу.

Незадовільний рівень:

35 – 59 балів з можливістю повторного складання. Здобувач частково виконав програму, не засвоїв більшості тем програми курсу, володіє елементарними знаннями з навчальної дисципліни, не вміє логічно, послідовно, грамотно висловлювати думку;

0 – 34 балів з обов'язковим повторним вивченням навчальної дисципліни. Здобувач не виконав більшості завдань програми, не володіє навчальним матеріалом

Обговорено та затверджено на засіданні кафедри _____
протокол №__ від _____