

СИЛАБУС ОСВІТНЬОЇ КОМПОНЕНТИ



ФУНДАМЕНТАЛЬНИЙ ТА ТЕХНІЧНИЙ АНАЛІЗ У ТРЕЙДИНГУ

спеціальність	072 “Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок”	обов’язковість дисципліни	вибіркова
освітня програма	Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок	факультет	Управління торговельно-підприємницькою та митною діяльністю
освітній рівень	не обмежено	кафедра	фінансів, банківської справи та страхування

ВИКЛАДАЧ

Литвинов Анатолій Іванович



Вища освіта – спеціальність економіка і управління в галузях АПК
Науковий ступень - доктор економічних наук 08.00.03 Економіка та управління національним господарством
Вчене звання — професор кафедри фінансів, банківської справи та страхування
Досвід роботи – більше 30 років

Показники професійної активності з тематики курсу:

- багаторічний досвід практичної роботи в банківській системі;
- сертифікати від QuantINSTI, CognitiveClass & IBM, Prometheus;
- співавтор низки тематичних публікацій у фахових виданнях, автор подкасту «Цікаві фінанси»;
- учасник наукових і методичних конференцій.

телефон	+380669569983	електронна пошта	alitvinov@ukr.net	дистанційна підтримка	Google Meet, Moodle
---------	---------------	------------------	-------------------	-----------------------	---------------------

До викладання дисципліни долучені:

ЗАГАЛЬНА ІНФОРМАЦІЯ ПРО ОСВІТНЮ КОМПОНЕНТУ (ДИСЦИПЛІНУ)

Мета	сформувати у студентів передбачені відповідними освітніми програмами та індивідуальними освітніми траєкторіями компетенції. Зокрема, щодо використання методів фундаментального та технічного аналізу при проведенні досліджень ринкових інструментів
Формат	лекції, практичні заняття, самостійна робота, індивідуальні завдання, командна робота
Деталізація результатів навчання і форм їх контролю	<ul style="list-style-type: none"> • Розуміння що таке трейдинг, які його основні напрямки та інструменти (ІК, СК11, ПР01, ПР14) / індивідуальні завдання, практичні завдання, опитування та співбесіди • Спроможність розрізняти та класифікувати підходи до аналізу (ЗК01, СК01, ПР13) / індивідуальні завдання, практичні завдання, опитування та співбесіди • Спроможність користуватись інструментами фундаментального аналізу для вирішення наукових та практичних завдань (ІК,ЗК01, ЗК02, ЗК08, СК01, СК03, СК06, ПР05, ПР10, ПР16)/ індивідуальні завдання, практичні завдання, опитування та співбесіди • Розуміння сутності та принципів аналітичної роботи на різних ринках (ЗК01, ЗК06, СК01, ПР10) / індивідуальні завдання, практичні завдання, опитування та співбесіди • Розуміння сутності графічних методів аналізу (ЗК01, СК01, СК03, ПР06, ПР13) / індивідуальні завдання, практичні завдання, опитування та співбесіди • Розуміння сутності математичних методів аналізу (ЗК01, СК01, СК03, СК04, ПР06, ПР13) / індивідуальні завдання, практичні завдання, опитування та співбесіди • Спроможність користуватись інструментами технічного аналізу для вирішення наукових та практичних завдань (ІК, ЗК01, ЗК02, ЗК08, СК01, СК06, ПР05, ПР08, ПР16) / індивідуальні завдання, практичні завдання, опитування та співбесіди
Обсяг і форми контролю	3 кредити ECTS (годин): 18 годин лекції, 12 годин практичні; модульний контроль (2 модулі); підсумковий контроль – залік.
Вимоги викладача	уважність, вчасне виконання завдань, активність, індивідуальна та командна робота
Умови зарахування на освітню компоненту	вільне зарахування

ДОПОВНЮЄ СТАНДАРТ ОСВІТИ І ОСВІТНЮ ПРОГРАМУ

Компетентності	ІК (інтегральна компетентність) - здатність розв'язувати складні спеціалізовані завдання та практичні проблеми в ході професійної діяльності у галузі фінансів, банківської справи та страхування або у процесі навчання, що передбачає застосування окремих методів і положень	Програмні результати навчання	<p>ПР01 Знати та розуміти економічні категорії, закони, причинно-наслідкові та функціональні зв'язки, які існують між процесами та явищами на різних рівнях економічних систем</p> <p>ПР05 Володіти методичним інструментарієм діагностики стану фінансових систем (державні</p>
----------------	---	-------------------------------	--

фінансової науки та характеризується невизначеністю умов і необхідністю врахування комплексу вимог здійснення професійної та навчальної діяльності.

- ЗК01 здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу
- ЗК02 Здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях
- ЗК06 здатність проведення досліджень на відповідному рівні
- ЗК08 здатність до пошуку, оброблення та аналізу інформації із різних джерел
- СК01 Здатність досліджувати тенденції розвитку економіки за допомогою інструментарію макро- та мікроекономічного аналізу, оцінювати сучасні економічні явища
- СК03 Здатність до діагностики стану фінансових систем
- СК04 Здатність застосовувати економіко-математичні методи та моделі для вирішення фінансових задач
- СК06 Здатність застосовувати сучасне інформаційне та програмне забезпечення для отримання та обробки даних у сфері фінансів, банківської справи та страхування
- СК11 Здатність підтримувати належний рівень знань та постійно підвищувати свою професійну підготовку

фінанси, у т.ч. бюджетна та податкова системи, фінанси суб'єктів господарювання, фінанси домогосподарств, фінансові ринки, банківська система та страхування).

- ПР06 Застосовувати відповідні економіко-математичні методи та моделі для вирішення фінансових задач
- ПР08 Застосовувати спеціалізовані інформаційні системи, сучасні фінансові технології та програмні продукти
- ПР10 Ідентифікувати джерела та розуміти методологію визначення і методи отримання економічних даних, збирати та аналізувати необхідну фінансову інформацію, розраховувати показники, що характеризують стан фінансових систем
- ПР13 Володіти загальнонауковими та спеціальними методами дослідження фінансових процесів
- ПР14 Вміти абстрактно мислити, застосовувати аналіз та синтез для виявлення ключових характеристик фінансових систем, а також особливостей поведінки їх суб'єктів
- ПР16 Застосовувати набуті теоретичні знання для розв'язання практичних завдань та змістовно інтерпретувати отримані результати

СТРУКТУРА ОСВІТНЬОЇ КОМПОНЕНТИ (ДИСЦИПЛІНИ)

Модуль 1. Фундаментальний аналіз в трейдингу

Лекція 1	Застосування аналітичних підходів у трейдингу	Практичне заняття 1 (ПЗ 1)	Аналіз ринку ЦП: джерела інформації та аналіз галузевих показників; джерела інформації та аналіз емітентів; ринкові індекси	Самостійна	Інформація Yahoo!finance; інформація TradingView; інформація Smida; відкриті набори даних на data.gov.ua
Лекція 2	Фундаментальний аналіз ринку ЦП				

Лекція 3	Фундаментальний аналіз ринку FOREX	ПЗ 2	Аналіз товарних ринків та FOREX: джерела інформації та фактори курсоутворення на ринку FOREX; джерела інформації та аналіз інструментів товарних ринків	робота	Джерела ринкових новин: Bloomberg, CNBC, Reuters; вплив новин на рух цін	
Лекція 4	Фундаментальний аналіз товарних ринків					
Лекція 5	Макроекономічні показники у фундаментальному аналізі	ПЗ 3	Макроекономічні показники: джерела інформації та аналіз макроекономічних показників США; джерела інформації та аналіз макроекономічних показників ЄС; джерела інформації та аналіз макроекономічних показників України			Джерела інформації про макроекономічні показники: інформація Федеральної резервної системи США, інформація Європейського центрального банку; інформація Національного банку України
Модуль 2. Технічний аналіз у трейдингу						
Лекція 6	Загальна характеристика технічного аналізу	ПЗ 4	Графічні методи в технічному аналізі: побудова лінійного графіку ринкового інструменту; побудова біржового графіка (bar chart) ринкового інструменту; відображення трендів; відображення рівнів підтримки та опору	Самостійна робота	Побудова лінійного графіку, біржового графіку (bar chart), графіку «японські свічки», відображення трендів, ліній підтримки та іншої допоміжної інформації на графіках	
Лекція 7	Графічні методи в технічному аналізі					
Лекція 8	Фігури в технічному аналізі	ПЗ 8	Фігури в технічному аналізі: аналіз динаміки ціни за допомогою фігур; аналіз динаміки ціни за допомогою японських свічок			Ідентифікація основних фігур на графіках, характерні види японських свічок
Лекція 9	Математичні методи в технічному аналізі	ПЗ 9	Математичні методи в технічному аналізі: аналіз динаміки цін за допомогою трендових індикаторів; аналіз динаміки ціни за допомогою осциляторів			Ковзні середні та їх комбінації, осцилятор ціни (price), осцилятор руху (momentum), пояси Болінгера

ОСНОВНА ЛІТЕРАТУРА ТА МЕТОДИЧНІ МАТЕРІАЛИ

Література

1. Schwager, J. D., & Etkorn, M. (2016). A complete guide to the futures market: Technical analysis, trading systems, fundamental analysis, options, spreads, and trading principles (2nd ed.). John Wiley & Sons.
2. Lim, M. A. (2015). The handbook of technical analysis + test bank: The practitioner's comprehensive guide to technical analysis. John Wiley & Sons.
3. Edwards, R. D., Magee, J., & Bassetti, W. H. C. (2018). Technical Analysis of Stock Trends (11th ed.). CRC Press.
4. Berlinger, E., Illes, F., Badics, M., Banai, A., Daroczi, G., Domotor, B., Gabler, G., Havran, D., Juhasz, P., & Margitai, I. (2023). Mastering R for Quantitative Finance. Packt Publishing.
5. Lofgren, K.-G., Persson, T., & Weibull, J. W. (2002). Markets with asymmetric information: The contributions of George Akerlof, Michael Spence and Joseph Stiglitz. The Scandinavian Journal of Economics, 104(2), 195–211. <https://doi.org/10.1111/1467-9442.00280>
6. Donadio, S., & Ghosh, S. (2019). Learn Algorithmic Trading: Build and deploy algorithmic trading systems and strategies using Python and advanced data analysis. Packt Publishing.
7. Hilpisch, Y. (2015). Derivatives analytics with python: Data analysis, models, simulation, calibration and hedging (Y. Hilpisch, Ed.). John Wiley & Sons.
8. Tsay, R. S. (2001). Analysis of financial time series (2nd ed.). John Wiley & Sons.
9. Kahn, M. (2010). Technical analysis plain and simple: Charting the markets in your language (3rd ed.). Financial Times Prentice Hall.
10. Талєб, Н. (2022) Обдурені випадковістю. Незрима роль шансу в житті та бізнесі. Київ, Наш формат.

Методичне забезпечення

1. Матеріали в системі Moodle: <http://moodle.btu.kharkiv.ua>

СИСТЕМА ОЦІНЮВАННЯ

	СИСТЕМА	БАЛИ	ДІЯЛЬНІСТЬ, ЩО ОЦІНЮЄТЬСЯ
Підсумкове оцінювання	100 бальна ECTS (стандартна)	до 50	50% від усередненої оцінки за модулі
		до 50	підсумкове тестування
Модульне оцінювання	100 бальна сумарна	до 50	відповіді на тестові питання
		до 20	усні відповіді на лабораторно-практичних заняттях
		до 30	результат засвоєння блоку самостійної роботи

НОРМИ АКАДЕМІЧНОЇ ЕТИКИ ТА ДОБРОЧЕСНОСТІ

Всі учасники освітнього процесу (в тому числі здобувачі освіти) повинні дотримуватися кодексу академічної доброчесності та вимог, які прописані у положенні «Про академічну доброчесність учасників освітнього процесу ДБТУ»: виявляти дисциплінованість, вихованість, поважати гідність один одного, проявляти доброзичливість, чесність, відповідальність.