

РОЗШИРЕНИЙ ПЛАН ЛЕКЦІЙ

з дисципліни «Методи аналізу фондового ринку»

лекційних годин – 30

викладач – Андрієнко В.М.

СЕМЕСТРОВИЙ МОДУЛЬ 1

Змістовий модуль 1. Організація і функціонування фондового ринку

Лекція 1. Характеристика ринку.

1.1. Суть и функції ринку.

1.2. Історичні передумови формування моделей ринків.

Лекція 2. Організація і функціонування фондового ринку.

2.1. Організаційна структура та учасники ринків. Система регулювання.

2.1. Інвестиційна діяльність на фондових ринках.

Лекція 3. Етапи розвитку фондового ринку України.

Лекція 4. Загальна характеристика основних цінних паперів.

4.1. Основні типи цінних паперів.

4.2. Класифікація операцій з цінними паперами.

Лекція 5. Методи управління ризиками/

5.1. Поняття ризику. Класифікація ризиків.

5.2. Методи зменшення ризиків.

Лекція 6. Методи кількісної оцінки ризиків.

6.1. Волатильність.

6.2. Модель CAPM

6.3. Value at Risk (VaR)

6.4. Модель Марковітца

СЕМЕСТРОВИЙ МОДУЛЬ 2

Змістовий модуль 3. Методи аналізу фондового ринку

Лекція 7. Індекси фондового ринку.

7.1. Загальні поняття і методи розрахунку

7.2. Основні індекси світових ринків

Лекція 8. Фундаментальний аналіз.

8.1. Макроекономічний аналіз.

8.2. Галузевий або індустріальний аналіз.

8.3. Регіональний аналіз.

8.4. Аналіз інвестиційної привабливості підприємств.

Лекція 9. Технічний аналіз.

9.1. Основні принципи технічного аналізу.

9.2. Фігури продовження і перелому тенденції

9.3. Японські свічки.

9.4. Внутрішні лінії тренда.

Лекція 10. Кількісні методи аналізу.

10.1. Кореляційний аналіз .

10.2. Спектральний аналіз (Метод Фур'є, вейвлет-аналіз).

Лекція 11. Методи статистичного аналізу.

11.1. Геометричний броунівський аналіз

11.2. Авторегресійні моделі

11.3. Загальний алгоритм статистичного аналізу

Лекція 12. Фрактальний аналіз.

12.1. Визначення фракталу.

12.2. Показник Херста. R/S аналіз.

12.3. Функція Вейерштрасса – Мандельброта

Лекція 13. Хаос –динамічний аналіз.

13.1. Визначення атрактора.

13.2. Властивості детерміновано - хаотичних систем

13.3. Технологія нейронних мереж в аналізі хаотичних систем.

Змістовий модуль 4. Аналіз і оптимізація інвестиційних портфельів на фондовому ринку

Лекція 14. Інвестиційні портфелі.

14.1. Загальні принципи формування інвестиційного портфеля.

14.2. Співвідношення «прибутковість-ризик».

Лекція 15. Оптимізація інвестиційного портфелі.

15.1. Ефективна межа і вибір оптимального портфеля.

15.2 Математичні моделі оптимізації інвестиційного портфеля (моделі Марковітца, Шарпа і Тобіна).