

УКРАЇНСЬКИЙ ДЕРЖАВНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ЗАЛІЗНИЧНОГО ТРАНСПОРТУ

Затверджено
на засіданні кафедри
фінансів, обліку і аудиту
прот. № 1 від 29.08.2024 р.



ТЕХНІЧНИЙ АНАЛІЗ У ТРЕЙДИНГУ

Силабус

2024/2025

Галузь знань	07 Управління та адміністрування
Спеціальність	072 Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок
Освітня програма	Управління фінансами, банківська справа та страхування
Освітній рівень	перший (бакалавр)
Цикл підготовки	вибірковий
Кількість кредитів ЄКТС	6
Семестр	7
Сторінка курсу в MOODLE	
Лектор курсу	– Єрмоленко Олексій Анатолійович (к.е.н., доцент)
Профайл викладача	– https://kart.edu.ua/staff/iermolenko-oa
Контакти викладача (e-mail):	yermolenko@kart.edu.ua
Час та аудиторія проведення занять:	згідно розкладу – http://rasp.kart.edu.ua/
Додаткові інформаційні матеріали:	http://lib.kart.edu.ua

Курс "Технічний аналіз у трейдингу" призначений для студентів та практиків, зацікавлених у вивченні методів аналізу ринкових даних з метою прийняття ефективних рішень у трейдингу. Програма охоплює основні принципи технічного аналізу, зокрема аналіз цінних графіків, виявлення трендів, рівнів підтримки та опору, а також вивчення індикаторів і осциляторів для визначення точок входу та виходу. Студенти дізнаються, як працювати з японськими свічками, трендовими лініями, патернами та індикаторами, що допоможе їм розуміти поведінку ринку і передбачати його рух. Курс приділяє увагу психології ринку і фактору ризику, що є ключовим для професійного трейдингу. Завдяки практичним завданням і кейсам, студенти навчаються застосовувати технічний аналіз на практиці та отримують навички, які дозволять їм розробляти власні торгові стратегії, адаптовані до різних ринкових умов.

Курс цей курс має на меті сформувати та розвинути наступні компетентності студентів:

Загальні компетентності

- ЗК01. Здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу.
- ЗК02. Здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях.
- ЗК03. Здатність планувати та управляти часом.
- ЗК05. Навички використання інформаційних та комунікаційних технологій.
- ЗК06. Здатність проведення досліджень на відповідному рівні
- ЗК07. Здатність вчитися і оволодівати сучасними знаннями.
- ЗК08. Здатність до пошуку, оброблення та аналізу інформації з різних джерел.

Спеціальні (фахові, предметні) компетентності

- СК01. Здатність досліджувати тенденції розвитку економіки за допомогою інструментарію макро- та мікроекономічного аналізу, оцінювати сучасні економічні явища.
- СК02. Розуміння особливостей функціонування сучасних світових та національних фінансових систем та їх структури.
- СК03. Здатність до діагностики стану фінансових систем (державні фінанси, у тому числі бюджетна та податкова системи, фінанси суб'єктів господарювання, фінанси домогосподарств, фінансові ринки, банківська система, страхування та фондовий ринок).
- СК04. Здатність застосовувати економіко-математичні методи та моделі для вирішення фінансових задач.
- СК07. Здатність складати та аналізувати фінансову звітність.
- СК09. Здатність здійснювати ефективні комунікації.
- СК10. Здатність визначати, обґрунтовувати та брати відповідальність за професійні рішення.

Програмні результати навчання

- ПР01. Знати та розуміти економічні категорії, закони, причинно-наслідкові та функціональні зв'язки, які існують між процесами та явищами на різних рівнях економічних систем.
- ПР03. Визначати особливості функціонування сучасних світових та національних фінансових систем та їх структури.
- ПР05. Володіти методичним інструментарієм діагностики стану фінансових систем (державні фінанси, у т.ч. бюджетна та податкова системи, фінанси суб'єктів господарювання, фінанси домогосподарств, фондові ринки, банківська система та страхування).
- ПР06. Застосовувати відповідні економіко-математичні методи та моделі для вирішення фінансових задач.
- ПР09. Формувати і аналізувати фінансову звітність та правильно інтерпретувати отриману інформацію.
- 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.
- ПР19. Виявляти навички самостійної роботи, гнучкого мислення, відкритості до нових знань.

Вивчення даної дисципліни формує у здобувачів освіти соціальні навички (soft skills):

комунікативність (реалізується через: метод роботи в парах та групах, метод самопрезентації), робота в команді (реалізується через метод проєктів), лідерські навички (реалізується через: робота в групах, метод самопрезентації).

Чому ви маєте обрати цей курс?

Якщо ви хочете овоїти потужні інструменти для прийняття обґрунтованих торгових рішень тоді вам просто обов'язково йти на цей курс!. Технічний аналіз дозволяє аналізувати ринкові дані, визначати тренди та прогнозувати рух цін, що є ключовим для успішного трейдингу. Ви навчитеся розпізнавати важливі графічні патерни, використовувати індикатори та осцилятори для підвищення точності своїх прогнозів. Курс також охоплює аспекти управління ризиками та психології ринку, що допоможе вам уникати поширених помилок. З набутими знаннями ви зможете розробляти ефективні торгові стратегії, що відповідають різним ринковим умовам, і підвищите свої шанси на успіх у світі трейдингу.

Методи навчання

Цей курс "Технічний аналіз у трейдингу" дає студентам глибоке розуміння принципів та інструментів технічного аналізу, необхідних для ефективної роботи на фінансових ринках. Студенти освоюють методи вивчення цінових графіків, виявлення трендів та патернів, а також навчаються використовувати різні технічні індикатори для прогнозування руху ринку. Курс розглядає важливі аспекти управління ризиками та психології трейдингу, що дозволяє приймати зважені рішення у складних ринкових умовах. Отримані знання допоможуть студентам розробляти та адаптувати торгові стратегії, аналізувати ринок і визначати оптимальні точки входу та виходу для максимізації прибутковості та мінімізації ризику

Курс супроводжується текстовим матеріалом, презентаціями та груповими завданнями. Студенти матимуть можливість застосовувати отримані знання для поглиблення аналітичної роботи на всіх рівнях управління та обґрунтування управлінських рішень.

Практичні заняття курсу "Технічний аналіз у трейдингу" передбачають вивчення прийомів та методів аналізу ринкових даних, які допомагають трейдерам здійснювати обґрунтовані торгові рішення. Студенти навчатимуться працювати з різними типами графіків (лінійними, свічковими та баровими), використовувати індикатори та осцилятори, такі як MACD, RSI, Moving Averages, для визначення трендів і точок входу/виходу. Практика включає побудову трендових ліній, рівнів підтримки та опору, а також вивчення графічних патернів, таких як "голова і плечі", "трикутники" та "двійне дно". Студенти також освоюють управління ризиками та стратегії мінімізації втрат. Всі ці навички дозволяють ефективно застосовувати технічний аналіз для розробки персональних торгових стратегій.

Виконання завдань супроводжується зануренням у суміжні дисципліни, що доповнюють теми, та формує у студента інформаційну та комунікативну компетентності

Теми курсу

1 Основи технічного аналізу

- Поняття технічного аналізу та його роль у трейдингу
- Основні принципи та концепції технічного аналізу
- Відмінності технічного аналізу від фундаментального

2 Цінові графіки та їх типи

- Як існують типи цінових графіків і як їх використовувати
- Як читати японські свічки і розуміти їх патерни
- Важливість розуміння барових та лінійних графіків

3 Тренди і їх визначення

- Як визначити тренд на ринку та його напрям
- Поняття ліній підтримки і опору в контексті трендів
- Як використовувати тренди для прогнозування майбутніх рухів ринку

4 Індикатори технічного аналізу

- Що таке індикатори і які вони бувають
- Як використовувати популярні індикатори (MACD, RSI, Moving Averages)
- Як інтерпретувати сигнали індикаторів для прийняття рішень

5 Графічні патерни і їх застосування

- Які графічні патерни існують і що вони означають
- Як використовувати патерни для передбачення руху ринку
- Різниця між короткостроковими та довгостроковими патернами

6 Аналіз обсягів торгівлі

- Як аналізувати обсяги торгівлі та їх значення
- Які закономірності можна побачити за допомогою обсягів
- Як поєднувати аналіз обсягів з іншими методами технічного аналізу

7 Технічні стратегії і торгові системи

- Як створювати торгові стратегії на основі технічного аналізу
- Як комбінувати різні індикатори та патерни для розробки системи
- Роль ризик-менеджменту в торгових стратегіях

8 Психологія трейдингу

- Як психологічні фактори впливають на прийняття торгових рішень
- Важливість дисципліни і контролю емоцій при торгівлі
- Як впоратися з втратами і уникати емоційних рішень

9 Управління ризиками в трейдингу

- Як визначати оптимальний розмір позиції
- Важливість стоп-лоссів та тейк-профітів для захисту капіталу
- Як контролювати збитки та максимізувати прибуток

Ресурси курсу

Інформація про курс розміщена на сайті Університету <https://kart.edu.ua> включаючи навчальний план, лекційні матеріали, завдання та правила оцінювання курсу.

Додатковий матеріал та посилання на електронні ресурси доступні на сайті Університету у розділі «дистанційне навчання» поряд із питаннями, над якими необхідно поміркувати підчас підготовки для обговорення в аудиторії.

1 <http://www.investing.com> — Платформа для аналізу фінансових ринків з графіками, новинами та економічним календарем. Має інструменти для технічного аналізу акцій, валют і товарів.

2 <http://www.tradingview.com> — Популярна платформа для створення графіків та аналізу ринкових даних. Має інструменти для технічного аналізу і можливість публікації торгових ідей.

3 <http://www.stockcharts.com> — Сайт з професійними інструментами для технічного аналізу та створення графіків для різних фінансових інструментів.

4 <http://www.babypips.com> — Освітній портал для новачків у трейдингу, з уроками з технічного аналізу, графіків, стратегій і психології торгівлі.

5 <http://www.mql5.com> — Офіційний сайт для платформи MetaTrader 5. Тут можна знайти індикатори, стратегії, а також отримати доступ до форуму для трейдерів.

6 <http://www.dailyfx.com> — Платформа з новинами, аналітикою та інструментами для технічного та фундаментального аналізу фінансових ринків.

7 <http://www.fxstreet.com> — Інформаційний портал для трейдерів, що спеціалізується на ринку Forex, з індикаторами, новинами та технічними аналізами.

8 <http://www.cnbc.com> — Провідний новинний ресурс з аналізом фінансових ринків, включаючи розділи про технічний аналіз та стратегії трейдингу.

9 <http://www.forexfactory.com> — Один з найбільших порталів для трейдерів, який включає економічний календар, новини та форуми для обговорення технічних стратегій.

10 <http://www.tradeciety.com> — Блог, який пропонує освітні ресурси, статті та курси для трейдерів, що спеціалізуються на технічному аналізі.

11 <http://www.tdameritrade.com> — Платформа для онлайн-трейдингу, що пропонує інструменти для технічного аналізу та інструкції для трейдерів.

12 <http://www.ig.com> — Інтернет-брокер з навчальними матеріалами для трейдерів, що охоплюють основи технічного аналізу та ринкових стратегій.

13 <http://www.chartpattern.com> — Ресурс, присвячений вивченню графічних патернів, що допомагають трейдерам визначати рухи ринку.

14 <http://www.traderhq.com> — Сайт з навчальними матеріалами, аналізами та стратегіями для трейдерів, що орієнтуються на технічний аналіз.

15 <http://www.earnforex.com> — Портал для трейдерів, що включає інструменти для технічного аналізу, індикатори та стратегії на ринку Forex.

Сфера реалізації набутих знань і вмінь в майбутній професії

Знання та вміння, набуті при вивченні дисципліни «Технічний аналіз у трейдингу», студенти зможуть застосувати, працюючи у фінансових установах, таких як брокерські компанії, інвестиційні фірми, банки, а також в аналітичних центрах і консалтингових компаніях. Вони зможуть ефективно аналізувати ринки, застосовувати технічний аналіз для прийняття рішень щодо купівлі та продажу фінансових активів, таких як акції, валюти та товари. Окрім того, знання з технічного аналізу дозволять працювати як трейдерам на біржах, так і аналітикам, що спеціалізуються на розробці торгових стратегій та управлінні ризиками.

Форми і методи оцінювання

При оцінюванні результатів навчання керуватися Положенням про контроль та оцінювання якості знань студентів в УкрДУЗТ

<https://kart.edu.ua/wp-content/uploads/2020/05/pologennya-pro-kontrol-ta-ocinuvannya-2015.pdf>

Методи контролю: усне опитування, поточний контроль, модульний контроль (тести), підсумкове тестування, залік.

Згідно з Положенням про впровадження кредитно-модульної системи організації навчального процесу використовується 100-бальна шкала оцінювання.

Принцип формування оцінки за модуль у складі залікових кредитів I і II за 100- бальною шкалою показано у таблиці, де наведена максимальна кількість балів, яку може набрати студент за різними видами навчального навантаження.

Для контролю знань за практичною складовою дисципліни у вигляді письмової контрольної роботи. Письмові контрольні роботи – це ефективний метод перевірки й оцінки знань, вмінь і навичок студентів, а також їх творчих здібностей, що дає можливість у найбільш короткий термін одночасно перевірити засвоєння навчального матеріалу всіма студентами групи та визначити напрями для індивідуальної роботи з кожним. Однорідність робіт, що виконуються студентами, дозволяє пред'являти до всіх однакові вимоги й об'єктивно оцінювати результати навчання.

Максимальна кількість балів за модуль		
Поточний контроль	Модульний контроль (тести)	Сума балів за модуль
до 60	до 40	до 100
Поточний контроль		1 (2) семестр
Виконання практичних завдань (усне і письмове опитуване)		20
Виконання та захист самостійних робіт відповідно до варіанту		20
Тестові завдання за темами курсу		20
підсумок		60

Студент, який з поважних причин, підтверджених документально, не мав можливості брати участь у формах поточного контролю (не склав змістовий модуль), має право на його

відпрацювання у двотижневий термін після повернення до навчання за розпорядженням декана відповідно до встановленого терміну.

При заповненні екзаменаційної відомості та залікової книжки (індивідуального навчального плану) студента, оцінка, виставлена за 100-бальною шкалою, повинна бути переведена до національної шкали (5, 4, 3,) та шкали ECTS (A, B, C, D, E)

Визначення назви за державною шкалою(оцінка)	Визначення назви за шкалою ECTS	За 100 бальною шкалою	ECTS оцінка
ВІДМІННО – 5	Відмінно – відмінне виконання лише з незначною кількістю помилок	90-100	A
ДОБРЕ – 4	Дуже добре – вище середнього рівня з кількома помилками	82-89	B
	Добре – в загальному правильна робота з певною кількістю грубих помилок	75-81	C
ЗАДОВІЛЬНО - 3	Задовільно - непогано, але зі значною кількістю недоліків	69-74	D
	Достатньо – виконання задовольняє мінімальні критерії	60-68	E
НЕЗАДОВІЛЬНО - 2	Незадовільно – потрібно попрацювати перед тим як отримати залік (без повторного вивчення модуля)	35-59	FX
	Незадовільно - необхідна серйозна подальша робота (повторне вивчення модуля)	<35	F

Кодекс академічної доброчесності

Політика забезпечення дотримання учасниками освітнього процесу академічної доброчесності визначається Кодексом академічної доброчесності Українського державного університету залізничного транспорту <https://kart.edu.ua/wp-content/uploads/2020/06/kodex.pdf>

Основні заходи запобігання та виявлення академічного плагіату визначаються Положенням про організацію освітнього процесу Українського державного університету залізничного транспорту <https://kart.edu.ua/wp-content/uploads/2021/02/polozhennja-pro-oop-ukrdzt-2021.pdf>

Інтеграція студентів із обмеженими можливостями

Вища освіта є провідним чинником підвищення соціального статусу, досягнення духовної, матеріальної незалежності і соціалізації молоді з обмеженими функціональними можливостями й відображає стан розвитку демократичних процесів і гуманізації суспільства.

Для інтеграції студентів із обмеженими можливостями в освітній процес Українського державного університету залізничного транспорту створена система дистанційного навчання на основі сучасних педагогічних, інформаційних, телекомунікаційних технологій.

Доступ до матеріалів дистанційного навчання з цього курсу можна знайти за посиланням: <http://do.kart.edu.ua/>