

КОНТЕНТ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ «МОДЕЛЮВАННЯ ФІНАНСОВИХ РИНКІВ»

Тема 1. Методологічні засади моделювання фінансового ринку

- 1.1. Поняття економіко-математичного моделювання. Його принципи.
- 1.2. Сучасні підходи до моделювання фінансового ринку.
- 1.3. Класифікація моделей дослідження фінансового ринку.

Тема 2. Моделі поведінки інвестора на фінансовому ринку

- 2.1. Оптимізаційні моделі. Модель Марковіца. Модель Шарпа. Модель Тобіна.
- 2.2. Формування оптимальних портфельів цінних паперів.

Тема 3. Моделі технічного аналізу на фінансовому ринку

- 3.1. Поняття технічного аналізу на фінансовому ринку.
- 3.2. Гіпотеза щодо ефективного ринку.
- 3.3. Визначення елементів технічного аналізу фінансового ринку.

Тема 4. Сучасні моделі дослідження тенденцій на фінансовому ринку

- 4.1. Моделі аналізу часових рядів. Перевірка наявності взаємозалежностей на фінансовому ринку.
- 4.2. Дослідження коінтеграційних ефектів на фінансовому ринку. .
- 4.3. Визначення впливів елементів фінансового ринку між собою.

Тема 5. Моделювання сценаріїв розвитку елементів фінансового ринку

- 5.1. Побудова сценаріїв розвитку фінансового ринку.
- 5.2. Визначення циклічних складових розвитку та випадкових флуктуацій.