

**МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ  
ОДЕСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ ЕКОНОМІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ**

Кредитно-економічний факультет

Кафедра банківської справи

Допустити до захисту

Завідувач кафедри \_\_\_\_\_  
(підпис)

д.е.н., професор Кузнєцова Л.В.

“ \_\_\_ ” \_\_\_\_\_ 2015 року

**Дипломна робота**

на здобуття  
освітньо-кваліфікаційного рівня магістра

з теми: «Перспективи використання технічного аналізу в управлінні  
портфельними інвестиціями банку»

Виконав: студент 5 курсу, групи 3

спеціальності 8.03050802

«Банківська справа»

Мустафаєв Шахін Ібрагімович

Керівник: к.е.н., доцент Онищенко Юлія

Ігорівна

Рецензент:

ОДЕСА – 2015 рік

## АНОТАЦІЯ

Об'єктом дипломної роботи виступають процеси формування інвестиційного портфелю з використанням технічного аналізу.

Предметом даного дослідження є теоретичні та методичні засади формування інвестиційного портфелю з використанням технічного аналізу.

Метою дипломної роботи є визначення перспектив використання технічного аналізу в управлінні портфельними інвестиціями банку.

Завданнями роботи є: дослідити специфічні риси та сутність портфельного інвестування банку; визначення відмінностей в управлінні інвестиційним портфелем банків України та за кордоном; визначення сутності технічного аналізу при портфельному інвестуванні банку; формування цілей та розробка стратегії інвестування; проведення технічного аналізу; формування портфелю цінних паперів банку; дослідити проблеми розвитку вітчизняного фондового ринку; визначення перспектив використання технічного аналізу українськими банками.

Одержані результати можуть бути використані для покращення процесу формування та управління портфельними інвестиціями банку, підвищення рівня конкурентоспроможності банку.

Роки виконання дипломної роботи 2014-2015.

Рік захисту роботи 2015.

Ключові слова: фондовий ринок, технічний аналіз, цінні папери, капіталізація, інвестиції, акція, оптимізаційний портфель.

Дипломна робота містить 98 сторінок, 16 таблиць, 14 рисунків, список літератури з 62 найменувань, 1 додаток.

## ЗМІСТ

ВСТУП.....	3
РОЗДІЛ 1. СУТНІСТЬ УПРАВЛІННЯ ПОРТФЕЛЬНИМИ ІНВЕСТИЦІЯМИ З ВИКОРИСТАННЯМ ТЕХНІЧНОГО АНАЛІЗУ.....	6
1.1. Специфічні риси та сутність портфельного інвестування.....	6
1.2.Управління портфелем цінних паперів в Україні та за кордоном.....	21
1.3. Сутність технічного аналізу ринку цінних паперів при портфельному інвестуванні.....	34
Висновки до першого розділу.....	47
РОЗДІЛ 2. ФОРМУВАННЯ ПОРТФЕЛЮ ЦІННИХ ПАПЕРІВ З ВИКОРИСТАННЯМ ТЕХНІЧНОГО АНАЛІЗУ.....	49
2.1. Формування цілей та розробка стратегії інвестування банком.....	49
2.2. Технічний аналіз ринку цінних паперів.....	54
2.3. Формування портфелю цінних паперів.....	62
Висновки до другого розділу.....	71
РОЗДІЛ 3. ПРОБЛЕМИ ТА ПЕРСПЕКТИВИ РОЗВИТКУ ВІТЧИЗНЯНОГО ФОНДОВОГО РИНКУ.....	72
3.1. Проблеми розвитку вітчизняного фондового ринку.....	72
3.2.Перспективи використання технічного аналізу українськими банками....	80
Висновки до третього розділу.....	87
ВИСНОВКИ.....	89
СПИСОК ВИКОРИСТАНИХ ДЖЕРЕЛ.....	93
ДОДАТКИ.....	98