

Аннотация к рабочей программе дисциплины

Автор: Левин В.С., профессор

Наименование дисциплины: Б1.В.04 Моделирование рынка ценных бумаг

Цель освоения дисциплины:

- формирование у студентов глубоких теоретических знаний для проведения аналитических и прогностических работ с применением экономико-математических, эконометрических и статистических методов и моделей;
- формирование прочных теоретических и практических навыков по работе с рынком ценных бумаг и его прогнозированием;
- формирование практических навыков по построению моделей на рынке ценных бумаг.

1. Требования к результатам освоения дисциплины:

| Индекс и содержание компетенции | Знания | Умения | Навыки и (или) опыт деятельности |
|--|---|--|--|
| ПК-4: способностью на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты | 1 этап: основные тенденции развития и структуру современного рынка ценных бумаг; 2 этап: знать теорию и методологию экономико-математического, эконометрического и статистического моделирования | 1 этап: проводить поиск информации, ее анализ и обобщение; 2 этап: строить стандартные теоретические и эконометрические модели на рынке ценных бумаг, проводить анализ и интерпретацию полученных результатов | 1 этап: современными концепциями и классификацией моделей, описывающих взаимосвязи на финансовых рынках; 2 этап: применять понятийно – категориальный аппарат |
| ПК-6: способностью анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения | 1 этап: особенности построения моделей, используемых на рынке ценных бумаг, условия их применения, допущения и ограничения каждой модели; 2 этап: основные положения технического и фундаментального | 1 этап: проводить анализ и интерпретацию показателей, характеризующих развитие рынков ценных бумаг на микро- и макро- уровне как в России, так и за рубежом; 2 этап: уметь самостоятельно разрабатывать и применять существующие в мировой практике | 1 этап: владеть методикой применения современных информационных технологий и пакетов прикладных программ в области прогнозирования и моделирования рынка ценных бумаг; 2 этап: готовить доклады и рефераты по различным |

| | | | |
|-------------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|-------------------------------|
| социально-экономических показателей | анализа на рынке ценных бумаг | фондового рынка методы и модели | моделям на рынке ценных бумаг |
|-------------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|-------------------------------|

2. Содержание дисциплины:

Раздел 1 Основы моделирования на рынке ценных бумаг

Тема 1 Модели рынка ценных бумаг

Тема 2 Моделирование тенденций и прогнозирование курсов ценных бумаг с применением метода скользящей средней

Тема 3 Корреляционные и регрессионные модели на рынке ценных бумаг

Тема 4 Моделирование тенденций и прогнозирование курсов ценных бумаг с применением метода экспоненциального сглаживания

Тема 5 Рыночная модель

Тема 6 Моделирование тенденций и прогнозирование курсов ценных бумаг с помощью функций регрессии Excel в рамках «рыночной модели»

Раздел 2 Основные модели, применяемые на рынке ценных бумаг

Тема 7 Модель оценки финансовых активов

Тема 8 Проблемы построения «рыночной модели» на основе метода парной регрессии

Тема 9 Факторные модели

Тема 10 Расчёт качественных характеристик «рыночных моделей»

Тема 11 Модель арбитражного ценообразования

Тема 12 Моделирование тенденций и прогнозирование курсов ценных бумаг на основе анализа трендов и сезонности

Раздел 3 Оценка обыкновенных акций и облигаций

Тема 13 Оценка обыкновенных акций

Тема 14 Моделирование тенденций и прогнозирование курсов ценных бумаг на основе выбора кривой роста

Тема 15 Построение факторных моделей на рынке ценных бумаг с применением множественной регрессии

Тема 16 Оценка облигаций

Тема 17 Моделирование тенденций и прогнозирование курсов ценных бумаг с учетом автокорреляции, циклических и случайных колебаний

Раздел 4 Оценка опционов, фьючерсов и основы биржевой торговли

Тема 18 Оценка опционов

Тема 19 Построение оптимального портфеля ценных бумаг

Тема 20 Оценка фьючерсов

Тема 21 Определение курсовой стоимости и доходности облигаций

Тема 22 Биржевые площадки, основы фундаментального и технического анализа

Тема 23 Оценка и прогнозирование опционов

3. Общая трудоемкость дисциплины: 5 ЗЕ