

# **АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ**

Автор: В.С. Левин, профессор

Профессиональная переподготовка: Финансы и кредит

Наименование дисциплины: Моделирование рынка ценных бумаг

## **1. Цель освоения дисциплины**

- формирование у слушателей 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.

## **2. Требования к результатам освоения дисциплины**

Знать

- основные тенденции развития и структуру современного рынка ценных бумаг;
- знать теорию и методологию экономико-математического, эконометрического и статистического моделирования;
- особенности построения моделей, используемых на рынке ценных бумаг, условия их применения, допущения и ограничения каждой модели;
- основные положения технического и фундаментального анализа на рынке ценных бумаг.

Уметь

- проводить поиск информации, ее анализ и обобщение;
- строить стандартные теоретические и эконометрические модели на рынке ценных бумаг, проводить анализ и интерпретацию полученных результатов;
- проводить анализ и интерпретацию показателей, характеризующих развитие рынков ценных бумаг на микро- и макро- уровне как в России, так и за рубежом;
- самостоятельно разрабатывать и применять существующие в мировой практике фондового рынка методы и модели.

## **3. Содержание дисциплины**

Раздел 1 Основы моделирования на рынке ценных бумаг.

1. Модели рынка ценных бумаг.
2. Корреляционные и регрессионные модели на рынке ценных бумаг.
3. Модель оценки финансовых активов.

Раздел 2 Основные модели, применяемые на рынке ценных бумаг.

4. Рыночная модель.
5. Факторные модели.
6. Модель арбитражного ценообразования.

Раздел 3 Оценка обыкновенных акций и облигаций.

7. Оценка обыкновенных акций (1 часть).
8. Оценка обыкновенных акций (2 часть).
9. Оценка облигаций.

Раздел 4 Оценка опционов, фьючерсов и основы биржевой торговли

10. Оценка опционов.
11. Оценка фьючерсов.
12. Биржевые площадки, основы фундаментального и технического анализа.

**4. Объем дисциплины:** 46 часов, в том числе 26 аудиторных.

