

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
"Дальневосточный государственный университет путей сообщения"
(ДВГУПС)

УТВЕРЖДАЮ

Зав.кафедрой

(к307) Финансы и бухгалтерский учёт

Немчанинова М.А.,
канд. экон. наук,



10.05.2024

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины **Оценка и моделирование РЦБ**

38.05.01 Экономическая безопасность

Составитель(и): к.э.н., доцент, Фещенко И.В.

Обсуждена на заседании кафедры: (к307) Финансы и бухгалтерский учёт

Протокол от 25.04.2024г. № 9

Обсуждена на заседании методической комиссии по родственным направлениям и специальностям: Протокол

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Председатель МК РНС

__ ____ 2025 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2025-2026 учебном году на заседании кафедры (к307) Финансы и бухгалтерский учёт

Протокол от __ ____ 2025 г. № __
Зав. кафедрой Немчанинова М.А., канд. экон. наук, доцент

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Председатель МК РНС

__ ____ 2026 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2026-2027 учебном году на заседании кафедры (к307) Финансы и бухгалтерский учёт

Протокол от __ ____ 2026 г. № __
Зав. кафедрой Немчанинова М.А., канд. экон. наук, доцент

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Председатель МК РНС

__ ____ 2027 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2027-2028 учебном году на заседании кафедры (к307) Финансы и бухгалтерский учёт

Протокол от __ ____ 2027 г. № __
Зав. кафедрой Немчанинова М.А., канд. экон. наук, доцент

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Председатель МК РНС

__ ____ 2028 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2028-2029 учебном году на заседании кафедры (к307) Финансы и бухгалтерский учёт

Протокол от __ ____ 2028 г. № __
Зав. кафедрой Немчанинова М.А., канд. экон. наук, доцент

Рабочая программа дисциплины Оценка и моделирование РЦБ

разработана в соответствии с ФГОС, утвержденным приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от 14.04.2021 № 293

Квалификация **Экономист**

Форма обучения **очная**

ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) В ЗАЧЕТНЫХ ЕДИНИЦАХ С УКАЗАНИЕМ КОЛИЧЕСТВА АКАДЕМИЧЕСКИХ ЧАСОВ, ВЫДЕЛЕННЫХ НА КОНТАКТНУЮ РАБОТУ ОБУЧАЮЩИХСЯ С ПРЕПОДАВАТЕЛЕМ (ПО ВИДАМ УЧЕБНЫХ ЗАНЯТИЙ) И НА САМОСТОЯТЕЛЬНУЮ РАБОТУ ОБУЧАЮЩИХСЯ

Общая трудоемкость **5 ЗЕТ**

Часов по учебному плану	180	Виды контроля в семестрах:
в том числе:		экзамены (семестр) 7
контактная работа	72	курсовые работы 7
самостоятельная работа	72	
часов на контроль	36	

Распределение часов дисциплины по семестрам (курсам)

Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	7 (4.1)		Итого	
	Неделя 17 2/6			
Вид занятий	уп	рп	уп	рп
Лекции	32	32	32	32
Лабораторные	32	32	32	32
Контроль самостоятельной работы	8	8	8	8
Итого ауд.	64	64	64	64
Контактная работа	72	72	72	72
Сам. работа	72	72	72	72
Часы на контроль	36	36	36	36
Итого	180	180	180	180

1. АННОТАЦИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

1.1	Ценные бумаги как объект оценки. Понятие стоимости ценных бумаг и факторы ее определяющие. Взаимосвязь внутренней стоимости и рыночной цены ценной бумаги. Нормативно-правовая база оценки ценных бумаг в России. Методы фундаментального анализа. Место и значение технического анализа фондового рынка и рынков отдельных финансовых инструментов при оценке их стоимости. Анализ и оценка долговых ценных бумаг. Особенности оценки рыночной стоимости государственных долговых обязательств. Использование метода дисконтированных денежных потоков при оценке рыночной стоимости различных видов облигаций. Оценка иных финансовых инструментов (банковский сектор). Оценка долевых ценных бумаг. Анализ и методы оценки долевых ценных бумаг. Особенности оценки различных видов акции. Особенности оценки производных ценных бумаг. Понятие моделирования рынка ценных бумаг. Планирование принятия решений при создании моделей рынка ценных бумаг. Виды моделирования. Фундаментальный, технический анализ при создании моделей. Методы моделирования и прогнозирования, используемые на рынке ценных бумаг
-----	--

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Код дисциплины:	Б1.О.30
2.1	Требования к предварительной подготовке обучающегося:
2.1.1	Основы бизнеса
2.1.2	Основы финансовой математики
2.1.3	Рынок ценных бумаг: основы рынка ценных бумаг и государство на рынке ценных бумаг
2.1.4	Финансы
2.1.5	Финансовый анализ
2.1.6	Финансовый менеджмент
2.1.7	Оценка стоимости и реструктуризация предприятия
2.2	Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:
2.2.1	Инвестиции и инвестиционная деятельность
2.2.2	Антикризисный менеджмент
2.2.3	Риски: неопределенность в бизнесе и оценка рисков
2.2.4	Преддипломная практика
2.2.5	Научно-исследовательская работа

3. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ), СООТНЕСЕННЫХ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

ОПК-4: Способен разрабатывать и принимать экономически и финансово обоснованные организационно-управленческие решения, планировать и организовывать профессиональную деятельность, осуществлять контроль и учет ее результатов.
Знать:
Основы планово-расчетной работы; понятие проектного решения; методы анализа и обоснования эффективности организационно-управленческих решений; механизмы управленческого контроля и мониторинга результатов деятельности хозяйствующего субъекта
Уметь:
Осуществлять планово-отчетную работу; осуществлять экономическое обоснование проектов по развитию организации на основе статистических данных и в интересах минимизации рисков
Владеть:
Навыками принятия управленческих решений с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможностей использования имеющихся ресурсов.
ПК-2: способен обосновывать выбор методик расчета экономических показателей.
Знать:
- основные методики расчета экономических показателей; - методологию выбора методики;
Уметь:
определять критерии выбора методики расчета экономических показателей;
Владеть:
навыками обоснованного выбора методик расчета экономических показателей

4. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ), СТРУКТУРИРОВАННОЕ ПО ТЕМАМ (РАЗДЕЛАМ) С УКАЗАНИЕМ ОТВЕДЕННОГО НА НИХ КОЛИЧЕСТВА АКАДЕМИЧЕСКИХ ЧАСОВ И ВИДОВ УЧЕБНЫХ ЗАНЯТИЙ							
Код занятия	Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр / Курс	Часов	Компетенции	Литература	Инте ракт.	Примечание
	Раздел 1. 7 семестр						
1.1	ЦБ как объект оценки /Лек/	7	2	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4	0	
1.2	Основные модели ОЦБ, используемые на РЦБ. Нормативно-правовая и информационная база ОЦБ в РФ /Лек/	7	4	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4	0	
1.3	Оценка долевых ценных бумаг. (акция, инвест. пай) /Лек/	7	4	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4	0	
1.4	Анализ риска облигаций. Дюрация облигаций /Лек/	7	4	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4	0	
1.5	Общая характеристика финансового рынка. Понятие моделирования РЦБ /Лаб/	7	2	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4	0	
1.6	Инвестиционные возможности и характеристики ЦБ /Лаб/	7	4	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4	0	
1.7	Метод рыночных коэффициентов. Мультипликаторы. /Лаб/	7	4	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4	0	

1.8	Методы фундаментального анализа и технического анализа. /Лаб/	7	2	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4	0	работа в малых группах
1.9	Модели оценки стоимости акций /Лаб/	7	4	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4	0	
1.10	Методы анализа и оценки стоимости облигации /Лаб/	7	2	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4	0	
1.11	Расчет цены и доходности облигаций. /Лаб/	7	2	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4	0	
1.12	Дюрация облигации (модифицированная дюрация, оценка в базисных пунктах, показатель выпуклости) /Лаб/	7	2	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4	0	
1.13	подготовка к лекционным занятиям /Ср/	7	19	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4	0	
1.14	подготовка к практическим /лабораторным работам /Ср/	7	25	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4	0	
1.15	подготовка к проверочным работам /тестированию /Ср/	7	28	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4	0	

1.16	подготовка к экзамену /Экзамен/	7	36	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4	0	
1.17	Теоретические основы портфельной теории. Методика выбора оптимального инвестиционного портфеля /Лек/	7	4	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.4	0	
1.18	Анализ РЦБ на основе моделей равновесия. Анализ РЦБ на основе факторных моделей /Лек/	7	4	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.4	0	
1.19	Теория эффективного финансового рынка /Лек/	7	4	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.4	0	
1.20	Методы оптимального портфельного инвестирования /Лек/	7	4	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.4	0	
1.21	Биржевая информация и основы биржевой статистики /Лек/	7	2	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.4	0	
1.22	Расчет инвестиционных характеристик портфеля /Лаб/	7	4	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.4	0	
1.23	Формирование портфелей активов при возможности безрискового кредитования и заимствования /Лаб/	7	2	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.4	0	
1.24	Формирование портфеля ЦБ. Показатели, оценка, динамика /Лаб/	7	4	ОПК-4 ПК-2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.4	0	

Размещены в приложении

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**6.1. Рекомендуемая литература****6.1.1. Перечень основной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)**

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л1.1		Стратегия выхода предприятия на рынок ценных бумаг: Практ. руководство	Москва, 1997,
Л1.2	Буренин А.Н.	Рынок ценных бумаг и производных финансовых инструментов: Учеб. пособие	Москва: 1 Федер. Книготорг. Компания, 1998,
Л1.3	Ивасенко А.Г., Никонова Я.И.	Рынок ценных бумаг: Инструменты и механизмы функционирования: учеб. пособие для вузов	Москва: Кнорус, 2010,
Л1.4	Макарова Т.С.	Рынок ценных бумаг: экономико-правовой анализ	, ,
Л1.5	Чуприков Д.В., Кожевников Р.А.	Рынок ценных бумаг как инструмент корпоративного управления	, ,
Л1.6	Лакно Ю. В.	Российский рынок ценных бумаг как неравновесная экономическая система	, ,
Л1.7	Бердникова Т. Б.	Рынок ценных бумаг и биржевое дело: Учебное пособие. - (Серия "Высшее образование"): Учебное пособие	Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2000, https://znanium.com/catalog/document?id=78854
Л1.8	Чеботарев Н. Ф.	Оценка стоимости предприятия (бизнеса)	Москва: Издательско-торговая корпорация "Дашков и К", 2014, http://znanium.com/go.php?id=450877
Л1.9	Бусов В. И.	Оценка стоимости предприятия (бизнеса): Учебник	М.: Издательство Юрайт, 2017,

6.1.2. Перечень дополнительной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Шарп У.Ф., Александр Г.Дж.	Инвестиции: учеб. для вузов	Москва: Инфра-М, 2011,
Л2.2	Ионова Ю. Г., Леднев В. А., Андреева М. Ю.	Финансовый менеджмент	Москва: Московский финансово-промышленный университет «Синергия», 2016, http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=429469

6.1.3. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л3.1	Горлач Б. А., Шахов В. Г.	Математическое моделирование. Построение моделей и численная реализация	Санкт-Петербург: Лань, 2018, https://e.lanbook.com/book/103190
Л3.2	Бусов П.Н., Бусов П.П., Орехова Н.П., Скородулина С.В.	Задачи по финансовой математике: Учебное пособие	Москва: КноРус, 2020, https://www.book.ru/book/932049
Л3.3	Эскиндаров М. А., Балюк ., Белянчикова И. А., Горбунова Т. В., Диденко О. А., Игнатова А. С., Кузнецов О. В., Навой А. В., Платонова А. В., Прудникова И. Н., Рубцов А. А., Сергеева Б. Б., Хесин Н. В., Хмыз Е. С., Ярыгина О. В., Звонова Е. А.	Международный финансовый рынок: Учебник и практикум для вузов	Москва: Юрайт, 2020, https://urait.ru/bcode/451189

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
ЛЗ.4	Барчуков А.В.	Финансовый менеджмент: практикум	Хабаровск: Изд-во ДВГУПС, 2021,
6.3 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости)			
6.3.1 Перечень программного обеспечения			
Free Conference Call (свободная лицензия)			
Zoom (свободная лицензия)			
Total Commander - Файловый менеджер, лиц. LO9-2108, б/с			
Антивирус Kaspersky Endpoint Security для бизнеса – Расширенный Russian Edition - Антивирусная защита, контракт 469 ДВГУПС			
Антиплагиат - Система автоматической проверки текстов на наличие заимствований из общедоступных сетевых источников, контракт 12724018158180000974/830 ДВГУПС			
АСТ тест - Комплекс программ для создания банков тестовых заданий, организации и проведения сеансов тестирования, лиц. АСТ.РМ.А096.Л08018.04, дог.372			
Windows 10 - Операционная система, лиц.1203984219			
6.3.2 Перечень информационных справочных систем			
Российские СМИ			
1. РБК			
2. Коммерсант			
3. Ведомости			
4. Интерфакс			
5. Форбс			
2. Котировки и графики			
1. Finam — выбор по инструментам, площадкам, отраслям			
2. Investing — много виджетов, графиков, индикаторов			
3. MFD — финансовый портал: котировки, аналитика, новости эмитентов			
4. Smart-lab — в один клик переход ко всем видам котировок (в реальном времени)			
5. РБК — акции, индексы, валюты, товары, фьючерсы			
6. БКС — экспресс обзор котировок, аналитика, обзор рынка			
7. Мосбиржа — котировки напрямую от организатора торгов			
8. Trading View — лучший для графического анализа			
9. Норд капитал (Инвест компания)			
10. АТОН (ИК) – предложения, рынок слияния и поглощения			
11. Велес Капитал (ИК)- аналитика, операции на рынке акций, текущие рекомендации, обзор по отраслям и эмитентам, ежедневные обзоры рынка			
12. Доходь (ИК) - обзоры, комментарии, исследования, по секторам анализ акций			
3. Аналитика и мнения публичных экспертов			
1. РБК — новости и аналитика			
2. Finam — новости и комментарии			
3. БКС — инвестицидеи от БКС и независимых экспертов			
4. Investing — самые читаемые мнения аналитиков			
5. Finversia – финансовая информация, новости, события, котировки			
4. Прогнозы и рекомендации специалистов и участников рынков			
1. Smart-lab — сообщество трейдеров и инвесторов; новости финансовых рынков			
2. MFD — комментарии аналитиков			
3. MT5 — forex аналитика от специалистов			
4. Investfunds — персональные блоги авторов			
5. RAIF Daily Focus – обзор финансового рынка, обзоры по долговому рынку			
5. Форумы, соцсети, каналы			
1. Московская биржа — форум Мосбиржи			
2. MFD — форум популярного сообщества трейдеров			
3. Money Maker Group — форум о заработке и инвестициях			

4.	Банки.ру — группа ВК главного банковского портала
5.	United Traders — группа ВК популярного сообщества брокера
6.	ПлюсОНОМИКА – блог по инвестициям (ПИФ, банки, налоги)

7. ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

Аудитория	Назначение	Оснащение
343	Помещения для самостоятельной работы обучающихся. Читальный зал НТБ	Тематические плакаты, столы, стулья, стеллажи. Компьютерная техника с возможностью подключения к сети Интернет, свободному доступу в ЭБС и ЭИОС.
354	Учебная аудитория для проведения практических занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации.	Комплект учебной мебели, доска, экран переносной, мультимедиапроектор переносной.
1303	Помещения для самостоятельной работы обучающихся. Читальный зал НТБ	Тематические плакаты, столы, стулья, стеллажи Компьютерная техника с возможностью подключения к сети Интернет, свободному доступу в ЭБС и ЭИОС.
423	Помещения для самостоятельной работы обучающихся. зал электронной информации	Тематические плакаты, столы, стулья, стеллажи Компьютерная техника с возможностью подключения к сети Интернет, свободному доступу в ЭБС и ЭИОС.
1603	Учебная аудитория для проведения практических занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации.	Комплект учебной мебели, доска, мультимедиапроектор переносной.

8. МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Дисциплина «Оценка и моделирование РЦБ» знакомит студентов с разделами финансовой экономики и оценки ценных бумаг, в которых излагаются количественные методы анализа и моделирования финансового (фондового) рынка на основе доходностей финансовых активов (ценных бумаг).

Целью дисциплины является освоение студентами современных количественных методов анализа и моделирования финансового (фондового) рынка; методов оптимального портфельного инвестирования, а также эконометрического моделирования и анализа финансового (фондового) рынка.

В рамках поставленной цели задачами дисциплины «Оценка и моделирование рынка ценных бумаг» являются:

- ознакомление с принципами организации и функционирования финансовых рынков;
- освоение теоретических основ и практических навыков по анализу ценных бумаг и фондового рынка в условиях неопределенности с использованием эконометрических моделей;
- изучение методов оптимального портфельного инвестирования и теории эффективного финансового рынка;
- знакомство с моделями равновесия фондового рынка и методами их применения в задачах оптимизации инвестиционных портфелей.

Оценочные материалы при формировании рабочих программ дисциплин (модулей)

Специальность 38.05.01 Экономическая безопасность

Специализация: специализация "Экономическая безопасность
транспортного комплекса в условиях цифровой трансформации"

Дисциплина: Оценка и моделирование РЦБ

Формируемые компетенции:

1. Описание показателей, критериев и шкал оценивания компетенций.

Показатели и критерии оценивания компетенций

Объект оценки	Уровни сформированности компетенций	Критерий оценивания результатов обучения
Обучающийся	Низкий уровень Пороговый уровень Повышенный уровень Высокий уровень	Уровень результатов обучения не ниже порогового

Шкалы оценивания компетенций при сдаче экзамена или зачета с оценкой

Достигнутый уровень результата обучения	Характеристика уровня сформированности компетенций	Шкала оценивания
		Экзамен или зачет с оценкой
Низкий уровень	Обучающийся: -обнаружил пробелы в знаниях основного учебно-программного материала; -допустил принципиальные ошибки в выполнении заданий, предусмотренных программой; -не может продолжить обучение или приступить к профессиональной деятельности по окончании программы без дополнительных занятий по соответствующей дисциплине.	Неудовлетворительно
Пороговый уровень	Обучающийся: -обнаружил знание основного учебно-программного материала в объёме, необходимом для дальнейшей учебной и предстоящей профессиональной деятельности; -справляется с выполнением заданий, предусмотренных программой; -знаком с основной литературой, рекомендованной рабочей программой дисциплины; -допустил неточности в ответе на вопросы и при выполнении заданий по учебно-программному материалу, но обладает необходимыми знаниями для их устранения под руководством преподавателя.	Удовлетворительно
Повышенный уровень	Обучающийся: - обнаружил полное знание учебно-программного материала; -успешно выполнил задания, предусмотренные программой; -усвоил основную литературу, рекомендованную рабочей программой дисциплины; -показал систематический характер знаний учебно-программного материала; -способен к самостоятельному пополнению знаний по учебно-программному материалу и обновлению в ходе дальнейшей учебной работы и профессиональной деятельности.	Хорошо

Высокий уровень	Обучающийся: -обнаружил всесторонние, систематические и глубокие знания учебно-программного материала; -умеет свободно выполнять задания, предусмотренные программой; -ознакомился с дополнительной литературой; -усвоил взаимосвязь основных понятий дисциплин и их значение для приобретения профессии; -проявил творческие способности в понимании учебно-программного материала.	Отлично
-----------------	---	---------

Шкалы оценивания компетенций при защите курсового проекта/курсовой работы

Достигнутый уровень результата обучения	Характеристика уровня сформированности компетенций	Шкала оценивания
Низкий уровень	Содержание работы не удовлетворяет требованиям, предъявляемым к КР/КП; на защите КР/КП обучающийся не смог обосновать результаты проведенных расчетов (исследований); цель КР/КП не достигнута; структура работы нарушает требования нормативных документов; выводы отсутствуют или не отражают теоретические положения, обсуждаемые в работе; в работе много орфографических ошибок, опечаток и других технических недостатков; язык не соответствует нормам научного стиля речи.	Неудовлетворительно
Пороговый уровень	Содержание работы удовлетворяет требованиям, предъявляемым к КР/КП; на защите КР/КП обучающийся не смог обосновать все результаты проведенных расчетов (исследований); задачи КР/КП решены не в полном объеме, цель не достигнута; структура работы отвечает требованиям нормативных документов; выводы присутствуют, но не полностью отражают теоретические положения, обсуждаемые в работе; в работе присутствуют орфографические ошибки, опечатки; язык соответствует нормам научного стиля речи; при защите КР/КП обучающийся излагает материал неполно и допускает неточности в определении понятий или формулировке правил; затрудняется или отвечает не правильно на поставленный вопрос.	Удовлетворительно
Повышенный уровень	Содержание работы удовлетворяет требованиям, предъявляемым к КР/КП; на защите КР/КП обучающийся смог обосновать все результаты проведенных расчетов (исследований); задачи КР/КП решены в полном объеме, цель достигнута; структура работы отвечает требованиям нормативных документов; выводы присутствуют, но не полностью отражают теоретические положения, обсуждаемые в работе; в работе практически отсутствуют орфографические ошибки, опечатки; язык соответствует нормам научного стиля речи; при защите КР/КП обучающийся излагает материал, дает правильное определение основных понятий; затрудняется или отвечает не правильно на	Хорошо
Высокий	Содержание работы удовлетворяет требованиям, предъявляемым к КР/КП; на защите КР/КП обучающийся смог обосновать все результаты проведенных расчетов (исследований); задачи КР/КП решены в полном объеме, цель достигнута; структура работы отвечает требованиям нормативных документов; выводы присутствуют и полностью отражают теоретические положения, обсуждаемые в работе; в работе отсутствуют орфографические ошибки, опечатки; язык соответствует нормам научного стиля речи; при защите КР/КП обучающийся полно излагает материал, дает правильное определение основных понятий; четко и грамотно отвечает на вопросы.	Отлично

Описание шкал оценивания

Компетенции обучающегося оценивается следующим образом:

Планируемый уровень результатов освоения	Содержание шкалы оценивания достигнутого уровня результата обучения			
	Неудовлетворительн	Удовлетворительно	Хорошо	Отлично
	Не зачтено	Зачтено	Зачтено	Зачтено
Знать	Неспособность обучающегося самостоятельно продемонстрировать наличие знаний при решении заданий, которые были представлены преподавателем вместе с образцом их решения.	Обучающийся способен самостоятельно продемонстрировать наличие знаний при решении заданий, которые были представлены преподавателем вместе с образцом их решения.	Обучающийся демонстрирует способность к самостоятельному применению знаний при решении заданий, аналогичных тем, которые представлял преподаватель, и при его консультативной	Обучающийся демонстрирует способность к самостоятельному применению знаний в выборе способа решения неизвестных или нестандартных заданий и при консультативной поддержке в части междисциплинарных
Уметь	Отсутствие у обучающегося самостоятельности в применении умений по использованию методов освоения учебной дисциплины.	Обучающийся демонстрирует самостоятельность в применении умений решения учебных заданий в полном соответствии с образцом, данным преподавателем.	Обучающийся продемонстрирует самостоятельное применение умений решения заданий, аналогичных тем, которые представлял преподаватель, и при его консультативной поддержке в части современных проблем.	Обучающийся демонстрирует самостоятельное применение умений решения неизвестных или нестандартных заданий и при консультативной поддержке преподавателя в части междисциплинарных связей.
Владеть	Неспособность самостоятельно проявить навык решения поставленной задачи по стандартному образцу повторно.	Обучающийся демонстрирует самостоятельность в применении навыка по заданиям, решение которых было показано преподавателем.	Обучающийся демонстрирует самостоятельное применение навыка решения заданий, аналогичных тем, которые представлял преподаватель, и при его консультативной поддержке в части современных проблем.	Обучающийся демонстрирует самостоятельное применение навыка решения неизвестных или нестандартных заданий и при консультативной поддержке преподавателя в части междисциплинарных связей.

2. Перечень вопросов и задач к экзаменам, зачетам, курсовому проектированию, лабораторным занятиям. Образец экзаменационного билета

Образец экзаменационного билета

Дальневосточный государственный университет путей сообщения		
Кафедра (к307) Финансы и бухгалтерский учёт 7 семестр, 2024-2025	Экзаменационный билет № Оценка и моделирование РЦБ Специальность 38.05.01 Экономическая безопасность Специализация: специализация "Экономическая безопасность транспортного комплекса в условиях цифровой трансформации"	Утверждаю» Зав. кафедрой Немчианова М.А., канд. экон. наук, доцент 25.04.2024 г.
Вопрос Процесс формирования портфеля ценных бумаг: основные этапы (ПК-2, ОПК-4) (ОПК-4, ПК-2)		

<p>Вопрос Для покупки на бирже ценных бумаг участник фондового рынка взял в банке кредит на 1 год в сумме 2 млн. руб. с условием возврата 2.4 млн. руб. Вычислить процентную ставку и дисконт этой операции. (ОПК-4,ПК-2)</p>
<p>Задача (задание) (ОПК-4,ПК-2)</p>

Примечание. В каждом экзаменационном билете должны присутствовать вопросы, способствующие формированию у обучающегося всех компетенций по данной дисциплине.

3. Тестовые задания. Оценка по результатам тестирования.

Полный комплект тестовых заданий в корпоративной тестовой оболочке АСТ размещен на сервере УИТ ДВГУПС, а также на сайте Университета в разделе СДО ДВГУПС (образовательная среда в личном кабинете преподавателя).

Соответствие между бальной системой и системой оценивания по результатам тестирования устанавливается посредством следующей таблицы:

Объект оценки	Показатели оценивания результатов обучения	Оценка	Уровень результатов обучения
Обучающийся	60 баллов и менее	«Неудовлетворительно»	Низкий уровень
	74 – 61 баллов	«Удовлетворительно»	Пороговый уровень
	84 – 75 баллов	«Хорошо»	Повышенный уровень
	100 – 85 баллов	«Отлично»	Высокий уровень

4. Оценка ответа обучающегося на вопросы, задачу (задание) экзаменационного билета, зачета, курсового проектирования.

Оценка ответа обучающегося на вопросы, задачу (задание) экзаменационного билета, зачета

Элементы оценивания	Содержание шкалы оценивания			
	Неудовлетворительн	Удовлетворитель	Хорошо	Отлично
	Не зачтено	Зачтено	Зачтено	Зачтено
Соответствие ответов формулировкам вопросов (заданий)	Полное несоответствие по всем вопросам.	Значительные погрешности.	Незначительные погрешности.	Полное соответствие.
Структура, последовательность и логика ответа. Умение четко, понятно, грамотно и свободно излагать свои мысли	Полное несоответствие критерию.	Значительное несоответствие критерию.	Незначительное несоответствие критерию.	Соответствие критерию при ответе на все вопросы.
Знание нормативных, правовых документов и специальной литературы	Полное незнание нормативной и правовой базы и специальной литературы	Имеют место существенные упущения (незнание большей части из документов и специальной литературы по названию, содержанию и т.д.).	Имеют место несущественные упущения и незнание отдельных (единичных) работ из числа обязательной литературы.	Полное соответствие данному критерию ответов на все вопросы.

Умение увязывать теорию с практикой, в том числе в области профессиональной работы	Умение связать теорию с практикой работы не проявляется.	Умение связать вопросы теории и практики проявляется редко.	Умение связать вопросы теории и практики в основном проявляется.	Полное соответствие данному критерию. Способность интегрировать знания и привлекать сведения из различных научных сфер.
Качество ответов на дополнительные вопросы	На все дополнительные вопросы преподавателя даны неверные ответы.	Ответы на большую часть дополнительных вопросов преподавателя даны неверно.	1. Даны неполные ответы на дополнительные вопросы преподавателя. 2. Дан один неверный ответ на дополнительные вопросы преподавателя.	Даны верные ответы на все дополнительные вопросы преподавателя.

Примечание: итоговая оценка формируется как средняя арифметическая результатов элементов оценивания.

Оценка ответа обучающегося при защите курсовой работы/курсового проекта

Элементы оценивания	Содержание шкалы оценивания			
	Неудовлетворитель	Удовлетворительно	Хорошо	Отлично
Соответствие содержания КР/КП методике расчета (исследования)	Полное несоответствие содержания КР/КП поставленным целям или их отсутствие.	Значительные погрешности.	Незначительные погрешности.	Полное соответствие.
Качество обзора литературы	Недостаточный анализ.	Отечественная литература.	Современная отечественная литература.	Новая отечественная и зарубежная литература.
Творческий характер КР/КП, степень самостоятельности в разработке	Работа в значительной степени не является самостоятельной.	В значительной степени в работе использованы выводы, выдержки из других авторов без ссылок на них.	В ряде случаев отсутствуют ссылки на источник информации.	Полное соответствие критерию.
Использование современных информационных технологий	Современные информационные технологии, вычислительная техника не были использованы.	Современные информационные технологии, вычислительная техника использованы слабо. Допущены серьезные ошибки в расчетах.	Имеют место небольшие погрешности в использовании современных информационных технологий, вычислительной техники.	Полное соответствие критерию.

Качество графического материала в КР/КП	Не раскрывают смысл работы, небрежно оформлено, с большими отклонениями от требований ГОСТ, ЕСКД и др.	Не полностью раскрывают смысл, есть существенные погрешности в оформлении.	Не полностью раскрывают смысл, есть погрешность в оформлении.	Полностью раскрывают смысл и отвечают ГОСТ, ЕСКД и др.
Грамотность изложения текста КР/КП	Много стилистических и грамматических ошибок.	Есть отдельные грамматические и стилистические ошибки.	Есть отдельные грамматические ошибки.	Текст КР/КП читается легко, ошибки отсутствуют.
Соответствие требованиям, предъявляемым к оформлению КР/КП	Полное не выполнение требований, предъявляемых к оформлению.	Требования, предъявляемые к оформлению КР/КП, нарушены.	Допущены незначительные погрешности в оформлении КР/КП.	КР/КП соответствует всем предъявленным требованиям.
Качество доклада	В докладе не раскрыта тема КР/КП, нарушен регламент.	Не соблюден регламент, недостаточно раскрыта тема КР/КП.	Есть ошибки в регламенте и использовании чертежей.	Соблюдение времени, полное раскрытие темы КР/КП.
Качество ответов на вопросы	Не может ответить на дополнительные вопросы.	Знание основного материала.	Высокая эрудиция, нет существенных ошибок.	Ответы точные, высокий уровень эрудиции.

Примечание: итоговая оценка формируется как средняя арифметическая результатов элементов оценивания.