

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Антипова Наталья Викторовна
Должность: и.о. директора филиала
Дата подписания: 20.02.2024 18:49:52
Уникальный программный ключ:
fae5412acb1bf810dc69e6bc004ac45622b84b3a

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова»

Улан-Баторский филиал РЭУ им. Г.В. Плеханова



АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.02 Финансовые вычисления

| | |
|---|---------------------------|
| Направление подготовки | 38.03.01 Экономика |
| Направленность (профиль) программы | Финансы и кредит |
| Уровень высшего образования | Бакалавриат |

1. Цель и задачи дисциплины:

Целью дисциплины «Финансовые вычисления» является:

1. обучить студентов основам математического аппарата, используемого для решения задач финансового инвестирования (в частности моделирование эволюции цен активов и оценка условных требований (на покупку и продажу) в случае дискретных и непрерывных временных рамок);

2. сформировать и развить у студентов навыки применения методов количественного анализа с использованием информационных технологий, а также навыки самостоятельной работы с учебной и научной литературой.

Задачи дисциплины «Финансовые вычисления»:

1. освоить математический аппарат, используемый для решения задач финансового инвестирования;

2. изучить количественные методы оценки доходности и риска инвестирования в ценные бумаги и портфели из них;

3. приобрести навыки применения экономико-математического аппарата для решения практических задач на финансовом рынке.

2. Содержание дисциплины:

| № п/п | Наименование разделов / тем дисциплины |
|---|--|
| 1. | Раздел 1. Финансовые инструменты. |
| 2. | Финансовые инструменты: основные понятия и математический аппарат. |
| 3. | Портфельная теория Марковица. |
| 4. | Модели оценки финансовых активов. |
| 5. | Раздел 2. Производные финансовые инструменты. |
| 6. | Производные финансовые инструменты. |
| 7. | Биномиальная модель. |
| 8. | Модель Блэка-Шоулза. |
| Трудоемкость дисциплины составляет 5 з.е. / 180 часов. | |