

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**

<b>Направление подготовки</b>	<b>38.03.01 Экономика</b>
<b>Направленность (профиль) программы</b>	<b>Финансы и кредит</b>
<b>Уровень высшего образования</b>	<b>Бакалавриат</b>

## 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.
<b>Трудоемкость дисциплины составляет 5 з.е. / 180 часов.</b>	