

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



Одобрено
на заседании Совета Улан-Баторского
филиала РЭУ им. Г.В. Плеханова
Протокол № 11 от 15.06. 2021 г.
Председатель совета
Н.В.Антипова

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.	

Форма контроля – экзамен

Разработчики:

РЭУ им. Г.В. Плеханова

кафедра высшей математики

доцент

Е.П. Мочалина

РЭУ им. Г.В. Плеханова

кафедра высшей математики

ст. преп.

Г.В. Иванкова