

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Антипова Наталья Викторовна  
Должность: и.о. директора филиала  
Дата подписания: 19.02.2024 20:10:51  
Уникальный программный идентификатор:  
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

Одобрено  
На заседании Совета Улан-Баторского  
филиала РЭУ им. Г.В. Плеханова  
Протокол № 10 от «25» мая 2025 г.  
Председатель совета  
Антипова Н.В. Антипова



## **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>

**Год начала подготовки – 2023г**

## 1. Цель и задачи дисциплины:

Целью дисциплины «Финансовые вычисления» является

- освоение обучающимися 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);
- 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»:

- освоить математический аппарат, используемый для решения задач финансового инвестирования;
- изучить количественные методы оценки доходности и риска инвестирования в ценные бумаги и портфели из них;
- приобрести навыки применения экономико-математического аппарата и информационных технологий для решения практических задач на финансовом рынке.

## 2. Содержание дисциплины:

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

**Форма контроля – экзамен**

### Разработчики:

ФГБОУ ВО «РЭУ им. Г.В. Плеханова»,  
кафедра высшей математики

доцент

Е.П. Мочалина

ФГБОУ ВО «РЭУ им. Г.В. Плеханова»,  
кафедра высшей математики

ст. преподаватель Г.В. Иванкова