

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.О.09 «ФИНАНСОВАЯ МАТЕМАТИКА»

Наименование образовательной программы: Финансы и кредит

Код и наименование магистратуры: 38.03.01 Экономика

Форма обучения: очная

Планируемые результаты освоения дисциплины: использует инструменты финансовой математики в целях оценки финансовых инструментов и принятия инвестиционных решений; проводит анализ посредством инструментов финансовой математики.

Объем дисциплины: общая трудоемкость дисциплины составляет 5 з.е. (180 а.ч.), количество академических часов, выделенных на контактную работу с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся: очная форма обучения: лекции – 32 а.ч., практические занятия – 32 а.ч., самостоятельная работа – 76 ч., экзамен - 36 а.ч. и консультация – 2 а.ч.

Структура дисциплины: *Тема 1. Модели начисления процентов. Тема 2. Поток платежей. Тема 3. Методы принятия инвестиционных решений. Тема 4. Простые модели оценки финансовых инструментов: облигации и акции. Тема 5. Портфельная теория. Тема 6. CAPM и ее модификации. Тема 7. Ценообразование деривативов.*

Форма промежуточной аттестации: экзамен

Основная литература:

1. Копнова, Е. Д. Финансовая математика: учебник и практикум для вузов / Е. Д. Копнова. — Москва: Издательство Юрайт, 2020. — 413 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00620-9. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/450365>
2. Джон К. Халл. Опционы, фьючерсы и другие производные финансовые инструменты, 8-е издание. – Издательский дом Вильямс, 2018. – 1072 с.
3. Галанов, В. А. Производные финансовые инструменты: учебник / В.А. Галанов. — 2-е изд, перераб. и доп.— Москва: ИНФРА-М, 2019. — 221 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). — www.dx.doi.org/10.12737/21804. - ISBN 978-5-16-105154-2. - Текст: электронный. - URL: <https://new-znaniy-com.ezproxy.ranepa.ru:2443/catalog/product/1012374>