

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.О.10 «Финансовая математика»

наименование дисциплины

Наименование образовательной программы: «Финансы и кредит»

Код и наименование направления подготовки: 38.03.01 Экономика

Форма обучения: очная

Планируемые результаты освоения дисциплины:

Дисциплина Б1.О.10 «Финансовая математика» обеспечивает овладение следующими компетенциями:

| Код компетенции | Наименование компетенции |
|-----------------|---|
| ПКо ОС II - 3 | Способен использовать методы финансовой математики для решения прикладных задач |

Объем дисциплины: 4 з. е, 144 акад. часов.

Структура дисциплины:

Очная форма обучения

Тема 1 – Модели начисления процентов.

Тема 2 – Потоки 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.

Формы 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. 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 978-5-16-012272-4. - Текст : электронный. — URL: <https://znanium.com/catalog/product/1012374>