

Дисциплина: Теория Финансов и Основные Финансовые Модели (продвинутый курс)

Аннотация

Трудоемкость: 6 ECTS, 216 академических часа.

Форма итогового контроля: экзамен.

Краткое содержание: Целью изучения данной учебной дисциплины является ознакомление с основными современными подходами оценки и математическими моделями, используемыми для изучения ценообразования и ценовой динамики ключевых финансовых активов, имеющих практическое применение в финансовой индустрии.

Программа предназначена для студентов магистратуры экономического факультета по направлению «Экономика». Курс составлен на основе изучения отечественной и зарубежной литературы и современного практического опыта моделирования и прогнозирования в области инвестиций и управления финансовыми активами.

При изучении курса используются лекции, семинарские занятия, а для выявления степени усвоения материала проводятся контрольные работы, тесты, а также обсуждение и анализ проблем, связанных с практическим применением моделей.

Цель и задачи дисциплины: Цель курса – дать системное представление об основных подходах и методах, используемых для анализа ценообразования и оценки рисков связанных с базовыми ценными бумагами (Бумаги с Фиксированным Доходом, Акции) и деривативов (Опционы, Фьючерсы и Форварды, Свопы), с использованием современных прикладных моделей, основанных, в основном, на теории стохастических моделей и Ито Алгебре.

Формирование у студентов понимания подходов в категоризации и выборе моделей для решения задач связанных с оценкой и управлением рисками, сопряженными с базовыми финансовыми инструментами, инвестиционными портфелями, а также основными производными ценных бумаг.

В соответствии с поставленной целью задачей курса является показать и научить студентов оценивать ценные бумаги с подробным алгоритмом фундаментального анализа и наиболее практичных приемов технического анализа, принимать инвестиционные решения.

Взаимосвязь дисциплины с другими дисциплинами учебного плана направления: Дисциплина «Управление и регулирование финансовыми рисками» относится к продвинутой части профессионального цикла и взаимосвязана с другими дисциплинами учебного плана, в частности с предметами «Анализ финансовой отчетности», «Макроэкономика в финансах» и др. На основе курса можно изучить следующие дисциплины: финансовый менеджмент, корпоративные финансы.