

**АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ****Б1.В.ДВ.06.01 ФИНАНСОВАЯ МАТЕМАТИКА****Автор****Код и наименование направления подготовки, профиля:** 38.03.01

Экономика

Профиль «Экономика и управление бизнесом»

**Квалификация (степень) выпускника:** бакалавр**Форма обучения:** очная**Цель освоения дисциплины:**

Сформировать компетенцию в области осуществления процентных расчетов в финансовых операциях; анализа потоков платежей и оценки проектов; расчетов по основным финансовым инструментам; оптимизации инвестиционного портфеля; применения стохастических моделей для расчета стоимости деривативов: ПК-2, ДПК-1.

**План курса:**

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. САРМ и ее модификации

Тема 7. Ценообразование деривативов

**Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:**

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
ПК-2	Способность основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов	ПК-2.1	Способность применять типовые методики и действующую нормативно-правовую базу для расчета социально-экономических показателей деятельности предприятия
ДПК-1	Способность на основе описания экономических процессов и	ДПК-1.2	Способность анализировать результаты, полученные при описании экономических

	явлений строить стандартные модели, анализировать и интерпретировать полученные результаты		процессов и явлений с помощью стандартных моделей
--	--	--	---

Результат формирования компетенции на уровне данной дисциплины обеспечивается путем формирования у обучающихся:

На уровне знаний: знать процентные расчёты  
 знать методики анализа потоков платежей и финансовой оценки проектов  
 знать основные финансовые инструменты и методы расчётов по ним  
 знать методы оптимизации инвестиционного портфеля  
 знать модели для расчета стоимости деривативов

На уровне умений: уметь осуществлять процентные расчеты  
 уметь осуществлять анализ потоков платежей и финансовую оценку проекта  
 уметь производить расчеты по основным финансовым инструментам  
 уметь применять методы оптимизации инвестиционного портфеля  
 уметь применять стохастические модели в расчётах

На уровне навыков: владеть навыками осуществления процентных расчетов в финансовых операциях

владеть навыками анализа потоков платежей и оценки проектов  
 владеть навыками расчетов по основным финансовым инструментам  
 владеть навыками оптимизации инвестиционного портфеля  
 владеть навыками применения стохастических моделей для расчета стоимости деривативов

### **Основная литература:**

1. Копнова Е, Д. Финансовая математика. Учебник и практикум для бакалаври-ата и магистратуры //М.: Национальный исследовательский университет «Высшая школа экономики» (НИУ ВШЭ). — 2017.

2. Брейли Р., Майерс С., Принципы корпоративных финансов, М.: ЗАО «Олимп-Бизнес», — 2017.