

Аннотация дисциплины

«Финансовая математика»

Цель дисциплины

- Формирование базовых знаний о математических методах финансовой математики, понятийной теоретической базы и уровня практической подготовки, необходимых для понимания теории принятия решения с использованием финансового анализа. Приобретение базовых знаний о математических методах финансовой математики, умений и навыков использования математического аппарата для решения теоретических и прикладных финансовых задач.

Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина « Финансовая математика» входит в информационный модуль дисциплин по направлению 38.03.01 «Экономика» (профиль «Корпоративные финансы»).

Краткое содержание дисциплины

Основы классической финансовой математики. Простые и сложные проценты. Денежные потоки. Облигации и их основные характеристики. Управление портфелем облигаций. Портфельный анализ. Модель Марковица. Модель оценки финансовых активов. Производные финансовые инструменты. Модель Кокса-Росса-Рубинштейна. Модель Блэка-Шоулза. Выбор и принятие решений в условиях неопределенности. Отношения предпочтения, функции полезности, функции выбора. Меры риска.