Федеральное государственное образовательное бюджетное

учреждение высшего образования

**«Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации»**

**(Финансовый университет)**

Департамент финансовых рынков и финансового инжиниринга

Финансового факультета

|  |
| --- |
| УТВЕРЖДЕНО  Протокол заседания Департамента  от 30 августа 2023 года №1 |

**ТЕМАТИКА ВЫПУСКНЫХ КВАЛИФИКАЦИОННЫХ РАБОТ**

**на 2023-2024 учебный год**

**Магистратура**

Направление подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит»,

направленность программы «Финансовая математика и анализ рынков»

(очная форма обучения)

1. Прогнозирование динамики финансовых рынков с помощью (линейных/ нелинейных) моделей.
2. Прогнозирование динамики рынка акций на основе факторного анализа (на примере рынка отдельной страны или эмитента).
3. Развитие методики факторных моделей анализа динамики рынка биржевого товара (нефти, золота и т.д. – выбирается студентом).
4. Прогнозирование цен биржевых активов (валюта, нефть, цветные металлы, драгоценные металлы, зерно – по выбору) на основе анализа срочного рынка.
5. Развитие методики факторных моделей анализа динамики валютного рынка (выбирается студентом).
6. Оценка динамики рынков акций с помощью эмпирической многофакторной модели.
7. Разработка инвестиционной стратегии на российском фондовом рынке основе фундаментального анализа.
8. Развитие инвестиционных стратегий на рынках акций с учетом роли инфляционного фактора (с указанием страны, сектора, группы эмитентов).
9. Прогнозирование динамики рынка акций (облигаций/биржевых товаров (по выбору)) в условиях текущей фазы бизнес-цикла (с конкретизацией объекта в названии).
10. Прогнозирование динамики финансовых рынков на основе анализа влияния поведенческих паттернов.
11. Развитие методики анализа и прогноза индекса государственных облигаций (RGBI).
12. Развитие методики анализа и оценки параметров российского рынка облигаций в современных условиях.
13. Особенности формирования цен на рынке замещающих облигаций.
14. Развитие методов исследования динамики цен акций с помощью дискретных однородных цепей Маркова с конечным числом состояния.
15. Прогнозирование волатильности развитых и развивающихся финансовых рынков и их сегментов.
16. Разработка модели прогнозирования кризиса на рынке акций / долговом рынке, рынке недвижимости (по выбору).
17. Развитие методов исследования динамики фондовых индексов и ценообразования рыночных активов с использованием фрактальных моделей.
18. Развитие моделей оценки и управления рыночным риском при инвестировании в инструменты финансового рынка (международная практика, в российских условиях – по выбору).
19. Повышение эффективности управления портфелем инвестиционных (хеджевых фондов, компаний частного капитала – по выбору) в России (США, Европе, иных странах – по выбору) на основе применения методов (указать метод(ы)).
20. Оценка эффективности управления паевыми фондами: зарубежный опыт и российские реалии.
21. Повышение доходности инвестиционных портфелей пенсионных накоплений на российском рынке.
22. Направления диверсификации рисков размещения пенсионных резервов на российском фондовом рынке.
23. Повышение роли коллективных инвестиций в развитии российского финансового рынка.
24. Развитие альтернативных моделей розничного инвестирования на российском фондовом рынке.
25. Моделирование капитала инвестиционных институтов – современные методы (международная практика, в российских условиях – по выбору).
26. Управление капиталом институциональных инвесторов / инвестиционных банков посредством количественного моделирования инвестиционного риска.
27. Формирование портфеля ценных бумаг на основе спектральных мер риска.
28. Построение инвестиционных стратегий с помощью методов искусственного интеллекта.
29. Формирование инвестиционной стратегии с помощью нелинейного арбитража на опционном рынке.
30. Внутридневной трейдинг с использованием нейронных сетей.
31. Развитие методов анализа состояния финансового рынка с применением копула-функций.
32. Проектирование торговых систем с использованием математических моделей (модели, методы – по выбору).
33. Развитие методов технического анализа финансовых рынков (конкретизация в названии).
34. Проектирование структурированных продуктов: модельная составляющая.
35. Оценка и прогнозирование доходности инвестиционного портфеля методами динамического программирования.
36. Разработка подхода к ценообразованию цифровых финансовых активов.
37. Анализ особенностей ценообразования цифровых валют.
38. Совершенствование подходов к оценке финансового развития (на основе опыта международных организаций и академических исследований).
39. Межстрановой эмпирический анализ каналов влияния финансового развития на экономический рост.
40. Эмпирический анализ вклада финансового развития в повышение экономической эффективности и производительности (на уровне стран, регионов, отраслей, групп компаний — по выбору).
41. Развитие стратегии рыночно-ориентированной финансовой структуры на основе метода анализа сравнительных преимуществ.
42. Разработка подхода к оценке влияния вклада финтех и бигтех компаний в финансовое развитие.
43. Модификация таксономии финансовых инструментов в контексте возникновения рынка ЦФА.
44. Финансовые пирамиды, современные способы мошенничества: анализ и меры по их сокращению.

Руководитель магистерской

программы «Финансовая математика

и анализ рынков», д.э.н., доцент К.В. Криничанский