Федеральное государственное образовательное бюджетное учреждение

высшего образования

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

**(Финуниверситет)**

Департамент финансовых рынков и финансового инжиниринга

Финансового факультета

|  |
| --- |
| УТВЕРЖДЕНОПротокол 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 «Анализ финансовых рынков»

 (Институт открытого образования)

1. Анализ вклада финтех и бигтех компаний в финансовое развитие.

2. Анализ влияния поведенческих паттернов на динамику финансовых рынков.

3. Анализ и прогнозирование волатильности развитых и развивающихся финансовых рынков и их сегментов.

4. Анализ и прогнозирование динамики финансовых рынков с помощью (линейных / нелинейных) моделей.

5. Анализ и прогнозирование параметров российского рынка облигаций в условиях изменившейся структуры притока ликвидности.

6. Анализ роли инфляционного фактора на рынках акций (*с указанием страны, сектора, группы эмитентов*).

7. Анализ стратеги пассивного инвестирования и причин их доминиования на рынке инструментов для коллективных инвесторов.

8. Анализ стратегий совершенствования финансовой структуры (на примере группы стран).

9. Анализ эффективности управления портфелем (*пенсионных, инвестиционных, хеджевых фондов, компаний частного капитала (по выбору) (в России, США, Европе, иных странах (по выбору)*).

10. Внутридневной трейдинг с использованием нейронных сетей.

11. Маркетплейсы на финансовом рынке: продукты, архитектура, влияние на цены финансовых инструментов.

12. Межстрановой эмпирический анализ каналов влияния финансового развития на экономический рост.

13. Модели оценки и управления рыночным риском при инвестировании в инструменты финансового рынка *(международная практика, в российских условиях (по выбору))*.

14. Моделирование капитала инвестиционных институтов – современные методы *(международная практика, в российских условиях (по выбору)).*

15. Модификация таксономии финансовых инструментов в контексте возникновения рынка ЦФА.

16. Особенности формирования цен на рынке замещающих облигаций.

17. Оценка динамики рынков акций с помощью эмпирической многофакторной модели.

18. Оценка и прогнозирование доходности инвестиционного портфеля методами динамического программирования.

19. Оценка эффективности управления паевыми фондами: зарубежный опыт и российские реалии.

20. Оценки инвестиционной привлекательности компаний с использованием технологий BigData и DataScience. *(пояснение: требуются не только компетенции, но и доступ к массивам информационных ресурсов)*.

21. Построение инвестиционных стратегий с помощью методов искусственного интеллекта.

22. Проблемы использования фундаментального анализа для оценки инвестиционной привлекательности компаний *(пояснение: на примере конкретной отрасли, которая должна быть включена в название)*.

23. Прогнозирование цен биржевых активов *(валюта, нефть, цветные металлы, драгоценные металлы, зерно (по выбору))* на основе анализа срочного рынка.

24. Проектирование структурированных продуктов: модельная составляющая.

25. Проектирование торговых систем с использованием математических моделей *(модели, методы (по выбору))*.

26. Развитие методов технического анализа финансовых рынков *(конкретизация в названии)*.

27. Разработка модели прогнозирования кризиса на рынке акций/долговом рынке, рынке недвижимости *(по выбору)*.

28. Разработка подхода к ценообразованию цифровых финансовых активов.

29. Совершенствование подходов к оценке финансового развития *(на основе опыта международных организаций и академических исследований)*.

30. Сравнение доходности традиционных и «зеленых» облигаций в мире и России.

31. Сравнительный анализ эффективности операций центральных банков с ценными бумагами. *(пояснение: на примере 2–3 стран, включая Россию).*

32. Управление капиталом институциональных инвесторов/инвестиционных банков посредством количественного моделирования инвестиционного риска.

33. Факторные модели анализа динамики валютного рынка *(выбирается студентом)*.

34. Факторные модели анализа динамики рынка биржевого товара *(нефти, золота и т.д. (выбирается студентом))*.

35. Факторный анализ динамики рынка акций *(на примере рынка отдельной страны или эмитента).*

36. Финансовый инжиниринг и конструирование выпуска ценных бумаг *(пояснение: с обязательным рассмотрением предлагаемого гипотетического выпуска для конкретной компании).*

37. Формирование инвестиционной стратегии с помощью нелинейного арбитража на опционном рынке.

38. Формирование портфеля ценных бумаг на основе спектральных мер риска.

39. Ценообразование на первичном рынке акций на развитых и формирующихся рынках *(пояснение: можно выбрать 2–3 страны).*

40. Эмиссия ценных бумаг компаниями «второго» эшелона: возможности и риски.

41. Эмпирический анализ вклада финансового развития в повышение экономической эффективности и производительности *(на уровне стран, регионов, отраслей, групп компаний (по выбору))*.

42. Эмпирический анализ роли финансового рынка в формировании долгосрочных финансовых ресурсов для развития экономики.

Руководитель магистерской программы

«Анализ финансовых рынков», д.т.н., доцент С.А.Панова