

Аннотация дисциплины

Стохастические модели оценки рисков и производных финансовых инструментов

Рабочая программа дисциплины предназначена для студентов, обучающихся по направлению подготовки 38.04.01 «Экономика», направленность программы магистратуры «Финансовый анализ и оценка инвестиционных решений».

Цель дисциплины формирование у студентов, следующих компетенций:

ПКН-4 способность разрабатывать методики и оценивать эффективность экономических проектов с учетом факторов риска в условиях неопределенности.

Место дисциплины в структуре ООП - дисциплина «Стохастические модели оценки рисков и производных финансовых инструментов» является дисциплиной части, формируемой участниками образовательных отношений, модуля дисциплин по выбору, углубляющих освоение программы магистратуры направления 38.04.01 «Экономика».

Краткое содержание:

Основные понятия стохастической финансовой математики. Биномиальные модели эволюции цен на финансовых рынках. Стохастические процессы ценообразования на финансовых рынках и их математическое описание. Вычисление «стоимости под риском» (ValueAtRisk, VAR) для актива и для портфеля активов и проверка адекватности модели. Стохастические модели ценовой динамики. Прогнозирование рисков и корреляций. Показатели эффективности интегрированного управления рисками.