

## **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 ООП:**

Дисциплина «Финансовая математика» является дисциплиной обязательной части модуля математики и информатики (информационный модуль) по направлению подготовки бакалавриата 38.03.01 «Экономика», профиль «Учет, анализ и аудит».

#### **Краткое содержание:**

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.