

Аннотация дисциплины

«Стохастические методы финансовых расчетов»

Цель дисциплины:

Формирование следующих компетенций:

ПКН-3: Способность применять математические методы для решения стандартных профессиональных финансово-экономических задач, интерпретировать полученные математические результаты.

СК-2: Способность анализировать, обобщать и систематизировать информацию.

ПКП-2: Способность выбирать и использовать оптимальные методы и методики расчета финансовых показателей

Место дисциплины в структуре ОП:

Дисциплина «Стохастические методы финансовых расчетов» является дисциплиной по выбору студента, Блок №4 учебного плана, углубляющей освоение программы по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика».

Краткое содержание:

Основные понятия финансовой математики. Эффективные и номинальные процентные ставки. Потоки платежей. Бессрочные ренты. Портфельный анализ. Портфель Марковица. Выбор оптимального портфеля. Модели финансовых рынков. Вероятностно-статистические методы в техническом анализе финансовых рынков.