

Аннотация дисциплины

«Стохастические модели оценки рисков и производных финансовых инструментов»

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 дисциплины

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.