

Аннотация к рабочей программе дисциплине

Наименование дисциплины: Б1.В.ДВ.03.01 Моделирование финансовых рынков

Автор Левин В.С., профессор

Цель освоения дисциплины:

– овладеть методами построения различных моделей финансовых рынков, включая все этапы от формализации постановки задачи, с учетом существования определенных допущений и ограничений, до определения параметров модели и интерпретации полученных результатов.

1. Требования к результатам освоения дисциплины:

Индекс и содержание	Знания	Умения	Навыки и (или) опыт деятельности
ПК-23: способностью выявлять и проводить исследование финансово-экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов для разработки системы управления рисками	1 этап: методы построения основных моделей финансовых рынков и возможностей их использования в экономических приложениях; 2 этап: методики расчета параметров моделей на финансовых рынках	1 этап: разрабатывать модели управления рисками на финансовых рынках; 2 этап: разрабатывать методы и инструменты проведения финансово-экономических исследований, анализ полученных результатов; интерпретировать результаты моделирования	1 этап: современными концепциями и классификацией моделей, описывающих взаимосвязи на финансовых рынках; 2 этап: системным подходом при построении моделей финансовых рынков как с точки зрения выбора модели, так и с точки зрения процесса ее построения: задания цели модели, определения исходных ограничений, формализации, расчета параметров модели и определения области применения модели
ПК-24: способностью проводить исследование проблем финансовой устойчивости организаций, в том числе финансово-кредитных, для разработки эффективных методов ее обеспечения с учетом фактора	1 этап: особенности построения моделей, используемых на финансовых рынках; 2 этап: условия применения, допущения и ограничения каждой модели на финансовых рынках	1 этап: разрабатывать теоретические модели исследуемых процессов, явлений и объектов, оценивать и интерпретировать полученные результаты; 2 этап: свободно ориентироваться в информации, необходимой для построения моделей для анализа	1 этап: владеть навыками исследования проблем финансовой устойчивости организаций для разработки эффективных методов и моделей ее обеспечения с учетом фактора неопределенности; 2 этап: возможностями решения конкретных проблем финансовых рынков с помощью различных моделей и реализации сценарного

неопределенности		российского и зарубежных	подхода; широким спектром методов компьютерной обработки данных для построения моделей финансовых рынков и программных средств для реализации компьютерного моделирования
------------------	--	--------------------------	---

2. Содержание дисциплины:

Раздел 1 Классификация моделей на финансовых рынках

Тема 1 Классификация подходов, используемых в моделировании на финансовых рынках

Тема 2 Корреляционные и регрессионные модели на финансовых рынках

Тема 3 Оптимизационные модели

Раздел 2 Основные типы моделей на финансовых рынках

Тема 4 Равновесные модели

Тема 5 Факторные модели

Тема 6 Модель определения «стоимости под риском» (VAR-модель)

3. Общая трудоемкость дисциплины: 4 ЗЕ