

## АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ

**Автор:** В.С. Левин, профессор

**Наименование дисциплины:** Б1.В.ДВ.04.02 Моделирование финансовых рынков

**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 компетенции	Знания	Умения	Навыки и (или) опыт деятельности
ПК-18: способностью осуществлять разработку инструментов проведения исследований в области финансов и кредита, анализ их результатов, подготовку данных для составления финансовых обзоров, отчетов и научных публикаций	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 методы и инструменты проведения финансово-экономических исследований, анализ полученных результатов; 2 этап: 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-21: способностью выявлять и проводить исследование	1 этап: особенности построения моделей, используемых на	1 этап: разрабатывать теоретические модели исследуемых	1 этап: возможностями решения конкретных проблем финансовых

актуальных научных проблем в области финансов и кредита	финансовых рынках; 2 этап: условия применения, допущения и ограничения каждой модели на финансовых рынках	процессов, явлений и объектов, оценивать и интерпретировать полученные результаты; 2 этап: свободно ориентироваться в информации, необходимой для построения моделей для анализа российского и зарубежных финансовых рынков	рынков с помощью различных моделей и реализации сценарного подхода; 2 этап: 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: 3 ЗЕ**