

АННОТАЦИЯ  
ПО ДИСЦИПЛИНЕ Б1.В.ДВ.02.01  
«МОДЕЛИРОВАНИЕ ФИНАНСОВЫХ РЫНКОВ»

**Распределение трудоёмкости дисциплины по видам работ**

Дисциплина включает 2 зачетные единицы (72 часа, из них – 24 часа аудиторной нагрузки: лекционных 4 часа; практических 20 часов; ИКР 0,2 часа; 44 часа самостоятельной работы; контроль 3,8 часа; 24,2 часа контактной работы).

**ЦЕЛЬ дисциплины** – овладеть разработкой теоретических и новых эконометрических моделей исследуемых процессов, явлений и объектов, относящихся к сфере профессиональной финансовой деятельности в области финансов и кредита; оценивать и интерпретировать полученные в ходе исследования результаты.

**Задачи дисциплины:**

- сформировать системный подход при построении моделей финансовых рынков с позиции выбора модели и процесса ее построения;
- изучить основы теории моделирования экономических явлений и процессов;
- овладеть навыками микро- и макроэкономического моделирования финансовых и денежно-кредитных процессов с применением современного математического инструментария для решения конкретных задач в сфере финансовых и денежно-кредитных отношений;
- совершенствовать способность анализировать процессы, протекающие на мировых финансовых рынках;
- научиться применять современные программные продукты, необходимые для решения финансово-экономических задач и регулирования денежных и финансовых потоков.

**1.2 Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы**

Дисциплина относится к вариативной части Блока 1 учебного плана «Дисциплины (модули)» и предназначена для магистров, обучающихся по программе подготовки «Финансовый менеджмент», «Банки и банковская деятельность» направления «Финансы и кредит». Дисциплина читается в первом семестре второго курса.

Курс предполагает, что студентами уже изучены такие дисциплины, как «Финансовые рынки и финансово-кредитные институты», «Математическое обеспечение финансовых решений», «Финансовые и денежно-кредитные методы регулирования экономики» и др.

Знания, полученные в ходе изучения дисциплины, применяются в процессе изучения дисциплины «Инфокоммуникативное обеспечение денежно-кредитного рынка», «Управление финансами корпораций», «Инновации в банках» при написании магистерской диссертации и в последующей практической деятельности.

### 1.3 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Процесс изучения данной учебной дисциплины направлен на формирование у обучающихся следующих профессиональных компетенций: ПК20.

№ п. п	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	уметь	владеть
1.	ПК-20	способность осуществлять разработку теоретических и новых эконометрических моделей исследуемых процессов, явлений и объектов, относящихся к сфере профессиональной финансовой деятельности в области финансов и кредита, давать оценку и интерпретировать полученные в ходе исследования результаты	- основные результаты новейших исследований в области финансовой, монетарной теории, математического обеспечения финансовых решений, анализа финансовых рынков и финансовых институтов; - современные методы анализа финансовых и денежных рынков, математического обеспечения финансовых решений в посткризисный период; - современные программные продукты,	- применять современные программные продукты, необходимые для решения финансово-экономических задач и регулирования денежных и финансовых потоков; - применять и использовать современное программно-информационное обеспечение для решения финансово-экономических задач; - свободно ориентироваться в терминологии курса; уметь пояснить термины, встречающиеся в компендиуме и привести практические	- навыками микро- и макроэкономического моделирования финансовых и денежно-кредитных процессов с применением современного математического инструментария для решения конкретных задач в сфере финансовых и денежно-кредитных отношений; - способностью осуществлять разработку эконометрических моделей исследуемых процессов, явлений и объектов, относящихся к сфере профессиональной финансовой деятельности в области финансов и кредита.

№ п. п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	уметь	владеть
			необходимые для прогнозирования и решения экономических задач и регулирования денежных и финансовых потоков; - основы теории моделирования экономических явлений и процессов.	примеры явлений и процессов, имеющих место в деятельности финансовых институтов; - анализировать процессы, протекающие на мировых финансовых рынках; - давать оценку и интерпретировать полученные в ходе исследования результаты.	

### Структура дисциплины:

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины.

№ раздела	Наименование разделов	Количество часов			
		Всего	Аудиторная работа		Самостоятельная работа
			Л	ПЗ	
1	2	3	4	5	6
1.	Общая характеристика финансовых рынков и объектов инвестирования	15	1	4	10
2.	Основные подходы, используемые в моделировании на финансовых рынках: корреляционные и регрессионные модели	14	2	4	8
3.	Оптимизационные модели. Равновесные модели	15	1	4	10
4.	Факторные модели (модель Шарпа). Факторные модели (арбитражная модель ценообразования)	12	-	4	8
5.	Модель определения «стоимости под риском» (VAR-модель) Модели оценки волатильности актива	12	-	4	8
Итого по дисциплине			4	20	44

**Курсовые работы:** не предусмотрены

**Форма проведения аттестации по дисциплине:** зачет

**Основная литература:**

1. Гусева, И. А. Финансовые рынки и институты: учебник и практикум / И. А. Гусева. — М.: Издательство Юрайт, 2018. — 347 с. — (Серия: Академический курс). — ISBN 978-5-534-00339-0. — Режим доступа: [www.biblio-online.ru/book/B67C321B-4E55-4A91-9ED4-49BB2AFDD4E6](http://www.biblio-online.ru/book/B67C321B-4E55-4A91-9ED4-49BB2AFDD4E6).

2. Моделирование экономических процессов: учебник для студентов ВУЗов / под ред. М.В. Грачевой, Ю.Н. Черемных, Е.А. Тумановой. — 2-е изд., перераб. и доп. — М.: Юнити-Дана. 2015. — ISBN 978-5-5238-02329-8/ - Режим доступа: <http://biblioclub.ru/index/php?page=book&id=119452> (14.10.2018).

Автор – канд.экон.наук, доцент И.В. Рындина