

АННОТАЦИЯ УЧЕБНЫХ ДИСЦИПЛИН МАГИСТЕРСКОЙ ПРОГРАММЫ «ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ И ИНСТИТУТЫ»

«Финансовая математика и эконометрика»

ФИО преподавателя: Бардаева П.С., Черная А.

Входные требования для освоения дисциплины:

Эта дисциплина основана на знаниях, навыках и умениях, приобретенных в ходе изучения следующих дисциплин:

1. Макроэкономика и Микроэкономика (понимание основ функционирования экономических систем)
2. Управление организацией (понимания места риск-менеджмента в процессе управления организацией)
3. Финансовые рынки (понимание функционирования финансовых инструментов, их характеристик и фундаментальных параметров, методов торговли и торговых рынков, навыков расчета дюрации облигаций, цены опциона, дохода от опционной стратегии)
4. Статистика (понимание принципов изучения массовых явлений, знание методов построения и анализа основных статистических показателей, знание основных методов обработки и анализа данных, умение их использовать в профессиональной деятельности)
5. Эконометрика (систематические теоретические знания и практические навыки в области современных методов эконометрического моделирования и анализа социально-экономических процессов, позволяющие использовать их для количественного анализа реальных экономических явлений)
6. Линейная математика и математический анализ (знание основных понятий и методов линейной алгебры для расчета различных количественных характеристик в задачах)
7. Умение работать с большим объемом информации

Место дисциплины в учебном плане: по выбору, второй триместр

Краткое содержание дисциплины:

Тема 1. Распределения

Тема 2. Линейная регрессия. МНК. R²

Тема 3. Регрессия с единственным регрессором

Тема 4. Линейная регрессия с множественными регрессорами. Тесты гипотез и доверительные интервалы в множественной регрессии.

Тема 5. Характеристики циклов

Общая трудоемкость дисциплины: 3 зачетные единицы, 108 часов.

Итоговый контроль: Экзамен