

МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ АВТОНОМНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ ТРАНСПОРТА»
(РУТ (МИИТ))



Рабочая программа дисциплины (модуля),
как компонент образовательной программы
высшего образования - программы магистратуры
по направлению подготовки
01.04.02 Прикладная математика и информатика,
утвержденной первым проректором РУТ (МИИТ)
Тимониным В.С.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Элементы финансовой математики

Направление подготовки: 01.04.02 Прикладная математика и информатика

Направленность (профиль): Математическое моделирование сложных систем в экономике и технике

Форма обучения: Очная

Рабочая программа дисциплины (модуля) в виде электронного документа выгружена из единой корпоративной информационной системы управления университетом и соответствует оригиналу

Простая электронная подпись, выданная РУТ (МИИТ)
ID подписи: 5665
Подписал: заведующий кафедрой Нутович Вероника Евгеньевна
Дата: 10.06.2021

1. Общие сведения о дисциплине (модуле).

Работа магистра по направлению «Прикладная математика и информатика» заключается в создании математической модели исследуемого процесса, выборе метода решения задач, возникших в рамках созданной модели, проведении числовых расчетов и установлении адекватности математической модели реальному процессу.

Курс «Элементы финансовой математики» как раз и направлен на обучение студентов решению задач, возникающих в экономике, финансовой и банковской деятельности. Формализация задач и обучение студентов математическим методам максимизации доходности в экономике и финансовых операциях составляет предмет данной дисциплины. Теория полезности, динамическое программирование в приложениях к экономике, методы хеджирования и оптимальные портфели - основные разделы данного курса.

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю).

Перечень формируемых результатов освоения образовательной программы (компетенций) в результате обучения по дисциплине (модулю):

УК-2 - Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла.

Обучение по дисциплине (модулю) предполагает, что по его результатам обучающийся будет:

Уметь:

решать задачи, возникающие в экономике, финансовой и банковской деятельности;

Владеть:

современными теоретическими и методическими подходами функционирования институтов проектной экономики.

Знать:

основные модели, возникающие в финансовой математике

3. Объем дисциплины (модуля).

3.1. Общая трудоемкость дисциплины (модуля).

Общая трудоемкость дисциплины (модуля) составляет 5 з.е. (180 академических часа(ов)).

3.2. Объем дисциплины (модуля) в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении учебных занятий:

Тип учебных занятий	Количество часов	
	Всего	Семестр №3
Контактная работа при проведении учебных занятий (всего):	48	48
В том числе:		
Занятия лекционного типа	16	16
Занятия семинарского типа	32	32

3.3. Объем дисциплины (модуля) в форме самостоятельной работы обучающихся, а также в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении промежуточной аттестации составляет 132 академических часа (ов).

3.4. При обучении по индивидуальному учебному плану, в том числе при ускоренном обучении, объем дисциплины (модуля) может быть реализован полностью в форме самостоятельной работы обучающихся, а также в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении промежуточной аттестации.

4. Содержание дисциплины (модуля).

4.1. Занятия лекционного типа.

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
1	Основные инструменты финансовой математики. Рассматриваемые вопросы: - европейский опцион; - американский опцион.
2	Классическая финансовая математика Рассматриваемые вопросы: - теория цены и ренты; - волатильность цены и доходность.
3	Теория опционов Рассматриваемые вопросы: - биномиальная модель; - формула Блэка-Шоулса для оценки цены опциона.

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
4	<p>Биномиальная модель</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - биномиальная модель; - общая биномиальная модель; - основная теорема финансовой математики.
5	<p>Финансовые риски и пути их снижения</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - выбор оптимальных стратегий в соответствии с функцией полезности.
6	<p>Эффективные решения в условиях риска и неопределенности</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - процентные и инвестиционные риски; - риск облигаций и кредитные риски; - валютные риски.
7	<p>Инвестиционный портфель и его формирование</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - модель Марковица; - портфель Тобина; - оптимальный портфель как задача линейного программирования.
8	<p>Понятие портфеля</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - понятие портфеля; - одношаговая модель; - арбитражные и безарбитражные портфели; - условие безарбитражности; - мартингалы вероятности.

4.2. Занятия семинарского типа.

Практические занятия

№ п/п	Тематика практических занятий/краткое содержание
1	<p>Финансовые и процентные риски.</p> <p>В результате работы на практическом занятии обучающийся получает навык расчета финансовых и процентных рисков.</p>
2	<p>Валютные и биржевые риски.</p> <p>В результате работы на практическом занятии обучающийся получает навык расчета валютных и биржевых рисков.</p>
3	<p>Хеджирование Валютного риска.</p> <p>В результате работы на практическом занятии обучающийся получает навык хеджирования валютного риска.</p>
4	<p>Биномиальная модель. Формула Блэка-Шоулса для оценки цены опциона.</p> <p>В результате работы на практическом занятии обучающийся получает навык построения Биномиальной модели и оценки цены опциона, а также оценки с помощью формулы Блэка-Шоулса.</p>
5	<p>Оптимальные портфели акций в безрисковых и рискованных ситуациях. Максимизация дохода при заданном риске.</p> <p>В результате работы на практическом занятии обучающийся получает навык выбора оптимального портфеля акций в безрисковых и рискованных ситуациях, а также навык расчета максимизации дохода при заданном риске.</p>

4.3. Самостоятельная работа обучающихся.

№ п/п	Вид самостоятельной работы
1	Изучение учебной литературы
2	Подготовка к практическим занятиям
3	Выполнение курсовой работы.
4	Подготовка к промежуточной аттестации.
5	Подготовка к текущему контролю.

4.4. Примерный перечень тем курсовых работ

1. Классификация наблюдений для 2-х совокупностей с равными ковариационными матрицами.
2. Классификация наблюдений для 2-х совокупностей с различными ковариационными матрицами.
3. Классификация наблюдений для нескольких совокупностей.
4. Расстояние Махолонобиса и вероятности неправильной классификации.
5. Вероятности ошибок 1-го и 2-го рода. Лемма Неймана – Пирсона.
6. Задачи о средних значениях по лемме Неймана – Пирсона.
7. Распределение средств при различных функциях полезности.
8. Кластер – анализ и выделение групп по общей совокупности.
9. Оптимальный портфель акций. Портфель Марковица.
10. Опционы в финансовых операциях. Оптимальная цена опционов.

5. Перечень изданий, которые рекомендуется использовать при освоении дисциплины (модуля).

№ п/п	Библиографическое описание	Место доступа
1	Е. С. Вентцель Теория вероятностей. Издательский центр "Академия", 2005. - 459 с. - ISBN 5769510528 Книга	ИТБ УЛУПС (Абонемент ЮИ); ИТБ УЛУПС (ЧЗ1 ЮИ)
2	В.П. Маслов	https://knigogid.ru/books/1656492-kvantovaya-

	Квантовая экономика. Наука, 2006. - 90 с. - ISBN 5-02-035772-3 Книга	ekonomika/toread?ysclid=m3h7nttbd9917882556
3	В.В. Розен Математические модели принятия решений в экономике. - 2002. - 286 с. - ISBN 5-8013-0157-7 Учебное пособие	https://djvu.online/file/InxvHkeVcWYhX?ysclid=m3h7sqm1e9750204051
4	Т. Андерсон Введение в многомерный статистический анализ. - 2004. - 500 с.	НТБ РУТ (МИИТ)
5	А.С. Шапкин, В.А. Шапкин Введение в многомерный статистический анализ. - 2011. - 396 с. - ISBN 978-5-394-02610-2	НТБ РУТ (МИИТ)
6	Люу Ю-Д. Методы и алгоритмы финансовой математики. - 2007. - 751 с. - ISBN 978-5-94774-333-3	https://knigogid.ru/books/1957763-metody-i-algoritmy-finansovoy-matematiki/toread/page-715

6. Перечень современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем, которые могут использоваться при освоении дисциплины (модуля).

<http://library.miit.ru/> - электронно-библиотечная система Научно-технической библиотеки МИИТ.

<http://elibrary.ru/> - научно-электронная библиотека.

<http://www.consultant.ru> Поисковая система «Консультант Плюс».

Поисковые системы: Yandex, Google, Mail.

Библиотечный фонд РУТ(МИИТ).

7. Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства, необходимого для освоения дисциплины (модуля).

- ОС Windows;
- Microsoft Office;
- Интернет-браузер;
- Microsoft Teams и т.д..

8. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю).

Аудитория для проведения занятий лекционного типа должна быть оснащена персональным компьютером и набором демонстрационного оборудования.

Аудитория для проведения практических занятий должна быть оснащена персональными компьютерами.

9. Форма промежуточной аттестации:

Курсовая работа в 3 семестре.

Экзамен в 3 семестре.

10. Оценочные материалы.

Оценочные материалы, применяемые при проведении промежуточной аттестации, разрабатываются в соответствии с локальным нормативным актом РУТ (МИИТ).

Авторы:

Г.А. Зверкина

Согласовано:

Заведующий кафедрой ЦТУТП

В.Е. Нутович

Председатель учебно-методической
комиссии

Н.А.Клычева