|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Аннотация** | | |  |
| **Рабочей программы дисциплины** | | |  |
|  |  |  |  |
| Кафедра финансов, денежного обращения и кредита | | | |
| Дисциплина | | Финансовое моделирование | |
| Направление подготовки | | 38.04.08 Финансы и кредит | |
| Профиль | | Финансовые рынки и инвестиции | |
| Объем дисциплины | | 4 з.е | |
| Формы промежуточной аттестации | | Зачет с оценкой | |
| **Краткое** **содержание** **дисциплины** | | | |
| Тема | Наименование темы | | |
| Тема 1. | Финансовое моделирование: теоретическая основа и практика применения. | | |
| Тема 2. | Модель оценки активов на рынке капиталов. | | |
| Тема 3. | Модель портфельного инвестирования. | | |
| Тема 4. | Модель арбитражного ценообразования. | | |
| Тема 5. | Поведенческие модели на финансовом рынке | | |
|  |  |  |  |
| **Список** **литературы** | | | |
|  |  |  |  |
| **Основная литература:** | | | |
| 1. Вяткин В. Н., Гамза В. А., Маевский Ф. В. Риск-менеджмент [Электронный ресурс]:Учебник. - Москва: Издательство Юрайт, 2019. - 365 с. – Режим доступа: https://www.biblio- online.ru/bcode/432176 | | | |
| 2. Никитина Т. В., Репета-Турсунова А. В., Фрёммель М., Ядрин А. В. Основы портфельного инвестирования [Электронный ресурс]:Учебник. - Москва: Издательство Юрайт, 2019. - 195 с. – Режим доступа: https://www.biblio-online.ru/bcode/436994 | | | |
| 3. Шарп У.Ф., Александер Г. Д. Инвестиции. [Электронный ресурс]:Учебник. - Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2020. - 1040 с. – Режим доступа: https://znanium.com/catalog/product/1080428 | | | |
| 4. Шарп У.Ф., Александер Г. Д. Инвестиции. [Электронный ресурс]:Учебник. - Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2021. - 1040 – Режим доступа: https://znanium.com/catalog/product/1149645 | | | |
| 5. Татьянников В. А., Татьянников В. А. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс]:учебник для обучающихся вузов по направлениям подготовки УГСН 38.00.00 "Экономика и управление". - Екатеринбург: Издательство Уральского университета, 2019. - 495 – Режим доступа: http://lib.usue.ru/resource/limit/ump/20/p492906.pdf | | | |
| 6. Шиловская Н. А. Финансовая математика. [Электронный ресурс]:учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры. - Москва: Юрайт, 2019. - 176 – Режим доступа: https://urait.ru/bcode/434037 | | | |
| **Дополнительная литература:** | | | |
| 2. Ибрагимов Р. Г. Корпоративные финансы. Финансовые решения и ценность фирмы [Электронный ресурс]:Учебное пособие. - Москва: Издательство Юрайт, 2019. - 184 – Режим доступа: https://www.biblio-online.ru/bcode/434240 | | | |

|  |
| --- |
| 3. Решетников А. И., Решетникова Т. В., Татьянников В. А., Чилимова Т. А. Участники, инструменты, технологии инвестирования на фондовом рынке [Электронный ресурс]:учебное пособие. - Екатеринбург: [Издательство УрГЭУ], 2017. - 132 с. – Режим доступа: http://lib.usue.ru/resource/limit/ump/18/p490470.pdf |
| 4. Грибов А. Ф. Моделирование финансовой деятельности:учебное пособие для студентов, обучающихся по направлению "Экономика". - Москва: КноРус, 2019. - 374 с. |
| 5. Юзвович Л. И., Юзвович Л. И. Финансовые и банковские риски [Электронный ресурс]:учебник для обучающихся в вузах по направлениям подготовки УГСН 38.00.00 "Экономика и управление". - Екатеринбург: Издательство Уральского университета, 2020. - 334 – Режим доступа: http://lib.wbstatic.usue.ru/resource/limit/ump/21/p493489.pdf |
|  |
| **Перечень** **информационных** **технологий,** **включая** **перечень** **лицензионного** **программного** **обеспечения** **и** **информационных** **справочных** **систем,**  **онлайн** **курсов,** **используемых** **при** **осуществлении** **образовательного** **процесса** **по** **дисциплине** |
| **Перечень лицензионного программного обеспечения:** |
|  |
| Astra Linux Common Edition. Договор № 1 от 13 июня 2018, акт от 17 декабря 2018. Срок действия лицензии - без ограничения срока. |
| МойОфис стандартный. Соглашение № СК-281 от 7 июня 2017. Дата заключения - 07.06.2017. Срок действия лицензии - без ограничения срока. |
| **Перечень информационных справочных систем, ресурсов информационно- телекоммуникационной сети «Интернет»:** |
| Справочно-правовая система Консультант +. Договор № 163/223-У/2020 от 14.12.2020. Срок действия лицензии до 31.12.2021 |
| Справочно-правовая система Гарант. Договор № 58419 от 22 декабря 2015. Срок действия лицензии -без ограничения срока |
| Аннотацию подготовил: Татьянников Василий Аркадьевич |