

Аннотация дисциплины
«Стохастический анализ финансовых рынков»

Цели дисциплины :

- 1) изучение основных закономерностей финансового рынка;
- 2) построение стохастических моделей;
- 3) анализ и использование реальных данных.

Для достижения поставленных целей в процессе обучения студентов ставятся следующие задачи:

- 1) изучить основные закономерности на финансовых рынках;
- 2) сформировать умение применять теоретические знания при решении конкретных задач оценки финансовых показателей;
- 3) выработать навыки применения статистических методов обработки данных.

Краткое содержание.

Основные понятия теории финансов, находящие применение в стохастических финансовых моделях. Однопериодные биномиальные модели эволюции цен. Многопериодные биномиальные модели эволюции цен. Стохастические процессы и броуновское движение. Предпосылки, лежащие в основе модели Блека-Шоулза. Модель Блека-Шоулза и ее применение. Количественные характеристики и схемы оценки рисков в условиях неопределенности.