

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Романчук Иван Сергеевич
Должность: Ректор
Дата подписания: 30.04.2025 14:56:43
Уникальный программный ключ:
6319edc2b582ffdacea443f01d5779368d0957ac34f5cd074d81181530452479

Приложение к рабочей
программе дисциплины

МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ
ПО ОРГАНИЗАЦИИ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ ОБУЧАЮЩИХСЯ

Наименование дисциплины	<i>Количественные финансы</i>
Направление подготовки / Специальность	<i>38.04.01 «Экономика»</i>
Направленность (профиль) / Специализация	<i>Финансовая экономика (Финансомика) ОП ВО (магистратура)</i>
Форма обучения	<i>заочная</i>
Разработчик	<i>Решетникова Л.Г., доцент кафедры экономики и финансов Болдырева Н.Б., профессор кафедры экономики и финансы</i>

1. Темы дисциплины для самостоятельного освоения обучающимися
Отсутствуют

2. План самостоятельной работы

№ п/п	Учебные встречи	Виды самостоятельной работы	Форма отчетности / контроля	Количество баллов	Рекомендуемый бюджет времени на выполнение (в ак. ч.)
1	Оценка эффективности финансовых операций	Подготовка к практическим занятиям	Выполнение заданий на учебной встрече	-	8
2	Модели ценообразования финансовых активов	Подготовка к практическим занятиям	Выполнение заданий на учебной встрече.	-	10
		Выполнение расчетного задания	Результаты тестирования. Расчетное задание	15	52
3	Подготовка к зачету	Изучение материалов дисциплины по вопросам к зачету	-	-	18
	Итого			15	88

3. Требования и рекомендации по выполнению самостоятельной работы обучающихся, критерии оценивания

Вид: подготовка к практическим занятиям.

Краткая характеристика – в ходе подготовки к практическим занятиям рекомендуется изучить материал лекции, основную литературу, ознакомиться с дополнительной литературой, при необходимости использовать информационные ресурсы, рекомендованные рабочей программой дисциплины.

Вид: выполнение расчетного задания «Ценообразование финансовых инструментов с фиксированным доходом».

Краткая характеристика – проанализируйте, используя инструмент MS Excel, ценообразование финансовых инструментов с фиксированным доходом.

Рекомендации к порядку выполнения задания и структуре отчета:

- ✓ изучите лекционные материалы и дополнительный материал: учебник «Современный финансовый рынок» (<https://urait.ru/book/sovremennyu-finansovyyu-rynok-557258>), тему 5 «Рынок ценных бумаг».

Пройдите тестирование по изученной теме (сохраните отчет о результатах тестирования);

- ✓ сформулируйте цель исследования.
- ✓ аккумулируйте данные, необходимые для анализа,

- ✓ рассчитайте показатели, необходимые для анализа ценообразования финансовых инструментов с фиксированным доходом, используя инструмент MS Excel;
- ✓ обобщите полученные результаты и сделайте выводы по расчетному заданию.

Критерии и баллы

Критерии оценивания	Количество баллов
Максимальный балл по тесту «Рынок ценных бумаг»	5
Целостный исследовательский расчетный продукт, выполненный в Excel	5
Корректность и логичность комментариев и выводов	5

4. Рекомендации по самоподготовке к промежуточной аттестации по дисциплине

Примерный перечень вопросов для самопроверки:

1. Гипотеза временной ценности денег. Понятийный инструментальный финансовый вычислений.
2. Операции с простыми процентными ставками.
3. Операции со сложными процентными ставками. Непрерывное наращение и дисконтирование.
4. Принятие инвестиционных решений в условиях инфляции.
5. Влияние налогообложения на доходность финансовых операций.
6. Понятие и виды финансовой ренты. Обобщающие характеристики финансовой ренты.
7. Нарощенная сумма годовой и р-срочной финансов рент. Современная величина годовой и р-срочной финансов рент.
8. Нарощенная сумма и современная величина вечной ренты и ренты пренумерандо.
9. Оценка доходности ссудных операций с удержанием комиссионных.
10. Рыночный риск актива и его собственный риск.
11. Меры риска актива.
12. Концепция VaR.
13. Оценка эффективности портфельного менеджмента.
14. DCF – модель. Типовые задачи, решаемые на основе DCF-модели.
15. Оценка ценных бумаг с фиксированным доходом.
16. Дюрация облигации. Модифицированная дюрация и ее практическое значение.
17. Модели оценки акций.
18. Фундаментальные показатели акций.
19. Портфельная теория: основные результаты и ограничения в применении.
20. Выбор оптимального портфеля из эффективного множества портфелей в модели Г. Марковица
21. Влияние безрискового заимствования и кредитования на эффективное множество и выбор оптимального портфеля.
22. CAPM: основные результаты и ограничения в применении. Коэффициент бета акции.
23. Линия рынка капитала (CML): уравнение, экономическая интерпретация.
24. Линия рынка ценных бумаг (SML): уравнение, экономическая интерпретация.
25. Сравнение характеристик линии рынка капитала(CML) и линии рынка ценных бумаг (SML).
26. CAPM. Альтернативные модели CAPM.
27. Понятие производного финансового инструмента. Виды ПФИ.
28. Модель Блэка – Шоулза для оценки стоимости опциона.
29. Оценка рисков в операциях с опционами.

30. Ценообразование форвардных и фьючерсных контрактов.