



Национальный исследовательский университет «Высшая школа экономики»
Программа дисциплины «Количественные методы, статистика и финансовая математика» дополнительной профессиональной программы для получения дополнительной квалификации «Мастер делового администрирования - Master of Business Administration (MBA)», специализация «MBA - финансы и банки», «MBA – управление инвестициями»

«Количественные методы, статистика и финансовая математика»

Цели освоения дисциплины

Целями освоения дисциплины «Количественные методы, статистика и финансовая математика» являются:

- подготовка специалистов, владеющих современной методологией статистической оценки и анализа рыночной экономики;
- формирование у будущих специалистов твердых теоретических знаний и практических навыков финансово-экономических расчетов, позволяющих эффективно осуществлять инвестиционную деятельность и управлять финансами.

Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины

В результате освоения дисциплины студент должен:

Знать

- основные термины и понятия финансовой математики;
- теоретические основы финансовых расчетов;
- сущность и причины дисконтирования;
- основные понятия теории вероятностей и математической статистики;
- цели и сущность статистических исследований.

Уметь

- проводить расчеты, как вручную, так и с помощью табличного процессора EXCEL, для нахождения приведенной стоимости потока платежей;
- оценивать основные статистические характеристики финансовых данных;
- проводить оценку стоимости ценных бумаг.

Иметь

- практические навыки по решению задач, излагаемых в смежных курсах;
- навыки производить обработку статистической информации, использовать алгоритмы оценивания и проверки гипотез для принятия управленческих решений на изменчивых данных.

Основные положения дисциплины должны быть использованы в дальнейшем при изучении следующих дисциплин: "Корпоративный финансовый менеджмент", "Инвестиционный анализ", "Рынок акций и облигаций", "Финансовые рынки".

Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

1.1. Основная литература

1. Четыркин Е.М. Методы финансовых и коммерческих расчетов. Изд 2-е, доп. М.: Дело Лтд., 1995.
2. Мицкевич А.А., Финансовая математика, Москва: Олма-Пресс, 2003.
3. Ковалев В.В. Сборник задач по финансовому анализу: учебное пособие, М.: ФИНАНСЫ И СТАТИСТИКА, 1997.
4. Капитоненко В.В. Задачи и тесты по финансовой математике. М., «Финансы и статистика», 2007
5. Харченко Л.П., Долженкова В.Г., Ионин В.Г. и др., Статистика. «ИНФРА-М», 2006.
6. Тюрин Ю.Н., Макаров А.А. Анализ данных на компьютере, М.: ИД «ФОРУМ», 2008.

1.2. Дополнительная литература

1. Брейли, Майерс, Принципы корпоративных финансов, Москва: Олимп-Бизнес, 1997.
2. Кочович Е. Финансовая математика: Теория и практика финансово-банковских расчетов: Пер. с серб. Предисл. Е.М. Четыркина. - М.: Финансы и статистика, 1994. 268 с.

3. Овчаренко Е.К., Ильина О.П., Балыбердин Е.В. Финансово-экономические расчеты в Excel. Изд 2-е, доп. - М.: Информационно-издательский дом "Филинь", 1998. - 184 с.
4. Четыркин Е.М. Финансовый анализ производственных инвестиций. – М.: Дело; 1998. – 256 с.
5. Беренс В., Хавронек П.М. Руководство по оценке эффективности инвестиций. Метод ЮНИДО. Инфра. – М.: 1995.
6. Бирман Г., Шмидт С. Экономический анализ инвестиционных проектов. – М.: Банки и биржа, 1997.
7. Экономическая статистика: Учебник / Под ред. Ю.Н. Иванова. – М.: ИНФРА-М, 1998.

1.3. Справочники, словари, энциклопедии

1.4. Программные средства

Для успешного освоения дисциплины, слушатель использует следующие программные средства:

- EXCEL

1.5. Дистанционная поддержка дисциплины

Материально-техническое обеспечение дисциплины

В процессе обучения используется:

- компьютерное и мультимедийное оборудование;
- EXCEL;
- Методическое пособие «Материалы по курсу «Количественные методы, статистика, финансовая математика»» автора программы, размещаемое на сайте Банковского института.