

Титульный лист
методических рекомендаций
и указаний, методических
рекомендаций,
методических указаний



Форма
Ф СО ПГУ 7.18.3/40

Министерство образования и науки Республики Казахстан
Павлодарский государственный университет им. С. Торайгырова
Кафедра «Математика»

МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ И УКАЗАНИЯ

дисциплины «Методы оценки финансовых рисков»

для магистрантов специальности 5В060200 «Математика»

Павлодар

Лист утверждения
методических рекомендаций
и указаний, методических
рекомендаций,
методических указаний



Форма
Ф СО ПГУ 7.18.3/41

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по УР
_____ Н.Э. Пфейфер
«___» _____ 20__ г

Составитель: к.ф.-м.н. профессор ПГУ _____ Ахметов Г.Б.

Кафедра «Математика»

Методические рекомендации и указания по изучению дисциплины

по дисциплине «Методы оценки финансовых рисков»

для магистрантов специальности 5В060200 «Математика»

Рекомендовано на заседании кафедры
«___» _____ 20__ г. Протокол № _____

Заведующий кафедрой _____ М.Е. Исин «___» _____ 20__ г.

Одобрено учебно-методическим советом факультета «Физика, математика и
информационные технологии»
«___» _____ 20__ г. Протокол № _____

Председатель УМС _____ А.Б. Исакова «___» _____ 20__ г.

ОДОБРЕНО УМО
Начальник УМО _____ Е.Н. Жаманкулова «___» _____
20__ г.

Одобрено учебно-методическим советом университета
«___» _____ 20__ г. Протокол № _____

**Методические рекомендации и указания по изучению дисциплины
«Методы оценки финансовых рисков»**

»

В процессе изучения каждой темы следует выполнить упражнения, предложенные в конце каждой главы учебника [1] и законспектировать указанные параграфы из [5]. Для проведения практических занятий использовать сборник задач [4].

№ темы	Содержание темы	Неделя	Рекомендации	Литература	
				лекц.	практ.
1	Характеристика финансового рынка и его моделирование. Классификация и характеристика финансовых рынков.	1	Прочитать лекции. Запомнить основные определения	[1] гл. 1 [3] гл.1	Вопросы для самопроверки
2	Структурные изменения финансовых процессов и причины их возникновения	2	Прочитать лекции. Запомнить основные определения	[3] гл. 1 §1.2	Вопросы для самопроверки
3	Моделирование как основной инструмент исследования финансовых рынков. Отличительные черты финансового рынка и его прогнозирование	3	Прочитать лекции.	[3] гл. 1 §1.3	Вопросы для самопроверки
		4	Прочитать лекции.	[3] гл. 1 §1.4	Вопросы для самопроверки
4	Оценка и анализ финансовых рисков Общеметодические подходы к количественной оценке риска.	5	Прочитать лекции.	[3] гл. 5, §5.1	Вопросы для самопроверки
		6	Прочитать лекции. Законспектировать	[3] гл. 5, §5.1	Вопросы для самопроверки
5	Задачи формирования портфелей ценных бумаг. Формирование оптимального портфеля по методу Марковица. Многофакторные модели	7	Прочитать лекции. Решить задачи	[3] гл. 5, §5,2	Вопросы для самопроверки
		8	Прочитать лекции. Запомнить виды моделей	[3] гл. 5, §5.3	Вопросы для самопроверки
6	Оценки инвестиционных проектов и инвестиционных доходов.	9	Прочитать лекции.		Вопросы для самопроверки

	Моделирование инвестиционных процессов	10	Прочитать лекции. Законспектировать инвестиционных процессов		Вопросы для самопроверки
7	Модели операций с ценными бумагами.	11	Прочитать лекции.	[2] §17.6.1	Вопросы для самопроверки
	Облигации. Облигации без выплаты процентов	12	Прочитать лекции.	[2] гл. 17.6.2	Вопросы для самопроверки
8	Облигации с выплатой процентов в конце срока погашения. Акции	13	Прочитать лекции. Запомнить отличие облигации и акции	[2] гл. 17.6.4	Вопросы для самопроверки
9	Теория стохастических процессов. Процесс Пуассона.	13	Прочитать лекции. Решить задачи	[4] гл.4§1	№165,168,171,173,180.
10	Процессы гибели и размножения.Страхование жизни	14	Прочитать лекции. Запомнить общие понятия и определения	[2] гл. 17.7.2	Вопросы для самопроверки
11	Проверка гипотезы о значимости выборочного коэффициента ранговой корреляции Спирмена и Кендалла.	14	Прочитать лекции. Решить задачи	[4] гл. 13. §13и §14.	№№618-622.
12	Оценка качества построенной модели.Экспертные оценки в прогнозе количественных показателей	15	Прочитать лекции. Запомнить основные понятия	[1] гл. 5 §1,2	

ЛИТЕРАТУРА

Основная

1. Ф.К. Баяхметова «Қаржылық математика», оқу құралы, Кереку, 2010 ж.
2. Красс М.С., Чупрынов Б.П. Математические методы и модели для магистрантов экономики: Учебное пособие.-СПб.:Питер,2006.- 496с.

Дополнительная

3. Финансовая математика. Под редакцией В.А. Половникова и А.И. Пилипенко – М.; Вузовский учебник, 2004, - 360 с.
4. Гмурман В.Е. Руководство к решению задач по теории вероятностей и математической статистике.-М.: «Высшая школа», 2005,- 406с.