



Воронежский
государственный
университет
1918

Экономический факультет

Магистерская программа

Количественный анализ финансовых рынков

Направление подготовки:

38.04.01 Экономика

Выпускающая кафедра:

информационных технологий и
математических методов в экономике

Формы обучения:

- очная (2 года);
- очно-заочная (2,5 года);
- заочная (2,5 года)

Соответствие профессиональным стандартам:

- 08.008 Специалист по финансовому консультированию;
- 08.022 Статистик;
- 08.037 Бизнес-аналитик

Руководитель программы



Щепина

Ирина Наумовна,
д-р экон. наук, доц.

Стратегические партнеры

- Центральный экономико-математический институт РАН
- Институт системного анализа РАН
- Институт проблем управления
- НИУ Высшая Школа Экономики
- Российская экономическая школа
- МГУ им. М. В. Ломоносова

Описание программы

Программа ориентирована на подготовку высококвалифицированных специалистов в области финансового консультирования по широкому спектру финансовых услуг, экономико-математического моделирования и анализа бизнес-процессов. Основное внимание уделяется статистической обработке данных, математическому и эконометрическому моделированию финансовых рынков, инструментальным средствам поддержки принятия решений в условиях неопределенности, управлению рисками на фондовом рынке.

Компетенции и преимущества выпускников

- проведение портфельного анализа инвестиционных возможностей на фондовом рынке
- разработка финансового плана для клиента, в т. ч. отбор финансовых инструментов по критериям доходности и риска
- определение критериев мониторинга эффективности портфеля клиента
- анализ подверженности портфеля клиента внешним и внутренним факторам риска факторам риска
- статистический анализ числовой и нечисловой информации
- разработка направлений стратегического развития организации

Перспективы трудоустройства

Выпускники востребованы в организациях как финансового сектора экономики, включая инвестиционные и страховые компании, кредитные учреждения, так и в организациях реального сектора, включая IT-компании и консалтинговые агентства. Выпускники работают в крупных компаниях, такие как Сбербанк, ВТБ, Netcracker, ConVista Consulting AG, ЭФКО, Дом РФ, занимают руководящие должности в органах государственного управления и преподают в отечественных и зарубежных ВУЗах.

Ключевые дисциплины

Эконометрическое моделирование

- Эконометрика в экономических исследованиях
- Статистические свойства МНК-оценок
- Исследование структурной устойчивости коэффициентов регрессии
- Мультиколлинеарность
- Гетероскедастичность
- Автокорреляция
- Метод максимального правдоподобия

Теория финансовых рынков

- Сущность, структура и инфраструктура финансового рынка
- Профессиональные участники финансовых рынков
- Нормативно-правовое регулирование операций с финансовыми инструментами
- Финансовые инструменты и их классификация
- Основные гипотезы функционирования фондового рынка

Портфельный анализ

- Управление портфелем облигаций
- Дюрация, изгиб облигации
- Современная теория портфеля
- Граница эффективных портфелей Г. Марковица
- Анализ ценовых аномалий на фондовом рынке

Управление рисками

- Структура и факторы рисков
- Методология управление рисками
- Организационные механизмы управления риском
- Система показателей риска и совершенствование методов их расчета
- Эконометрические методы оценивания рыночного риска и премии за риск

1 курс

На первом году обучения в магистратуре Вы будете осваивать иностранный язык делового и профессионального общения, микро- и макроэкономику, инструменты и методы эконометрического моделирования и системного анализа экономических процессов, инструментальные средства экономического анализа, коммуникативные технологии профессионального общения и организационные коммуникации.

Сможете изучить теорию финансовых рынков, финансовую и актуарную математику, методы интеллектуального анализа данных и методы принятия решений в условиях неопределенности.

2 курс

На втором курсе Вы будете изучать математические методы и инструментальные средства поддержки принятия решений, методологию и технологии проектирования информационных систем, финансовую эконометрику, управление рисками, производные финансовые инструменты и их оценку, международные стандарты финансовой отчетности, методики и инструментарий финансового планирования, макроэкономику финансовых рынков, портфельный анализ, технический и фундаментальный анализом, анализ и оценку инвестиционных проектов.

Выпускающая кафедра

- Осуществляет научно-исследовательскую деятельность в рамках совместной лаборатории ВГУ и ЦЭМИ РАН по Системному моделированию социально-экономических процессов
- Ежегодно проводит 3 международных конференции
- При кафедре существует журнал «Современная экономика: проблемы и решения», входящий в перечень ВАК
- Кафедра осуществляет подготовку кадров высшей квалификации по программе аспирантуры направления «Экономика»

Контакты

ул. Хользунова 42В, ауд. 308 Б
itmmevsu@gmail.com
+7 473 228 11 60 доб. 5116

