

# **Введение в математику финансов, часть 2**

**Андрей Валерьевич Селиванов**

**9-11 класс**

Вторая часть спецкурса будет посвящена непосредственно финансовым задачам с точки зрения математики:

1. **Оптимальное размещение ресурсов** (теория CAPM): какие активы и какие доли вложений дают оптимальное соотношение прибыльность-риск? Как связан портфель инвестора со структурой рынка?
2. **Определение цен финансовых инструментов** (теория арбитража): сколько стоит опцион, дающий право покупки акции по заданной цене?
3. **Измерение риска финансовых позиций**: как измерить риск портфеля и нужно ли его снижать? Бывают ли «чёрные лебеди» и что с ними делать?

Первая часть спецкурса была посвящена простейшим моделям финансовых рынков и введению в теорию вероятностей, играющую важную роль в решении финансовых задач. Знание начал теории вероятностей облегчит восприятие математики, лежащей в основе рассуждений, однако не является необходимым для понимания сути и интерпретации решений рассматриваемых задач.

Время проведения спецкурса: один из будней с 19:00.

О лекторе: к.ф.-м.н., FRM. С 2008 г. работаю в Управлении по рискам ООО «Газпром экспорт», до 2014 г. – старший преподаватель кафедры теории вероятностей механико-математического факультета МГУ им. М.В. Ломоносова.

**Пробное занятие – 13 января, 19:00 , каб.**