

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ  
Федеральное государственное автономное учреждение  
высшего профессионального образования  
"Казанский (Приволжский) федеральный университет"  
Институт вычислительной математики и информационных технологий



подписано электронно-цифровой подписью

**Программа дисциплины**  
**Финансовая статистика Б2.ДВ.3**

Направление подготовки: 010300.62 - Фундаментальная информатика и информационные технологии

Профиль подготовки: Системный анализ и информационные технологии

Квалификация выпускника: бакалавр

Форма обучения: очное

Язык обучения: русский

**Автор(ы):**

Халиуллин С.Г.

**Рецензент(ы):**

Гумеров Р.Н.

**СОГЛАСОВАНО:**

Заведующий(ая) кафедрой: Турилова Е. А.

Протокол заседания кафедры No \_\_\_\_ от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 201\_\_ г

Учебно-методическая комиссия Института вычислительной математики и информационных технологий:

Протокол заседания УМК No \_\_\_\_ от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 201\_\_ г

Регистрационный No 918214

Казань  
2014

## Содержание

1. Цели освоения дисциплины
2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы
3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля
4. Структура и содержание дисциплины/ модуля
5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения
6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов
7. Литература
8. Интернет-ресурсы
9. Материально-техническое обеспечение дисциплины/модуля согласно утвержденному учебному плану

Программу дисциплины разработал(а)(и) доцент, к.н. (доцент) Халиуллин С.Г. кафедры математической статистики отделение прикладной математики и информатики ,  
Samig.Haliullin@kpfu.ru

### **1. Цели освоения дисциплины**

Целями освоения дисциплины "Волатильность финансового рынка" являются: формирование математической культуры студентов, развитие системного математического мышления, применение математических методов в теории финансов. Дисциплина предполагает углубленное изучение методов исследования различных процессов, в частности, применение идей теории мартингалов и случайных процессов.

Знания, практические навыки, полученные при освоении дисциплины "Волатильность финансового рынка" используются обучаемыми при изучении профессиональных дисциплин, а также при выполнении курсовых и дипломных работ.

Задачи, решение которых обеспечивает достижение цели:

1. формирование понимания значимости математической составляющей в естественно-научном образовании бакалавра;
2. ознакомление системы понятий, используемых для описания важнейших математических моделей и математических методов в их взаимосвязи;
3. формирование навыков и умений использования современных математических моделей и методов.

### **2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы высшего профессионального образования**

Данная учебная дисциплина включена в раздел " Б2.ДВ.3 Общепрофессиональный" основной образовательной программы 010300.62 Фундаментальная информатика и информационные технологии и относится к дисциплинам по выбору. Осваивается на 2 курсе, 4 семестр.

Дисциплина "Волатильность финансового рынка" входит в вариативную часть профессионального цикла подготовки бакалавра по направлению "010400.62 Прикладная математика и информатика" и является разделом Б3.В.7 ООП.

Логическая и содержательно-методическая взаимосвязь с другими дисциплинами и частями ООП выражается в следующем.

Для освоения дисциплины используются знания, умения и виды деятельности, сформированные в процессе изучения предметов "Теория вероятностей и математическая статистика", "Теория случайных процессов", "Теория мартингалов", "Статистика случайных процессов".

Требования к входным знаниям и умениям студента - знание идей и методов теории вероятностей, математического и последовательного анализа, математической статистики.

Знания и умения, формируемые в процессе изучения дисциплины "Волатильность финансового рынка" будут использоваться в дальнейшей практической работе выпускников.

Дисциплина изучается на 4 курсе обучения.

### **3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля**

В результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции:

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ПК-1 (профессиональные компетенции)	способность применять в профессиональной деятельности современные языки программирования и языки баз данных, методологии системной инженерии, системы автоматизации проектирования, электронные библиотеки и коллекции, сетевые технологии, библиотеки и пакеты программ, современные профессиональные стандарты информационных технологий (в соответствии с профилизацией)
ПК-3 (профессиональные компетенции)	способность разрабатывать и реализовывать процессы жизненного цикла информационных систем, программного обеспечения, сервисов систем информационных технологий, а также методы и механизмы оценки и анализа функционирования средств и систем информационных технологий; способность разработки проектной и программной документации, удовлетворяющей нормативным требованиям

В результате освоения дисциплины студент:

1. должен знать:

1) В области научно-исследовательской деятельности:

(ПК-1) способность демонстрации общенаучных базовых знаний естественных наук, математики и информатики, понимание основных фактов, концепций, принципов теорий, связанных с прикладной математикой и информатикой;

(ПК-2) способность приобретать новые научные и профессиональные знания, используя современные образовательные и информационные технологии;

2. должен уметь:

2) В проектной и производственно-технологической деятельности:

(ПК-6) способностью осуществлять целенаправленный поиск информации о новейших научных и технологических достижениях в сети Интернет и из других источников;

(ПК-8) способность формировать суждения о значении и последствиях своей профессиональной деятельности с учетом социальных, профессиональных и этических позиций;

3. должен владеть:

3) В организационно-управленческой деятельности:

(ПК-9) способность приобретать и использовать организационно-управленческие навыки в профессиональной и социальной деятельности;

4. должен демонстрировать способность и готовность:

В результате освоения дисциплины обучающийся должен демонстрировать способность и готовность применять на практике основные методы стохастического анализа.

#### 4. Структура и содержание дисциплины/ модуля

Общая трудоемкость дисциплины составляет 4 зачетных(ые) единиц(ы) 144 часа(ов).

Форма промежуточного контроля дисциплины экзамен в 4 семестре.

Суммарно по дисциплине можно получить 100 баллов, из них текущая работа оценивается в 50 баллов, итоговая форма контроля - в 50 баллов. Минимальное количество для допуска к зачету 28 баллов.

86 баллов и более - "отлично" (отл.);

71-85 баллов - "хорошо" (хор.);

55-70 баллов - "удовлетворительно" (удов.);

54 балла и менее - "неудовлетворительно" (неуд.).

#### 4.1 Структура и содержание аудиторной работы по дисциплине/ модулю Тематический план дисциплины/модуля

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
1.	Тема 1. Гауссовские системы.	4	1-2	0	10	0	домашнее задание
2.	Тема 2. Необходимые сведения из теории мартингалов.	4	3-4	0	10	0	домашнее задание
3.	Тема 3. Гауссовские и условно-гауссовские модели.	4	4-5	0	10	0	домашнее задание
4.	Тема 4. Нелинейные стохастические условно-гауссовские модели.	4	6-7	0	10	0	домашнее задание
5.	Тема 5. Критерий для проверки гипотезы волатильности.	4	9-10	0	11	0	контрольная работа
	Тема . Итоговая форма контроля	4		0	0	0	экзамен
	Итого			0	51	0	

#### 4.2 Содержание дисциплины

##### Тема 1. Гауссовские системы.

###### *практическое занятие (10 часа(ов)):*

Признаки нормальности данных: куртозис, коэффициент асимметрии, вероятность попадания в заданный интервал.

##### Тема 2. Необходимые сведения из теории мартингалов.

###### *практическое занятие (10 часа(ов)):*

Характеризация конечных мартингалов. Теорема Дуба о разложении субмартингала.

##### Тема 3. Гауссовские и условно-гауссовские модели.

###### *практическое занятие (10 часа(ов)):*

Оценка параметров нелинейных моделей.

##### Тема 4. Нелинейные стохастические условно-гауссовские модели.

###### *практическое занятие (10 часа(ов)):*

Проблема оценки волатильности.

## Тема 5. Критерий для проверки гипотезы волатильности.

### практическое занятие (11 часа(ов)):

Построение критерия для проверки гипотезы однородности дисперсий.

### 4.3 Структура и содержание самостоятельной работы дисциплины (модуля)

N	Раздел Дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудоемкость (в часах)	Формы контроля самостоятельной работы
1.	Тема 1. Гауссовские системы.	4	1-2	подготовка домашнего задания	7	домашнее задание
2.	Тема 2. Необходимые сведения из теории мартингалов.	4	3-4	подготовка домашнего задания	8	домашнее задание
3.	Тема 3. Гауссовские и условно-гауссовские модели.	4	4-5	подготовка домашнего задания	8	домашнее задание
4.	Тема 4. Нелинейные стохастические условно-гауссовские модели.	4	6-7	подготовка домашнего задания	8	домашнее задание
5.	Тема 5. Критерий для проверки гипотезы волатильности.	4	9-10	подготовка к контрольной работе	8	контрольная работа
	Итого				39	

## 5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения

Образовательные технологии

Чтение лекций по данной дисциплине проводится традиционным способом.

Студентам предоставляется возможность для самоподготовки и подготовки к экзамену использовать электронный вариант конспекта лекций, подготовленный преподавателем в соответствии с планом лекций.

При работе используется диалоговая форма ведения лекций с постановкой и решением проблемных задач, обсуждением дискуссионных моментов и т.д.

При проведении практических занятий создаются условия для максимально самостоятельного выполнения заданий. Поэтому при проведении практического занятия преподавателю рекомендуется:

1. Провести экспресс-опрос (устно или в тестовой форме) по теоретическому материалу, необходимому для выполнения работы (с оценкой).
2. Проверить правильность выполнения заданий, подготовленных студентом дома (с оценкой).

Любой практическое занятие включает самостоятельную проработку теоретического материала и изучение методики решения типичных задач. Некоторые задачи содержат элементы научных исследований, которые могут потребовать углубленной самостоятельной проработки теоретического материала.

При организации внеаудиторной самостоятельной работы по данной дисциплине преподавателю рекомендуется использовать следующие ее формы:

- решение студентом самостоятельных задач обычной сложности, направленных на закрепление знаний и умений;
- выполнение индивидуальных заданий повышенной сложности, направленных на развитие у студентов научного мышления и инициативы.

## **6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов**

### **Тема 1. Гауссовские системы.**

домашнее задание , примерные вопросы:

Проверка гипотезы о нормальном распределении логарифмической прибыли.

### **Тема 2. Необходимые сведения из теории мартингалов.**

домашнее задание , примерные вопросы:

Теорема Дуба о разложении субмартингала.

### **Тема 3. Гауссовские и условно-гауссовские модели.**

домашнее задание , примерные вопросы:

Модели авторегрессионной условной неоднородности.

### **Тема 4. Нелинейные стохастические условно-гауссовские модели.**

домашнее задание , примерные вопросы:

Модели ARCH, GARCH, SV

### **Тема 5. Критерий для проверки гипотезы волатильности.**

контрольная работа , примерные вопросы:

Написание программы для проверки гипотезы однородности дисперсий.

### **Тема . Итоговая форма контроля**

Примерные вопросы к экзамену:

Вопросы к экзамену

1. Представление цены акции. Логарифмическая прибыль. Предположения о нормальности и независимости логарифмических прибылей. Мартингалы, субмартингалы.
2. Разложение Дуба для субмартингалов. Квадратичная вариация мартингала ее связь с волатильностью.
3. Мартингал-разности, локальные мартингалы и мартингальные преобразования. Использование мартингальных преобразований и разложения Дуба в задачах для случайных блужданий.
4. Линейные стационарные модели. Модели авторегрессии

Гауссовские и условно гауссовские модели

2. Что такое логарифмическая прибыль?
3. Как проверить, принадлежит ли распределение данных к классу нормальных?
4. Как проверить независимость данных?
5. Для каких последовательностей случайных величин применимо разложение Дуба?
6. Что такое квадратичная вариация мартингала?
7. Как связаны квадратичная вариация для мартингала и волатильность?
8. Что такое стохастическая волатильность?
9. Что такое мартингал-разность?
10. Как связаны мартингал и мартингал-разность?
11. Что такое мартингальное преобразование и локальный мартингал?
12. Что дает определение мартингального преобразования?
13. Что такое условно гауссовская модель?

4. Что такое процесс стохастической волатильности?
15. Что такое процесс ARCH второго порядка?
16. Что такое процесс GARCH второго порядка?
17. Как оцениваются неизвестные параметры нелинейных ARCH моделей?
18. Какие модели пригодны для исследования квадратов логарифмических прибылей?
19. Какие свойства имеют модели ARCH?
20. Какие свойства имеют модели GARCH?
21. Какие свойства имеют SV-модели?
22. Как оцениваются неизвестные параметры нелинейных ARCH и GARCH моделей?
23. Какие оценки волатильности можно применять??
24. Какой критерий можно использовать для проверки волатильности данных?
25. Что такое белый шум?
26. Какой случайный процесс называется стационарным?
27. Что такое процесс авторегрессии второго порядка?
28. Что такое процесс скользящего среднего второго порядка?
29. Как записываются уравнения Юла-Уокера?
30. Как оцениваются неизвестные параметры линейных моделей?

### 7.1. Основная литература:

1. Спирина, М. С. Теория вероятностей и математическая статистика: учебник для студ. вузов / М. С. Спирина, П. А. Спирин. ?Москва: Академия, 2007. ?352 с
2. Володин, И. Н. Математические основы вероятности [Текст: электронный ресурс]: [учебное пособие] / Володин И. Н., Тихонов О. Е., Турилова Е. А.; Казан. гос. ун-т, Каф. мат. статистики. - 2006 ?Электронные данные (1 файл: 0,73 Мб). URL: [http://libweb.ksu.ru/ebooks/09\\_66%20\\_ds005.pdf](http://libweb.ksu.ru/ebooks/09_66%20_ds005.pdf)
3. Бочаров П.П., Касимов Ю. Ф. Финансовая математика. - М.: Физматлит, 2007. - 576 с. URL: [http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1\\_id=2116](http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=2116)
4. Хуснутдинов Р.Ш., Жихарев В.А. Математика для экономистов в примерах и задачах. - М.: Лань, 2012. - 656 с. URL: [http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1\\_id=4233](http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=4233)
5. Экономическая статистика: Учебник / МГУ им. М.В. Ломоносова; Под ред. Ю.Н. Иванова. - 3-е изд., перераб. и доп. - М.: ИНФРА-М, 2006. - 736 с. URL: <http://znanium.com/bookread.php?book=110560>

### 7.2. Дополнительная литература:

1. Горбачев, Сергей Викторович. Управление финансовыми проектами и финансовыми рисками : учебно-методическое пособие, специальность 061100 "менеджмент организаций" / С. В. Горбачев ; [Казан. гос. ун-т ; науч. ред. д.э.н., проф. С. В. Мокичев] .? Казань : Казанский государственный университет, 2009 . - 35 с.
2. Финансовые вычисления на рынке ценных бумаг : учебное пособие для студентов, обучающихся по специальности "Финансы и кредит" / НОУ ВПО "Университет управления ТИСБИ" ; [авт.-сост.: к.экон.н., доц. Э. А. Файзрахманова] .? Казань : [Университет управления "ТИСБИ"], 2012 . - 104 с.
3. Ефимова, Марина Романовна.



Финансовые расчеты : учебное пособие по дисциплине специализации специальности "Менеджмент организации". Практикум / М. Р. Ефимова ; Гос. ун-т упр. ? Москва : Кнорус, 2013 .? 182 с.

4. Батяева, Тамара Александровна. Рынок ценных бумаг: учебное пособие для студентов высших учебных заведений, обучающихся по специальности 080105 "Финансы и кредит" / Т.А. Батяева, И.И. Столяров; Моск. гос. ун-т им. М.В. Ломоносова, Фак. гос. упр..?Москва: ИНФРА-М, 2009.

5. Боровков А.А. Математическая статистика.- СПб.: Лань, 2010. - 704 с. ЭБС "Лань": [http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1\\_id=3810](http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=3810)

6. Свешников А.А. Прикладные методы теории вероятностей.- СПб.: Лань, 2012. - 480 с. ЭБС "Лань": [http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1\\_id=3184](http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=3184)

7. Свешников А.А. Прикладные методы теории марковских процессов.- СПб.: Лань, 2007. - 192 с. ЭБС "Лань": [http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1\\_id=590](http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=590)

8. Свешников А.А. Прикладные методы теории случайных функций.- Спб.: Лань, 2011. - 464с ЭБС "Лань": [http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1\\_id=656](http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=656)

### 7.3. Интернет-ресурсы:

Основы торговли волатильностью - <http://whatisbirga.com/bensignor60.html>

сайт финансовых данных - <http://www.finam.ru/analysis/profile041CA/default.asp>

Стратегия ?Торговля волатильностью? -

[http://www.aton-line.ru/study/elearning/elearning\\_06/futures\\_market04/](http://www.aton-line.ru/study/elearning/elearning_06/futures_market04/)

что ждать от волатильности - <http://superinvestor.ru/archives/714>

что такое волатильность - [http://dic.academic.ru/dic.nsf/fin\\_enc/21264](http://dic.academic.ru/dic.nsf/fin_enc/21264)

### 8. Материально-техническое обеспечение дисциплины(модуля)

Освоение дисциплины "Финансовая статистика" предполагает использование следующего материально-технического обеспечения:

Компьютерный класс, представляющий собой рабочее место преподавателя и не менее 15 рабочих мест студентов, включающих компьютерный стол, стул, персональный компьютер, лицензионное программное обеспечение. Каждый компьютер имеет широкополосный доступ в сеть Интернет. Все компьютеры подключены к корпоративной компьютерной сети КФУ и находятся в едином домене.

Лекции по дисциплине проводятся в аудитории, оснащенной доской и мелом (маркером). Все работы по исследованию реальных финансовых данных проводятся в компьютерном классе.

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВПО и учебным планом по направлению 010300.62 "Фундаментальная информатика и информационные технологии" и профилю подготовки Системный анализ и информационные технологии .

Автор(ы):

Халиуллин С.Г. \_\_\_\_\_

"\_\_" \_\_\_\_\_ 201\_\_ г.

Рецензент(ы):

Гумеров Р.Н. \_\_\_\_\_

"\_\_" \_\_\_\_\_ 201\_\_ г.