АННОТАЦИЯ

дисциплины Б1.В.ДВ.03.02

«Производные финансовые инструменты: анализ рынка, хеджирование и арбитраж»

Направление подготовки 38.04.08 – Финансы и кредит

Направленность (профиль) / специализация "Финансы в цифровой экономике"

Форма обучения - заочная

Объем трудоемкости: 2 зачетные единицы (72 часа, из них – 18,2 ч. контактной работы, в том числе 18 часа аудиторной нагрузки: лекционных 2 ч., практических 16 ч.; ИКР- 0,2 ч; 50 часов самостоятельной работы, контроль – 3,8 часа)

Цель дисциплины:

Цель дисциплины - сформировать у обучающихся современные компетенции в области использования производных финансовых инструментов, для финансирования инновационных направлений развития и финансово-экономических рисков хозяйствующих субъектов.

Задачи дисциплины:

- 1) изучить научные подходы к использованию производных финансовых инструментов в исследованиях финансово-экономических рисков, учитывая стратегии хеджирования и арбитража;
- 2) овладеть основами формирования и реализации стратегий хеджирования и арбитража в системе финансирования инновационной деятельности;
- 3) изучить дефиниции и основы интерпретирования информации характеризующей финансово-экономических рисков организаций участников рынка производных финансовых инструментов;
- 4) сформировать компетенции использования производных финансовых инструментов в исследования эффективного финансирования инновационного развития.

Место дисциплины в структуре ООП ВО

Настоящая дисциплина относится к дисциплинам по выбору вариативной части, обеспечивающим профессиональную подготовку магистра Блока 1 учебного плана по направлению подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит» направленность Финансы в цифровой экономике (квалификация (степень) «магистр»). Дисциплина предназначена для студентов первого года обучения магистерской программы «Финансы и кредит», читается в 4 семестре и занимает одно из ключевых мест в этом блоке магистерской программы.

Для ее успешного освоения слушатель должен владеть основами экономических знаний, а также элементарными навыками математической и компьютерной обработки данных. Материал курса базируется на содержании дисциплин бакалаврского уровня: «Инвестиции», «Экономический анализ», «Рынок ценных бумаг и биржевое дело» и тесно связан с дисциплинами магистерского уровня такими как «Финансовый анализ (продвинутый уровень)», «Технический и фундаментальный анализ на финансовом рынке» и др.

В свою очередь, данный курс служит фундаментом для успешного проведения НИР, подготовки магистерских диссертаций и в последующей практической деятельности магистрантов.

Требования к уровню освоения дисциплины

Изучение данной учебной дисциплины направлено на формирование у обучающихся профессиональных компетенций

№ п.п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	уметь	владеть
1.	ПК-22	способностью выявлять и проводить исследование эффективных направлений финансового обеспечения инновационного развития на микро-, мезо- и макроуровне	- сущность производных финансовых инструментов, возможности использования их в финансовом обеспечении инновационного развития	- формировать и реализовывать стратегии хеджирования, выявлять ценовые аномалии, для проведения арбитражных операций.	- навыками проведения исследований эффективных направлений в сфере финансового обеспечения
2.	ПК-23	способностью выявлять и проводить исследование финансово-экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов для разработки системы управления рисками	- дефиниции, используемые на рынке производных финансовых инструментов, применяемые для интерпретации результатов исследований финансово-экономических рисков	- интерпретировать результаты практики использования производных финансовых инструментов в системе управления рисками	- навыками проведения исследований использования производных инструментов в контексте финансово-экономических рисков хозяйствующих субъектов

Основные разделы дисциплины:

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины. Разделы дисциплины, изучаемые в 4 семестре

№ раздела	Наименование разделов	Количество часов				
		Всего	Аудиторная работа			Самостоятельная работа
			Л	ПЗ	ЛР	
1	2	3	4	5	6	7
1.	Основные характеристики производных финансовых инструментов	17	1	4	-	12
2.	Рынки производных финансовых инструментов	17	1	4		12
3.	Стратегия и тактика хеджирования	16	-	4	-	12

4.	Стратегия и тактика арбитражных операций	18	-	4	-	14
	<i>Итого по дисциплине:</i>	-	2	16	-	50

Лабораторный практикум - не предусмотрен.

Курсовые проекты или работы: не предусмотрены

Форма проведения аттестации по дисциплине: зачет

Основная литература:

1. Натенберг, Ш. Опционы: волатильность и оценка стоимости. Стратегии и методы опционной торговли / Ш. Натенберг ; науч. ред. А. Балабушкин; ред. В. Ионов ; пер. Е. Пестерева. - 3-е изд. - Москва: Альпина Паблишерз, 2016. - 539 с. - ISBN 978-5-9614-5238-9; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=254536>

2. Дарушин, И.А. Финансовый инжиниринг: инструменты и технологии : монография / И.А. Дарушин ; науч. ред. Н.С. Воронова. - Москва: Проспект, 2015. - 293 с.: схем., табл. - Библиогр.: с. 272-284. - ISBN 978-5-392-18093-6; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=375455>

3. Деривативы: Курс для начинающих / науч. ред. В. Ионов ; пер. Б. Зуев. – 2-е изд. – Москва : Альпина Паблишер, 2016. – 201 с. – (Reuters для финансистов). – Режим доступа: по подписке. – URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=333091> (дата обращения: 21.06.2020). – ISBN 978-5-9614-1094-5. – Текст : электронный.

4. Уколов, А.И. Управление корпоративными рисками: инструменты хеджирования / А.И. Уколов, Т.Н. Гупалова. – 2-е изд., стер. – Москва : Директ-Медиа, 2017. – 554 с. : ил., схем., табл. – Режим доступа: по подписке. – URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=273678> (дата обращения: 21.06.2020). – Библиогр.: с. 547. – ISBN 978-5-4475-9318-6. – DOI 10.23681/273678. – Текст : электронный.

Автор РПД

Пучкина Е.С.