

АННОТАЦИЯ

дисциплины Б1.В.04 «Производные финансовые инструменты»

Объем трудоемкости: 3 зачетные единицы (108 часа, из них контактная работа – 38,3 ч., в том числе 38 часов аудиторной нагрузки: лекционных 6 ч., практических 32 ч.; ИКР – 0,3 ч.; 43, час. самостоятельной работы).

Цель дисциплины:

Изучение роли и возможностей использования производных финансовых инструментов в рамках исследования актуальных научных проблем для интерпретирования результатов финансово-экономических исследований.

При изучении данной дисциплины следует акцентировать внимание на перспективность использования производных финансовых инструментов для обеспечения инновационного развития организаций, в том числе финансово-кредитных.

Задачи дисциплины

- 1) сформировать представление о сущности производных финансовых инструментов;
- 2) исследовать понятия и термины рынка производных финансовых инструментов, которые необходимы для интерпретации результатов финансово-экономических исследований данного сегмента финансового рынка, обеспечивающего возможности для инновационного развития организаций;
- 3) рассмотреть особенности построения стратегий хеджирования с помощью финансовых фьючерсов, а также формировать и реализовывать стратегии хеджирования, находить ценовые аномалии, которые можно использовать для построения арбитражных операций;
- 4) изучить методики проведения научных исследований в сфере развития рынка производных финансовых инструментов;
- 5) сформировать практические навыки расчетов и построений стратегий хеджирования, обоснованного выбора наилучшей стратегии на базе сравнения всех возможных построений, расчетов индикаторов эффективности использования производных финансовых инструментов для использования в рамках разработки финансовых аспектов перспективных направлений деятельности организаций.

Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Производные финансовые инструменты» относится к вариативной части Блока 1 «Дисциплины (модули)» учебного плана по направлению подготовки 38.04.08. «Финансы и кредит», «Финансовый менеджмент», читается в семестре В 2 курса.

Дисциплина опирается на знания и навыки, приобретенные в результате изучения дисциплин: «Финансовые рынки и финансово кредитные институты», «Риск - менеджмент».

Знания, полученные в ходе изучения дисциплины, применяются в процессе изучения дисциплины «Современные проблемы финансового менеджмента», при написании магистерской диссертации и в последующей практической деятельности

Требования к уровню освоения дисциплины

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

№ п.п.	Индекс компет енции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	уметь	владеть
1	ПК-21	способность выявлять и проводить исследование актуальных научных проблем в области финансов и кредита	- сущность производных финансовых инструментов; - методы, стратегию и тактику осуществления хеджирования посредством финансовых фьючерсных и опционных контрактов.	- выявлять актуальные научные проблемы в части исследования производных финансовых инструментов - формировать и реализовывать стратегии хеджирования, выявлять ценовые аномалии, для проведения арбитражных операций.	методикой проведения научных исследований в сфере развития рынка производных финансовых инструментов .
	ПК - 25	способность интерпретироват ь результаты финансово- экономических исследований с целью разработки финансовых аспектов перспективных направлений инновационного развития организаций, в том числе финансово- кредитных	дефиниции, используемые на рынке производных финансовых инструментов, применяемые для интерпретации результатов финансово- экономических исследований данного сегмента финансового рынка, и обеспечивающие возможности инновационного развития организаций	интерпретировать результаты практики использования производных финансовых инструментов, используемые в целях инновационного развития финансово- кредитных организаций	н навыками расчетов индикаторов эффективност и использовани я производных финансовых инструментов для разработки финансовых аспектов инновационн ых направлений деятельности организаций.

Основные разделы дисциплины:

№ разд ела	Наименование разделов	Количество часов			
		Всего	Аудиторная работа		Самостоятел ьная работа
			Л	ПЗ	
1	2	3	4	5	6
1.	Основные характеристики производных финансовых инструментов	11	2	4	5
2.	Рынки производных финансовых инструментов	8	-	4	4
3.	Ценообразование на рынке производных финансовых инструментов	15	-	6	9
4.	Стратегия и тактика хеджирования	10	2	4	4
5.	Хеджирование фьючерсными контрактами фондовой биржи	8	-	4	4
6.	Хеджирование с помощью опционных контрактов	6	-	2	4
7.	Особенности биржевого и внебиржевого оборота производных финансовых инструментов	23	2	8	13
<i>Итого по дисциплине:</i>			6	32	43

Курсовые работы: не предусмотрены

Форма проведения аттестации по дисциплине: Экзамен

Основная литература:

1. Блохина, Т.К. Мировые финансовые рынки : учебник / Т.К. Блохина. - Москва : Проспект, 2016. - 159 с. : табл., схем. - Библиогр. в кн. - ISBN 978-5-392-19560-2 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=443699>

2. 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>

3. 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>

Автор РПД

Пучкина Екатерина Сергеевна