

**Аннотация
рабочей программы дисциплины**

«Производные финансовые инструменты»

1. ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1. Цель изучения дисциплины

Дисциплина «Производные финансовые инструменты» играет важную роль в овладении методами принятия обоснованных решений в области финансового управления и формировании финансового мышления.

Основной целью дисциплины является освоение студентами знаний и практических навыков управления производными финансовыми инструментами.

1.2. Задачи учебной дисциплины:

- 1) Рассмотрение современных тенденций в сфере обращения производных финансовых инструментов;
- 2) Анализ рынка производных инструментов;
- 3) Раскрытие структуры рынка производных финансовых инструментов;
- 4) Раскрытие содержания методов оценки производных инструментов;
- 5) Оценка рисков и доходности финансовых инструментов.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП ВПО

2.1. Цикл (раздел) ООП:

Дисциплина относится к циклу БЗ.В. «Вариативная часть».

2.2. Взаимосвязь дисциплины с другими дисциплинами ООП

Дисциплина опирается на знания, умения и компетенции студента, полученные при изучении следующих учебных дисциплин: «Финансы», «Финансовые и денежно-кредитные методы регулирования экономики», «Финансовые рынки и финансово-кредитные инструменты», «Финансовые рынки и финансово-кредитные институты».

Полученные в процессе изучения дисциплины «Производные финансовые инструменты» знания и умения могут быть использованы при изучении дисциплин: «Стратегия управления финансовой деятельностью», «Инновационные банковские технологии и продукты» и при подготовке магистерской диссертации.

3. ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ СОДЕРЖАНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины:

Код соответствующей компетенции по ГОС	Наименование компетенций	Результат освоения (знать, уметь, владеть)
ПК-1	способностью проводить анализ и оценивать направления развития денежно-кредитных и финансовых институтов и рынков в контексте общеэкономических, мировых и страновых особенностей	Знать: знать основные типы производных финансовых инструментов, новейшие теории для рынков производных финансовых инструментов, методы исследования этих рынков. Уметь: рассчитывать цены инструментов, выбирать схемы технологий и стратегий, модернизировать данные схемы в изменяющихся условиях рынка,

		включаться в работу бирж производных финансовых инструментов. Владеть: системным представлением о состоянии и направлениях развития российского и международного биржевого и внебиржевого рынков производных финансовых инструментов.
ПК-11	Способность обосновать на основе анализа финансово-экономических рисков стратегию поведения экономических агентов на различных сегментах финансового рынка	Знать: современные модели ценообразования, схемы технологий и стратегий поведения участников этих рынков. Уметь: формировать и реализовывать стратегии хеджирования; находить ценовые аномалии, которые можно использовать для построения арбитражных операций. Владеть: навыками фундаментального и технического анализа.
ПК-12	Способность определять оптимальные направления инвестиционной деятельности предприятия, диверсифицировать ее, прогнозировать экономические последствия принимаемых инвестиционных решений; разрабатывать и реализовывать инвестиционную стратегию предприятия.	Знать: традиционные инвестиционные стратегии работы на рынке производных финансовых инструментов. Уметь: конструировать структурные продукты на базе производных финансовых инструментов. Владеть: навыками работы с информационными базами данных, необходимыми для аналитической работы по оценке эффективности производных финансовых инструментов.

4. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Раздел 1. Теоретические основы анализа рынка срочных контрактов и исторически первичных производных инструментов

Тема 1.1. Производные финансовые инструменты

Тема 1.2. Теоретические основы анализа рынка срочных контрактов

Тема 1.3. Хеджирование и спекуляция

Раздел 2. Опционы и структурные продукты

Тема 2.1. Сущность и классификация опционов

Тема 2.2. Модели оценки стоимости опционов

Тема 2.3. Сущность и классификация структурных продуктов

Тема 2.4. Методика конструирования структурного продукта

Раздел 3. Арбитражные сделки и свопы

Тема 3.1. Сущность, классификация и механизм арбитражных сделок

Тема 3.2. Механизм свопов

5. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

При преподавании дисциплины могут использоваться традиционные и

интерактивные образовательные технологии, в том числе:

чтение лекций в форме монолога с элементами диалога и дискуссии;
семинарская система обучения (устный опрос, тестирование, решение задач, анализ конкретных финансовых ситуаций, разработка проблемы и подготовка презентации);
технологии интерактивного обучения (работа в малых группах, мозговой штурм);
консультации преподавателей в рамках внеаудиторной работы;
научно-исследовательская работа (подготовка научной статьи по теоретико-правовой проблематике).

Разработчик рабочей программы:

Фомина Е.А., доцент, кандидат экономических наук, доцент кафедры финансов