

МИНОБРНАУКИ РОССИИ



Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Российский государственный гуманитарный университет»
(ФГБОУ ВО «РГГУ»)

ИНСТИТУТ ЭКОНОМИКИ, УПРАВЛЕНИЯ И ПРАВА
Кафедра финансов и кредита

ПРОИЗВОДНЫЕ ФИНАНСОВЫЕ ИНСТРУМЕНТЫ
РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

38.04.08 Финансы и кредит

Код и наименование направления подготовки/специальности

Финансовые рынки и технологии

Наименование направленности (профиля)/ специализации

Уровень высшего образования: *Магистратура*

Форма обучения: *заочная*

РПД адаптирована для лиц
с ограниченными возможностями
здоровья и инвалидов

Москва 2024

ПРОИЗВОДНЫЕ ФИНАНСОВЫЕ ИНСТРУМЕНТЫ

Рабочая программа дисциплины

Составитель:

Д.э.н., профессор кафедры финансы и кредит Бойко П.А.

УТВЕРЖДЕНО

Протокол заседания кафедры

№ 3 от 28.03.2024

ОГЛАВЛЕНИЕ

1. ПОЯСНИТЕЛЬНАЯ ЗАПИСКА	4
1.1. Цель и задачи дисциплины	4
1.2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с индикаторами достижения компетенций.....	4
1.3. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы	4
2. Структура дисциплины	5
3. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ	5
4. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ	5
5 ОЦЕНКА ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ	5
5.1 Система оценивания	5
5.1. Система оценивания	5
5.2. Критерии выставления оценок по дисциплине.....	6
5.3. Оценочные средства (материалы) для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине	7
6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ	10
6.1. Список источников и литературы	10
6.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети Интернет, необходимый для освоения дисциплины.....	10
6.3. Профессиональные базы данных и информационно-справочные системы	10
7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ.....	10
8 ОБЕСПЕЧЕНИЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ДЛЯ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ И ИНВАЛИДОВ	11
9 МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ	12
9.1. Планы практических занятий	12
АННОТАЦИЯ.....	13

1. ПОЯСНИТЕЛЬНАЯ ЗАПИСКА

1.1. Цель и задачи дисциплины

Цель дисциплины состоит в углубленном изучении производных финансовых инструментов.

Задачи курса:

- углубить знания о производных финансовых инструментах и о применении производных финансовых инструментов на финансовом рынке;
- познакомить с существующими в мировой практике тенденциями в изучаемой предметной области;
- сформировать навыки работы с аналитическими материалами и статистическими данными.

1.2 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с индикаторами достижения компетенций

Дисциплина направлена на формирование следующих компетенций:

Компетенция (код и наименование)	Индикаторы компетенций (код и наименование)	Результаты обучения
ПК-2 Способен проводить анализ, составлять прогнозы состояния финансовых рынков	ПК-2.1 - Собирает, анализирует и представляет информацию в масштабах всего спектра финансовых (инвестиционных) услуг	<u>Знать:</u> <ul style="list-style-type: none">• свойства и характеристики основных производных финансовых инструментов;• области и технологии применения производных финансовых инструментов <u>Уметь:</u> <ul style="list-style-type: none">• использовать теоретические знания в практической деятельности;• строить базовые модели с применением производных финансовых инструментов; <u>Владеть:</u> <ul style="list-style-type: none">• навыками сбора, обработки информации;• понятийным аппаратом и профессиональной терминологией• навыками составления аналитического отчета, выступления с научным сообщением
	ПК-2.3 - Выявляет и оценивает (качественно и количественно) риски в финансовых продуктах, на финансовых рынках с помощью современных информационных технологий	

1.3 Место дисциплины в структуре основной образовательной программы

Дисциплина «Производные финансовые инструменты» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений блока дисциплин учебного плана.

Для освоения дисциплины «Производные финансовые инструменты» необходимы компетенции, сформированные в ходе изучения следующих дисциплин: «Современные финансовые рынки», «Финансовые инновации», «Финансовое прогнозирование».

В результате освоения дисциплины формируются знания, умения и владения, необходимые для изучения следующих дисциплин и прохождения практик –

«Фундаментальный и технический анализ», ознакомительная практика, практика по профилю профессиональной деятельности, научно-исследовательская работа.

2. Структура дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетных единицы, 108 часов.

Структура дисциплины для заочной формы обучения

Объем дисциплины в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении учебных занятий:

Семестр	Тип учебных занятий	Количество часов
2	Лекции	4
2	Семинары/лабораторные работы	8
Всего:		12

Объем дисциплины в форме самостоятельной работы обучающихся составляет 96 академических часов, промежуточная аттестация (контроль) 9 ч..

3. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Тема 1. Место производственных финансовых инструментов на рынке

Предпосылки появления ПФР. Свободная торговля и частная собственность. Финансовые рынки как источник и амортизатор финансовых рисков. Срочные инструменты финансового рынка. Кривая доходностей и форвардные процентные ставки.

Тема 2. Дизайн производных финансовых инструментов

Производные от акций: право, ордер, опционы. Производные от процентных активов: облигации, обеспеченные активами, обязательства по обеспеченным долгам, кредитные дефолтные свопы, форварды и фьючерсы.

Тема 3. Применение производных финансовых инструментов

Хеджирование позиций на финансовых рынках с помощью производных финансовых инструментов.

4. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

Для проведения учебных занятий по дисциплине используются различные образовательные технологии. Для организации учебного процесса может быть использовано электронное обучение и (или) дистанционные образовательные технологии.

5 ОЦЕНКА ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ

5.1 Система оценивания

5.1. Система оценивания

Система оценивания включает тест с фиксированным ответом, одну презентацию и одну письменную контрольную работу. Тест может быть тематическим (по каждой теме) и служить средством текущего контроля или финальным (по всему курсу) и служить средством промежуточной аттестации.

Кроме ТФО и презентации, обучающиеся выполняют письменную контрольную работу (КР) по теме из списка или предложенной и утвержденной преподавателем. В отличие от ТФО и презентации КР предполагает самостоятельность обучающегося в выборе темы, содержания (в рамках стандартного плана) и источников информации.

В процессе изучения курса проводится рейтинговый контроль знаний, обучающихся в соответствии с Положением РГГУ о его проведении. Он предполагает учет результатов текущего контроля и промежуточной аттестации:

Форма контроля	Максимум баллов	
	За одну работу	Всего
Текущий контроль:		
- ТФО	30	30
- КР	30	30
- итого	60	60
Экзамен	40	40
	Всего за семестр	100

Полученный совокупный результат конвертируется в традиционную шкалу оценок и в шкалу оценок Европейской системы переноса и накопления кредитов (European Credit Transfer System; далее – ECTS) в соответствии с таблицей:

100-балльная шкала	Традиционная шкала		Шкала ECTS
95 - 100	отлично	зачтено	A
83 - 94			B
68 - 82	хорошо		C
56 - 67	удовлетворительно		D
50 - 55			E
20 - 49	неудовлетворительно	не зачтено	FX
0 - 19			F

5.2. Критерии выставления оценок по дисциплине

Баллы/ Шкала ECTS	Оценка по дисциплине	Критерии оценки результатов обучения по дисциплине
100- 83/ A, B	«отлично»/ «зачтено (отлично)»/ «зачтено»	Выставляется обучающемуся, если он глубоко и прочно усвоил теоретический и практический материал, может продемонстрировать это на занятиях и в ходе промежуточной аттестации. Обучающийся исчерпывающе и логически стройно излагает учебный материал, умеет увязывать теорию с практикой, справляется с решением задач профессиональной направленности высокого уровня сложности, правильно обосновывает принятые решения. Свободно ориентируется в учебной и профессиональной литературе. Оценка по дисциплине выставляется обучающемуся с учётом результатов текущей и промежуточной аттестации. Компетенции, закреплённые за дисциплиной, сформированы на уровне – «высокий».

Баллы/ Шкала ECTS	Оценка по дисциплине	Критерии оценки результатов обучения по дисциплине
82-68/ С	«хорошо»/ «зачтено (хорошо)»/ «зачтено»	Выставляется обучающемуся, если он знает теоретический и практический материал, грамотно и по существу излагает его на занятиях и в ходе промежуточной аттестации, не допуская существенных неточностей. Обучающийся правильно применяет теоретические положения при решении практических задач профессиональной направленности разного уровня сложности, владеет необходимыми для этого навыками и приёмами. Достаточно хорошо ориентируется в учебной и профессиональной литературе. Оценка по дисциплине выставляется обучающемуся с учётом результатов текущей и промежуточной аттестации. Компетенции, закреплённые за дисциплиной, сформированы на уровне – «хороший».
67-50/ D, E	«удовлетворительно»/ «зачтено (удовлетворительно)»/ «зачтено»	Выставляется обучающемуся, если он знает на базовом уровне теоретический и практический материал, допускает отдельные ошибки при его изложении на занятиях и в ходе промежуточной аттестации. Обучающийся испытывает определённые затруднения в применении теоретических положений при решении практических задач профессиональной направленности стандартного уровня сложности, владеет необходимыми для этого базовыми навыками и приёмами. Демонстрирует достаточный уровень знания учебной литературы по дисциплине.
49-0/ F, FX	«неудовлетворительно»/ не зачтено	Выставляется обучающемуся, если он не знает на базовом уровне теоретический и практический материал, допускает грубые ошибки при его изложении на занятиях и в ходе промежуточной аттестации. Обучающийся испытывает серьёзные затруднения в применении теоретических положений при решении практических задач профессиональной направленности стандартного уровня сложности, не владеет необходимыми для этого навыками и приёмами. Демонстрирует фрагментарные знания учебной литературы по дисциплине. Оценка по дисциплине выставляется обучающемуся с учётом результатов текущей и промежуточной аттестации. Компетенции на уровне «достаточный», закреплённые за дисциплиной, не сформированы.

5.3. Оценочные средства (материалы) для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

Темы докладов

1. Что такое производный финансовый инструмент?
2. Виды базовых активов.
3. Способы образования и обращения производных финансовых инструментов.
4. Почему производные финансовые инструменты дают возможность управлять финансовыми рисками?
5. Различие между форвардами и фьючерсами.
6. Срочные контракты с поставкой и расчетные контракты.

7. Ценообразование фьючерсов на облигации.
8. Фьючерсы на облигации как способ фиксирования форвардной процентной ставки.
9. Хеджирование рисков процентной ставки при управлении активами и долгами.
10. Срочные валютные рынки и валютные фьючерсы. Управление валютными рисками с помощью срочных контрактов.
11. Курсы валют и процентные ставки. Паритет процентных ставок как арбитражное соотношение.
12. Соглашения о будущих процентных ставках, процентные свопы.
13. Производные инструменты для фондового рынка.
14. Ценообразование для фьючерса на рисковый актив. Наведенная процентная ставка и арбитраж.
15. Понятие диверсификации риска, фондовые индексы и индексные фьючерсы.
16. Put-опционы call-опционы – права и обязанности покупателя и продавца.
17. Фьючерс как комбинация опционов. Различия опционов и фьючерсов как инструментов управления риском.
18. Соотношение паритета put-опционов и call-опционов.
19. Европейские и американские опционы.
20. Формула Блэка-Шоулза: параметры, определяющие цену опциона, их агрегирование и физический смысл.

Критерии оценивания презентаций:

«Неудовлетворительно»

Тезис отсутствует или невнятен, широк, неинтересен. Сомневаешься, что автор понимает презентуемый материал. Фразы не связаны друг с другом; идеи не развиваются от предложения к предложению. Одна и та же мысль повторяется. Много разных ошибок.

«Удовлетворительно»

Тезис есть, но он невнятен, широк, неинтересен, очевиден. Или тезис – личное мнение авторитетного специалиста. Нет аргументов, которые кто-то захотел бы оспорить («Россия - большая страна», «Москва – город контрастов»). Тезис - стоящий, но нет доказательств. Много разных ошибок (но и без них презентация не может «тянуть» на вышестоящую оценку).

«Хорошо»

Точно знаешь, что хотел сказать автор. Материал хорошо организован, содержит стоящую, интересную идею, весомые, четкие и упорядоченные доказательства. Фразы необязательно элегантные, но четкие. Фразы могут быть плохо упорядочены, но они выстроены вокруг главной идеи. Материал механически корректен. Грамматика и пунктуация в порядке. Но важнее то, что смысл пронизывает всю презентацию. Есть тезис, заслуживающий дискуссии. Отсутствуют неожиданные отклонения от сюжета. Автор сдержал слово, данное в начале презентации.

«Отлично»

Все хорошие качества *«Хорошо»* плюс стиль. Презентация привлекает внимание аудитории и даже вызывает оживление. Кажется, что все в ней точно совпадает с тезисом. Может подвернуться пара ошибок, но ясно, что это случайные ошибки, которые делают все авторы. Чувствуешь работу ума. Автору безразличны собственные идеи и язык, которым они изложены.

Письменная контрольная работа (ПК-9)

Кроме ТФО и презентации / эссе, обучающиеся выполняют письменную контрольную работу (КР) по теме из списка или предложенной и утвержденной преподавателем. В отличие от ТФО и презентации КР предполагает самостоятельность обучающегося в выборе темы, содержания (в рамках стандартного плана) и источников информации.

Инструкция для авторов КР о фильме «Игра на понижение (The Big Short)»

Общие положения

У отчета может быть один автор или два-три автора. Если авторов два и более, то все получают одну и ту же оценку. Оценка выставляется по 100-бальной шкале и включается в расчет оценки за весь курс. Не сдавшие отчет в указанный срок караются штрафом в 20 баллов.

Фильм имеет значительную художественную ценность (замечательный сценарий, известные актеры, великолепная игра), которая, однако, не должна отвлекать внимание от его мощного финансового контента. Фильм иллюстрирует отдельные положения дисциплины, и отчет должен демонстрировать связь фильма с дисциплиной.

Работа над отчетом начинается с просмотра фильма и выбора героя из следующих персонажей: Майкл Берри (Scion Capital), Марк Баум (FrontPoint), Джарред Веннетт (Deutsche Bank), Чарли и Джимми (Brownfield). Выбрав героя, необходимо еще раз посмотреть фильм, чтобы собрать максимум информации о его работе, характере, поведении и ключевых решениях.

Основные требования к отчету

Контекст – кризис рынка жилой недвижимости в США, переросший в глобальный финансовый кризис. Каждый герой переживает кризис по-своему. Но все они действуют на одном рынке – рынке производных финансовых инструментов, хотя и могут занимать на нем противоположные позиции. Фильм четко делится на несколько сюжетных линий: каждый герой проживает свою.

Отчет должен быть не компиляцией приглянувшихся вам кадров, а полным (от начала до конца фильма), понятным и точным рассказом о плане героя на кризис, его операциях на финансовом рынке и их результатах. Поэтому не обойтись без «мостиков», связывающих воедино фрагменты отчета. Например, нужно раскрыть механизм «шортирования» (short selling) применительно к данному сценарию; говоря об ипотечных облигациях, нужно сослаться на ипотечные кредиты, которые не являются финансовыми деривативами. Можно порекомендовать выписать из фильма «финансовые» кадры с участием героя, составить из них грубый отчет и затем улучшить его добавлением «мостиков» и другой вспомогательной информации. Если вам нужна дополнительная информация о рынке финансовых деривативов и коротких продажах, то загляните сюда: Алехин Б. И. Рынок ценных бумаг: учебник и практикум для академического бакалавриата. - М.: Издательство Юрайт, 2018. Главы 7, 19.

Для повышения оценки рекомендуется взглянуть на героя и его деятельность сквозь призму поведенческих финансов. Попробуйте обнаружить эвристики, срабатывающие при обновлении исходных убеждений (консерватизм, провалы памяти и другие) в подведении героя, должников по вкладным, представителей властей и финансового сообщества. Все герои – руководители хедж-фондов, а именно управляющие хедж-фондами склонны к арбитражу и чувствительны к рискам и затратам, которые ограничивают арбитраж. Один из героев даже переживает восстание своих клиентов (принципалов). Почему они хотят забрать из его фонда свой капитал? Совершают ли герои арбитражные сделки? Но главное – держать курс на производные финансовые инструменты.

Параметры печати

КР должна быть выполнена в редакторе Word. Текст располагается на листе формата А4 без рамок с соблюдением размеров полей: левое – 30 мм, правое – 10 мм, верхнее – 15 мм, нижнее – 20 мм. Нумерация страницы указывается в правом верхнем углу. Шрифт – Times New Roman, размер – 14, интервал – полуторный.

Инструкция для авторов КР о фильме «Поменяемся местами» (Trading Places)

Максимум 5 страниц

Фильм имеет значительную художественную ценность (замечательный сценарий, известные актеры, великолепная игра), которая, однако, не должна отвлекать внимание от финансовой «начинки». Контекст – сговор главных героев с целью отомстить братьям за их мерзкий «социальный эксперимент». Инструмент мести – использование приватной информации на торгах фьючерсам. Место – Нью-Йоркская товарная биржа.

Отчет должен быть не компиляцией «нарезок» из Wiki о фьючерсах и биржах, а полным (от начала до конца фильма), понятным и точным рассказом о причинах сговора, его реализации и результатах. Надо четко объяснить колебания цены фьючерса на замороженный апельсиновый сок на торгах в Нью-Йорке и ответить на вопрос, почему герои стали богатыми, а братья – банкротами. Как рассчитываются прибыли и убытки на товарной бирже? Событиям нужно подобрать академические определения.

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

6.1. Список источников и литературы

Литература

Основная

Алехин Б. И. Рынок ценных бумаг. - М.: Издательство Юрайт, 2019. ЭБС Юрайт [Электронный ресурс] – режим доступа: <https://urait.ru/viewer/rynok-cennyh-bumag-437162#page/1>

Галанов В.А. Производные финансовые инструменты: Учебник / Галанов В.А. - М.:ИНФРА-М, 2024. - 221 с. (Высшее образование) . ЭБС ZNANIUM [Электронный ресурс] – режим доступа: <https://znanium.com/read?id=430790>

6.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети Интернет, необходимый для освоения дисциплины

1. Финансы в Excel [Электронный ресурс]: Режим доступа: <https://www.excelfin.ru/>
2. Микроексел [Электронный ресурс]: Режим доступа: <https://microexcel.ru/>
3. Банк России [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.cbr.ru/analytics/>
4. Сайт Московской биржи [Электронный ресурс] Режим доступа www.moex.com
5. Сайт ФИНАМ [Электронный ресурс] Режим доступа www.finam.ru

6.3 Профессиональные базы данных и информационно-справочные системы

Доступ к профессиональным базам данных: <https://liber.rsuh.ru/ru/bases>

Информационные справочные системы:

1. Консультант Плюс
2. Гарант

7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Для обеспечения дисциплины используется материально-техническая база образовательного учреждения: учебные аудитории, оснащённые компьютером и проектором для демонстрации учебных материалов.

Состав программного обеспечения:

1. Windows
2. Microsoft Office
3. Kaspersky Endpoint Security

8 ОБЕСПЕЧЕНИЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ДЛЯ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ И ИНВАЛИДОВ

В ходе реализации дисциплины используются следующие дополнительные методы обучения, текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся в зависимости от их индивидуальных особенностей:

- для слепых и слабовидящих:
 - лекции оформляются в виде электронного документа, доступного с помощью компьютера со специализированным программным обеспечением;
 - письменные задания выполняются на компьютере со специализированным программным обеспечением, или могут быть заменены устным ответом;
 - обеспечивается индивидуальное равномерное освещение не менее 300 люкс;
 - для выполнения задания при необходимости предоставляется увеличивающее устройство; возможно также использование собственных увеличивающих устройств;
 - письменные задания оформляются увеличенным шрифтом;
 - экзамен и зачёт проводятся в устной форме или выполняются в письменной форме на компьютере.
- для глухих и слабослышащих:
 - лекции оформляются в виде электронного документа, либо предоставляется звукоусиливающая аппаратура индивидуального пользования;
 - письменные задания выполняются на компьютере в письменной форме;
 - экзамен и зачёт проводятся в письменной форме на компьютере; возможно проведение в форме тестирования.
- для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:
 - лекции оформляются в виде электронного документа, доступного с помощью компьютера со специализированным программным обеспечением;
 - письменные задания выполняются на компьютере со специализированным программным обеспечением;
 - экзамен и зачёт проводятся в устной форме или выполняются в письменной форме на компьютере.

При необходимости предусматривается увеличение времени для подготовки ответа.

Процедура проведения промежуточной аттестации для обучающихся устанавливается с учётом их индивидуальных психофизических особенностей. Промежуточная аттестация может проводиться в несколько этапов.

При проведении процедуры оценивания результатов обучения предусматривается использование технических средств, необходимых в связи с индивидуальными особенностями обучающихся. Эти средства могут быть предоставлены университетом, или могут использоваться собственные технические средства.

Проведение процедуры оценивания результатов обучения допускается с использованием дистанционных образовательных технологий.

Обеспечивается доступ к информационным и библиографическим ресурсам в сети Интернет для каждого обучающегося в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

- для слепых и слабовидящих:
 - в печатной форме увеличенным шрифтом;
 - в форме электронного документа;
 - в форме аудиофайла.
- для глухих и слабослышащих:

- в печатной форме;
- в форме электронного документа.
- для обучающихся с нарушениями опорно-двигательного аппарата:
- в печатной форме;
- в форме электронного документа;
- в форме аудиофайла.

Учебные аудитории для всех видов контактной и самостоятельной работы, научная библиотека и иные помещения для обучения оснащены специальным оборудованием и учебными местами с техническими средствами обучения:

- для слепых и слабовидящих:
 - устройством для сканирования и чтения с камерой SARA CE;
 - дисплеем Брайля PAC Mate 20;
 - принтером Брайля EmBraille ViewPlus;
- для глухих и слабослышащих:
 - автоматизированным рабочим местом для людей с нарушением слуха и слабослышащих;
 - акустический усилитель и колонки;
- для обучающихся с нарушениями опорно-двигательного аппарата:
 - передвижными, регулируемые эргономическими партами СИ-1;
 - компьютерной техникой со специальным программным обеспечением.

9 МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ

9.1. Планы практических занятий

Тема 1. Место производных финансовых инструментов на рынке

Цель занятия: формирование практических навыков в анализе финансовых деривативов.

Форма проведения: выступление с презентациями, решение практических задач, дискуссия, экспресс-тесты, конкурс знаний.

Контрольные вопросы по теме 1 см. раздел 5.3 Рабочей программы.

Тема 2. Дизайн производных финансовых инструментов

Цель занятия: формирование углубленных знаний о содержании и методах конструирования производных финансовых инструментов.

Форма проведения: решение практических задач, дискуссия, экспресс-тесты, конкурс знаний.

Контрольные вопросы по теме 2 см. раздел 5.3 Рабочей программы.

Тема 3. Применение производных финансовых инструментов

Цель занятия: формирование углубленных знаний о практике применения производных финансовых инструментов.

Форма проведения: решение практических задач, дискуссия, экспресс-тесты, конкурс знаний.

Контрольные вопросы по теме 3 см. раздел 5.3 Рабочей программы.

АННОТАЦИЯ

Дисциплина «Производные финансовые инструменты» реализуется на экономическом факультете ИУЭП РГГУ кафедрой «Финансы и кредит».

Цель дисциплины состоит в углубленном изучении производных финансовых инструментов.

Задачи курса:

- углубить знания о производных финансовых инструментах и о применении производных финансовых инструментов на финансовом рынке;
- познакомить с существующими в мировой практике тенденциями в изучаемой предметной области;
- сформировать навыки работы с аналитическими материалами и статистическими данными.

Дисциплина направлена на формирование у выпускника следующих профессиональных компетенций:

ПК-2 Способен проводить анализ, составлять прогнозы состояния финансовых рынков.

В результате освоения дисциплины обучающийся должен:

Знать:

- Свойства и характеристики производных финансовых инструментов;
- Области и технологии применения производных финансовых инструментов;

Уметь:

- использовать теоретические знания в практической деятельности
- строить базовые модели с применением производных финансовых инструментов

Владеть

- навыками сбора и обработки информации о производных финансовых инструментах
- понятийным аппаратом, профессиональной терминологией, навыками составления аналитического отчета, выступления с научным сообщением

Общая трудоемкость освоения дисциплины составляет 3 зачетные единицы.