

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ Б1.В.11 ПРОИЗВОДНЫЕ ФИНАНСОВЫЕ ИНСТРУМЕНТЫ

Автор: к.ф.-м.н., доцент В.Б.Минасян

Код и наименование направления подготовки: 38.04.08 Финансы и кредит

Профиль: Прикладные корпоративные финансы

Квалификация (степень) выпускника: магистр

Форма обучения: очная

Цель освоения дисциплины:

Сформировать компетенции

ПК-3- Способность разработать и обосновать финансово-экономические показатели, характеризующие деятельность коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно-правовых форм, включая финансово-кредитные, органов государственной власти и местного самоуправления и методики их расчета.

План курса:

Тема 1. Финансовые рынки и производные инструменты.

Вводятся понятия форвардных и фьючерсных контрактов. Длинные и короткие позиции по контракту. Закрывание открытой фьючерсной позиции. Эффект финансового рычага.

Тема 2. Оценка и анализ фьючерсных контрактов.

Ценообразование фьючерсов на активы, не приносящие дохода. Возможность совершения арбитражных операций. Операции «cash-and-carry» и обратная операция «cash-and-carry».

Тема 3. Оценка и анализ опционов.

Стоимость опциона колл на дату истечения контракта. Чистая прибыль покупателя и продавца опциона колл на дату истечения контракта.

Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:

В ходе реализации дисциплины Б1.В.11 Производные финансовые инструменты используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

Рынки производных инструментов, классификация контрактов	Опрос
Форвардные контракты	Опрос, Контрольная работа, Практические задачи

Рынок фьючерсных контрактов	Опрос, Контрольная работа, Практические задачи
-----------------------------	--

Промежуточная аттестация проводится в форме зачета с оценкой с применением следующих методов: письменного ответа на вопросы и решения расчетного задания.

Основная литература:

1. Лимитовский М.А. Инвестиционные проекты и реальные опционы на развивающихся рынках: учеб.-практич.пособие.- 5-е изд., перераб. и доп. - М.: ЮРАЙТ, 2016 <https://www.biblio-online.ru/book/46E3DAF4-2C61-4804-9C60-DB5396084A34>
2. Лукашов А. IPO от I до O [Электронный ресурс]: пособие для финансовых директоров и инвестиционных аналитиков/ А. Лукашов, А. Могин— Электрон. текстовые данные.— М.: Альпина Паблишер, Альпина Бизнес Букс, 2016.— 361 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/42663.html>.— ЭБС «IPRbooks»
3. Пер. Зуев Б. Деривативы [Электронный ресурс]: курс для начинающих/ — Электрон. текстовые данные.— М.: Альпина Паблишер, 2016.— 208 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/42069.html>.— ЭБС «IPRbooks»