

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

К.М.11.ДВ.02.02 Управление рисками чрезвычайных ситуаций

Автор: к.э.н. Спицына Т.А.

Код и наименование направления подготовки профиля: 41.03.05 Международные отношения, Международные программы устойчивого развития

Квалификация (степень) выпускника: бакалавр

Форма обучения: очная

Цель освоения дисциплины: сформировать компетенции в области создания и поддержки безопасных условий жизнедеятельности, в том числе при возникновении чрезвычайных ситуаций: УК ОС-8; в области участия в управлении международными проектами и программами устойчивого развития: ПКр-4

План курса:

Тема 1. Производные финансовые инструменты и особенности их оборота на российском рынке ценных бумаг

Понятие и классификация производных финансовых инструментов на фондовом рынке (рынке ценных бумаг).

Опцион. Опцион колл. Опцион пут. Премия «за отказ». Отличия европейского и американского опционов. Оценка стоимости опционов. Временная стоимость опциона. Биноминальная модель. Действительная стоимость опционов колл и пут. Модель Блэка-Шоулза. Основные опционные стратегии.

Фьючерс. Особенности фьючерсного контракта по сравнению с опционом. Расчет стоимости фьючерсного контракта. Финансовые фьючерсы. Краткосрочный финансовый фьючерс. Долгосрочный финансовый фьючерс. Валютный финансовый фьючерс.

Депозитарные расписки.

Тема 2. Сделки с ценными бумагами на фондовом рынке (рынке ценных бумаг)

Сущность и классификация сделок с ценными бумагами. Кассовые сделки. Срочные сделки. Срочные сделки «на разницу». Срочные форвардные сделки. Пролонгационные сделки.

Сделки с залогом. Сделки с премией.

Опционные сделки. Простые опционные сделки. Спрэд. Вертикальный спрэд. Горизонтальный (календарный) спрэд. Диагональный спрэд. Комбинации опционов. Синтетическая опционная модель.

Фьючерсные сделки.

Сделка с репортом. Сделка с депортом.

Стеллажные сделки.

Игры на повышение курса акций. Игры на понижение курса акций.

Сплит.

Тема 3. Инвестиционный портфель: понятие, цель, задачи, принципы и этапы формирования. Классификация портфелей ценных бумаг.

Понятие и основная цель формирования инвестиционного портфеля (портфеля

ценных бумаг). Задачи формирования инвестиционного портфеля.

Классификация портфелей ценных бумаг. Портфель роста. Портфель дохода. Комбинированный портфель. Агрессивный портфель. Умеренный портфель. Консервативный портфель.

Принципы формирования инвестиционного портфеля: безопасность, доходность, рост и ликвидность.

Этапы формирования портфеля ценных бумаг. Выбор оптимального типа портфеля. Оценка приемлемого сочетания риска и дохода портфеля. Определение количественного и первоначального состава портфеля. Выбор схемы управления портфелем.

Тема 4. Доходность портфеля ценных бумаг: методы и модели расчета

Доходность ценных бумаг. Модель Гарри Марковица. Ожидаемая доходность. Стандартное отклонение (мера риска).

Статистические методы определения доходности инвестиционного портфеля: ковариация и корреляция.

Выбор состава оптимального портфеля ценных бумаг. Определение риска ценной бумаги и риска инвестиционного портфеля. Метод Марковица.

Индексная модель Шарпа и алгоритм Марковица-Тобина.

Алгоритмы Элтона-Груббера-Падберга.

Формы текущего контроля и промежуточной аттестации

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
УК ОС-8	Способность создавать и поддерживать безопасные условия жизнедеятельности, в том числе при возникновении чрезвычайных ситуаций	УК ОС-8.3	Способность создавать и поддерживать безопасные условия жизнедеятельности, в том числе при возникновении чрезвычайных ситуаций, с помощью системы страхования
ПКр-4	Способность к участию в управлении международными проектами и программами устойчивого развития	ПКр-4.8	Способность к участию в управлении международными проектами и программами устойчивого развития на профессиональном уровне

Показатели и критерии оценивания компетенций на различных этапах их формирования

Этап освоения компетенции	Показатель оценивания	Критерий оценивания
УК ОС-8.3	знает нормативно-правовые документы в сфере страхования и страховой деятельности	знает глубоко нормативно-правовые документы в сфере страхования и страховой деятельности
	умеет использовать на профессиональном уровне нормативно-правовые документы в сфере страхования и страховой деятельности	умеет практически использовать на профессиональном уровне нормативно-правовые документы в сфере страхования и страховой деятельности

Этап освоения компетенции	Показатель оценивания	Критерий оценивания
	владеет навыками практического применения нормативно-правовых документов в сфере страхования и страховой деятельности	полностью владеет навыками практического применения нормативно-правовых документов в сфере страхования и страховой деятельности
ПКр-4.8	знает основы управления международными проектами и программами устойчивого развития	знает досконально основы управления международными проектами и программами устойчивого развития
	умеет применить инструментарий управления международными проектами и программами устойчивого развития	умеет практически применить инструментарий управления международными проектами и программами устойчивого развития
	владеет методикой управления международными проектами и программами устойчивого развития	владеет полностью методикой управления международными проектами и программами устойчивого развития

Формы текущего контроля: опрос, коллоквиум, тестирование, контрольная работа

Форма промежуточной аттестации: зачет

Основная литература:

1. П.Л.Виленский, В.Н.Лившиц, С.А.Смоляк. Оценка рисков инвестиционного проекта: теория и практика. // Учебное пособие, 5-е издание. – М.: Поли Принт Сервис, 2015 г. – 1300 стр.
2. А.В. Тебекин, Я.В. Вайтенков, П.А. Тебекин. Управление рисками инновационно-инвестиционных проектов /. - М.: Русайнс, 2018. - 160 с.
- 1.