

Аннотация учебной дисциплины «ПРОИЗВОДНЫЕ ФИНАНСОВЫЕ ИНСТРУМЕНТЫ»

**для слушателей программы профессиональной переподготовки
«Рынок ценных бумаг и производных финансовых
инструментов: стратегии управления»**

Пояснительная записка

Цели освоения дисциплины

Цель данного курса – познакомить студентов с принципами организации и механизмами функционирования срочного рынка, а также представить различные теоретические и практические аспекты использования производных финансовых инструментов участниками финансового рынка.

В результате освоения дисциплины студент должен:

- Знать основные понятия, связанные с рынком производных инструментов, а также функции и структуру рынка, задачи его участников;
- Уметь использовать производные финансовые инструменты в практике финансового управления и в инвестиционном анализе;
- Уметь использовать прикладные модели рынка производных финансовых инструментов в решении практических задач управления финансовыми рисками;
- Иметь навыки (приобрести опыт) анализа и моделирования финансовых ситуаций, предполагающих использование производных финансовых инструментов.

Для освоения учебной дисциплины, студенты должны владеть следующими знаниями и компетенции:

- знать основные понятия экономической теории и прикладных экономических дисциплин; закономерности функционирования современной экономики на макро и микро уровнях; основные особенности российской экономики, направления экономической политики государства;
- уметь использовать основные положения и методы социальных, гуманитарных и экономических наук при решении социальных и профессиональных задач, быть способным анализировать социально значимые проблемы и процессы

Тематическое содержание дисциплины

Тема 1. Производные финансовые инструменты. Введение и основные понятия

Тема 2. Финансовый инжиниринг. Использование методов теории вероятностей и финансовой математики в процессе работы с ПФР.

Тема 3. Классические биржевые и внебиржевые ПФР: форвард, фьючерс, своп.

Тема 4. Опционы. Основные классы опционов, торговые стратегии с использованием опционов.

Тема 5. Теория ценообразования опционов.

Тема 6. Приложения ПФР: нефинансовые активы и биржевые товары, реальные опционы.

Учебно-методическая литература

Базовый учебник

Буренин А.Н. Рынок производных инструментов.- М.: 1 Федеративная Книготорговая Компания, 1998

Основная литература:

1. Джон К.Халл. Опционы, фьючерсы и другие производные инструменты.- М.: Издательский дом Вильямс, 2008
2. Галанов В.А. Производные финансовые инструменты.- М.:Инфра-М, 2011
3. «Энциклопедия финансового риск-менеджмента». Под редакцией А. А. Лобанова, А. В. Чугунова, Издательства: Альпина Бизнес Букс, Альпина Паблишерз, 2009
4. Рынок ценных бумаг. Под ред. Н.И. Берзона - М.: Юрайт, 2017
- 5.Stulz, Rene, «Risk Management and Derivatives», South-Western, Mason, OH, 2003
- 6.The FRM Handbook, 6th Edition

Дополнительная литература:

1. С. Росс и др. Основы корпоративных финансов. Пер с англ. М.: Лаборатория базовых знаний, 2000
2. Модильяни Ф., Миллер М. Сколько стоит фирма? Пер с англ. М.: Дело. 1999
3. Марковиц Г., Шарп У. Инвестиционный портфель и фондовый рынок. Пер с англ. М.: Дело. 1999
- 4.Шарп У., Александер Г., Бэйли Дж. Инвестиции. Пер. с англ. - М.: ИНФРА - М, 1997
- 5.Колб Р., Родригес Р. Финансовые институты и рынки: Учебник. Пер. с англ. – М.: Издательство «Дело и сервис», 2003