

Аннотация рабочей программы дисциплины «Производные финансовые инструменты»

Цель дисциплины «Производные финансовые инструменты» (ПФИ) - формирование комплекса знаний об организационных, научных и методических основах функционирования отечественных и зарубежных рынков производных финансовых инструментов.

Задачи дисциплины

- определить в рамках выбранного алгоритма эффективность применения ПФИ, рассмотреть особенности конкретных видов ПФИ, возможность их использования в конкретной практике хозяйствующих субъектов;
- предложить способы решения экономических задач при работе на фондовом рынке с применением ПФИ;
- изучить новейшие финансово-экономические теории в области функционирования рынка ПФИ;
- разработать и обосновать целевой инвестиционный портфель и стратегию поведения экономических операций;
- обосновать формирование инвестиционного портфеля на основе анализа финансово-экономических рисков

Тема. Основные вопросы.

Введение в деривативы:

1. Базовые понятия деривативов.
2. Объективные условия функционирования рынков ПФИ и их роль в экономике.
3. Функции рынков ПФИ.
4. Возникновение срочного рынка в РФ и его современные тенденции.
5. Основы законодательства о торговле ПФИ.
6. Участники рынка ПФИ и их взаимодействие

Фьючерсные контракты:

1. Понятие. Основные характеристики.
2. Стандартизация фьючерсов.
3. Фьючерс и форвард.
4. Операции с фьючерсами.

Опционные контракты и иные ПФИ:

1. Понятие. Общая характеристика.
2. Внутренняя структура.
3. Обыкновенные и обращающиеся инструменты
4. Классические и экзотические инструменты
5. Характеристика иных ПФИ

Стоимости (цены) производных:

1. Общие положения
2. Стоимости, цены и ценообразование опционов
3. Стоимость цены и ценообразование фьючерсов
4. Стоимость и цены свопов

Технологии для торговли опционами:

1. Производные и риски (рыночные, кредитные)
2. Технологии для торговли классическими опционами
3. Элементные технологии для торговли опционами
4. Комбинированные технологии для торговли опционами

Технологии для торговли фьючерсами:

1. Технологии в операциях хеджирования
2. Технологии в операциях арбитража и спекуляции

Объем дисциплины 4 з. е.

Форма промежуточного контроля – экзамен