

Сибирский институт управления – филиал РАНХиГС

Кафедра экономики и инвестиций

**АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ  
ДИСЦИПЛИНЫ**

**ПРОИЗВОДНЫЕ ФИНАНСОВЫЕ  
ИНСТРУМЕНТЫ**

Б1.В.ДВ.04.01

краткое наименование дисциплины – не устанавливается

по направлению подготовки 38.03.01 Экономика

направленность (профиль): «Инвестиционный анализ и управление проектами»

квалификация: Бакалавр

формы обучения: очная

Год набора 2021

**Авторы – составители:**

к. экон. н., доцент, доцент кафедры экономики и инвестиций С. Н. Чирихин

Новосибирск, 2021

**Цель освоения дисциплины:**

Сформировать компетенцию, необходимую при осуществлении профессиональной деятельности - способен анализировать источники финансирования инвестиционного проекта, оценивать потоки проекта и обязательные платежи применительно к выбранной юридической схеме инвестиционного проекта

**План курса:****Тема 1.1. Отличительные свойства производного финансового инструмента**

Сущность ПФИ. Цели использования ПФИ в экономике. Инвестиционные свойства ПФИ.

**Тема 1.2. Виды ПФИ.**

Форварды, фьючерсы, опционы, свопы. Экзотические ПФИ

**Тема 1.3. Доходность и риск ПФИ.**

Правило определения доходности и риска ПФИ. Доходность и риск форвардных контрактов, фьючерсных контрактов, опционных контрактов.

**Раздел 2 Оценка стоимости ПФИ****Тема 2.1. Общие принципы оценки стоимости ПФИ.**

Понятие базового актива. Влияние изменение стоимости базового актива на стоимость ПФИ. Основные правила расчета стоимости ПФИ.

**Тема 2.2. Особенности оценки различных видов ПФИ.**

Особенности оценки валютных ПФИ, ПФИ акций и облигаций, ПФИ драгоценных металлов.

**Формы текущего контроля и промежуточной аттестации**

Тема (раздел)	Методы текущего контроля успеваемости
<i>Раздел 1</i>	<i>Понятие производного финансового инструмента (ПФИ)</i>
1.1 Отличительные свойства производного финансового инструмента	Устные ответы на вопросы
1.2 Виды ПФИ	Устные ответы на вопросы.
1.3 Доходность и риск ПФИ	Устные ответы на вопросы. Письменное выполнение расчетного задания
<i>Раздел 2</i>	<i>Оценка стоимости ПФИ</i>
2.1 Общие принципы оценки стоимости ПФИ	Устные ответы на вопросы. Письменное выполнение расчетного задания
2.2 Особенности оценки различных видов ПФИ	Устные ответы на вопросы. Письменное выполнение расчетного задания

Промежуточная аттестация проводится в форме зачета с оценкой.

**Основная литература:**

1. 1. Бабайцев, В. А. Математические методы финансового анализа : учебное пособие для вузов / В. А. Бабайцев, В. Б. Гисин. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 215 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-08074-2. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <http://bibli-online.ru/bcode/455099> (дата обращения: 16.12.2020)

2. 2. Гузнов, А. Г. Регулирование, контроль и надзор на финансовом рынке в Российской Федерации : учебное пособие для вузов / А. Г. Гузнов, Т. Э. Рождественская. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 500 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-09973-7. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <http://biblio-online.ru/bcode/452365> (дата обращения: 16.12.2020)
3. 3. Иванченко, И. С. Производные финансовые инструменты: оценка стоимости деривативов : учебник для вузов / И. С. Иванченко. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 261 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-11386-0. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <http://biblio-online.ru/bcode/457041> (дата обращения: 16.12.2020).