

**Бюджетное учреждение высшего образования**  
Ханты-Мансийского автономного округа-Югры  
"Сургутский государственный университет"

УТВЕРЖДАЮ  
Проректор по УМР

\_\_\_\_\_ Е.В. Коновалова

16 июня 2022 г., протокол УС №6

## Производные финансовые инструменты рабочая программа дисциплины (модуля)

Закреплена за кафедрой **Финансов, денежного обращения и кредита**

Учебный план **b380301-ФиК-22-4.plx**  
**38.03.01 ЭКОНОМИКА**  
направленность (профиль): Финансы и кредит

Квалификация **Бакалавр**

Форма обучения **очная**

Общая трудоемкость **2 ЗЕТ**

Часов по учебному плану **72**  
в том числе:  
аудиторные занятия **24**  
самостоятельная работа **48**

Виды контроля в семестрах:  
зачеты **8**

### Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	8 (4.2)		Итого	
	уп	рп		
Неделя	10			
Вид занятий	уп	рп	уп	рп
Лекции	8	8	8	8
Практические	16	16	16	16
В том числе инт.	6	6	6	6
Итого ауд.	24	24	24	24
Контактная работа	24	24	24	24
Сам. работа	48	48	48	48
Итого	72	72	72	72

Программу составил(и):

*к.э.н., доцент, Галюта О.Н.; преподаватель, Дорожкин П.В.*

Рабочая программа дисциплины

**Производные финансовые инструменты**

разработана в соответствии с ФГОС:

Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования по направлению подготовки 38.03.01 ЭКОНОМИКА (уровень бакалавриата) (приказ Минобрнауки России от 12.11.2015 г. № 1327)

составлена на основании учебного плана:

38.03.01 ЭКОНОМИКА

направленность (профиль): Финансы и кредит

утвержденного учебно-методическим советом вуза от 16.06.2022 протокол № 6.

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры

**Финансов, денежного обращения и кредита**

Зав. кафедрой д.э.н. профессор Каратаев А.С.

**1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ**

1.1	Сформировать теоретические и практические навыки у студентов по основным видам производных финансовых инструментов, дать общее представление о функционировании рынка производных финансовых инструментов; научить с помощью современных технических средств и информационных технологий рассчитывать и анализировать основные показатели, характеризующие состояние данного рынка и качество его инструментов.
-----	---

**2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП**

Цикл (раздел) ООП:	Б1.В.ДВ.14
<b>2.1</b>	<b>Требования к предварительной подготовке обучающегося:</b>
2.1.1	Финансовые рынки
2.1.2	Финансовые риски
2.1.3	Инвестиции и инвестиционная деятельность
2.1.4	Моделирование рынка ценных бумаг
<b>2.2</b>	<b>Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:</b>
2.2.1	Технический анализ на рынке ценных бумаг
2.2.2	Производственная практика, научно-исследовательская работа

**3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

**ПК-10: способностью использовать для решения коммуникативных задач современные технические средства и информационные технологии**

**В результате освоения дисциплины обучающийся должен**

<b>3.1</b>	<b>Знать:</b>
3.1.1	- сущность и виды производных финансовых инструментов;
3.1.2	- принципы организации торговли на рынках разных видов производных финансовых инструментов;
3.1.3	- информационные ресурсы рынка производных финансовых инструментов;
3.1.4	- подходы к ценообразованию основных производных финансовых инструментов;
3.1.5	- основные риски производных финансовых инструментов и способы их снижения;
3.1.6	- современные технические средства и информационные технологии используемые в сборе, обработке и анализе данных, необходимых для расчета экономических показателей на рынке производных финансовых инструментов.
<b>3.2</b>	<b>Уметь:</b>
3.2.1	- с помощью современных технических средств собирать, обрабатывать и анализировать данные, необходимые для расчета экономических показателей на рынке производных финансовых инструментов;
3.2.2	- самостоятельно рассчитывать цены, оценивать и анализировать риски производных финансовых инструментов.
<b>3.3</b>	<b>Владеть:</b>
3.3.1	- навыками практического применения современных методов и инструментов финансового анализа;
3.3.2	- инструментами офисных информационных технологий для построения сложных финансовых моделей.

**4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

Код занятия	Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр / Курс	Часов	Компетенции	Литература	Примечание
	<b>Раздел 1.</b>					
1.1	Понятие и сущность производных финансовых инструментов /Пр/	8	2	ПК-10	Л1.1 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2	
1.2	Понятие и сущность производных финансовых инструментов /Лек/	8	2	ПК-10	Л1.1 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2	

1.3	Понятие и сущность производных финансовых инструментов /Ср/	8	6	ПК-10	Л1.1 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2
1.4	Рынок производных финансовых инструментов /Лек/	8	1	ПК-10	Л1.1 Л1.2 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2
1.5	Рынок производных финансовых инструментов /Пр/	8	2	ПК-10	Л1.1 Л1.2 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2
1.6	Рынок производных финансовых инструментов /Ср/	8	4	ПК-10	Л1.1 Л1.2 Л1.4Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2
1.7	Форвардные контракты. Ценообразование форвардного контракта. /Лек/	8	1	ПК-10	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2
1.8	Форвардные контракты. Ценообразование форвардного контракта. /Пр/	8	2	ПК-10	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э2
1.9	Форвардные контракты. Ценообразование форвардного контракта. /Ср/	8	6	ПК-10	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2
1.10	Фьючерсы. Рынок фьючерсных контрактов /Лек/	8	1	ПК-10	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2
1.11	Ценообразование фьючерсных контрактов и оценка рисков /Пр/	8	2	ПК-10	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2
1.12	Ценообразование фьючерсных контрактов и оценка рисков /Ср/	8	6	ПК-10	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2
1.13	Опционы. Рынок опционов /Лек/	8	1	ПК-10	Л1.1 Л1.2 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2
1.14	Ценообразование опционов и оценка рисков. /Пр/	8	2	ПК-10	Л1.1 Л1.2 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Э1 Э2
1.15	Ценообразование опционов и оценка рисков. /Ср/	8	10	ПК-10	Л1.1 Л1.2 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2

1.16	Свопы. Рынок свопов. /Лек/	8	2	ПК-10	Л1.1 Л1.2 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2	
1.17	Свопы. Рынок свопов. /Пр/	8	2	ПК-10	Л1.1 Л1.2 Л1.5Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2	
1.18	Свопы. Рынок свопов. /Ср/	8	8	ПК-10	Л1.1 Л1.2 Л1.4 Л1.5Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2	
1.19	Экзотические производные финансовые инструменты и инструменты, защищающие от кредитного риска. /Лек/	8	0	ПК-10	Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2	
1.20	Экзотические производные финансовые инструменты и инструменты, защищающие от кредитного риска. /Пр/	8	4	ПК-10	Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2	
1.21	Экзотические производные финансовые инструменты и инструменты, защищающие от кредитного риска. /Ср/	8	8	ПК-10	Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2	
1.22	/Контр.раб./	8	0	ПК-10	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1Л3.1 Э1 Э2	Контрольная работа
1.23	/Зачёт/	8	0	ПК-10	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Э1 Э2	

## 5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

### 5.1. Контрольные вопросы и задания

Представлено отдельным документом

### 5.2. Темы письменных работ

Представлено отдельным документом

### 5.3. Фонд оценочных средств

Представлено отдельным документом

## 6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

### 6.1. Рекомендуемая литература

#### 6.1.1. Основная литература

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Колич-во
--	---------------------	----------	-------------------	----------

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Колич-во
Л1.1	Галанов В.А.	Производные финансовые инструменты: Учебник	Электронный ресурс	1
Л1.2	Михайлов А.Ю.	Производные финансовые инструменты: Учебное пособие	Электронный ресурс	1
Л1.3	Дыхова А. Л.	Рынок ценных бумаг: методические рекомендации для подготовки к практическим занятиям и организации самостоятельной работы студентов	Электронный ресурс	1
Л1.4	Берзон Н. И., Аршавский А. Ю., Галанова А. В., Касаткин Д. М., Красильников А. С., Курочкин С. В., Меньшиков С. М., Столяров А. И.	Рынок ценных бумаг: Учебник для вузов	Электронный ресурс	1
Л1.5	Иванченко И. С.	Производные финансовые инструменты: оценка стоимости деривативов: Учебник для вузов	Электронный ресурс	1

#### 6.1.2. Дополнительная литература

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Колич-во
Л2.1	Чалдаева Л. А., Килячков А. А.	Рынок ценных бумаг: Учебник для вузов	Электронный ресурс	1
Л2.2	Сорокин А. И.	Производные финансовые инструменты в управлении рисками компании: учебное пособие	Электронный ресурс	1
Л2.3	Смирнов И. Ф.	Производные ценные бумаги	Электронный ресурс	1
Л2.4	Комкова, И. Н.	Ценные бумаги в инвестировании: учебное пособие для студентов магистратуры направления «экономика»	Электронный ресурс	1

#### 6.1.3. Методические разработки

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Колич-во
Л3.1	Алехин Б. И.	Рынок ценных бумаг: Учебник и практикум для вузов	Электронный ресурс	1

#### 6.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"

Э1	Официальный сайт Центрального банка РФ <a href="https://www.cbr.ru/">https://www.cbr.ru/</a>
Э2	Московская биржа <a href="https://www.moex.com/">https://www.moex.com/</a>
Э3	
<b>6.3.1 Перечень программного обеспечения</b>	
6.3.1.1	Пакет прикладных программ Microsoft Office
6.3.1.2	Операционная система Windows
<b>6.3.2 Перечень информационных справочных систем</b>	
6.3.2.1	<a href="http://www.consultant.ru/">http://www.consultant.ru/</a> Справочно-правовая система Консультант Плюс
6.3.2.2	<a href="http://www.garant.ru">http://www.garant.ru</a> Информационно-правовой портал Гарант.ру

<b>7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)</b>	
7.1	Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа; лабораторных занятий: групповых и индивидуальных консультаций; текущего и промежуточного контроля и промежуточной аттестации оснащена: комплект специализированной учебной мебели; доска; комплект переносного мультимедийного оборудования - компьютер; проектор; проекционный экран; компьютеры с возможностью выхода в Интернет и доступом в электронную информационно-образовательную среду.