

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Косенок Сергей Михайлович  
Должность: ректор  
Дата подписания: 19.06.2024 06:57:58  
Уникальный программный ключ:  
e3a68f3eaa1e62674b54f4998099d3d6bfdcf836

**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 б380301-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<br>(<Курс>.<Семестр на<br>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<br>Л2.2 Л2.3<br>Л2.4Л3.1<br>Э1 Э2 |            |
| 1.2         | Понятие и сущность производных финансовых инструментов /Лек/ | 8              | 2     | ПК-10       | Л1.1 Л1.4Л2.1<br>Л2.2 Л2.3<br>Л2.4Л3.1<br>Э1 Э2 |            |

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

|      |   |   |   |       |   |                    |
|------|---|---|---|-------|---|--------------------|
| 1.16 | Свопы. Рынок свопов. /Лек/  | 8 | 2 | ПК-10 | Л1.1 Л1.2<br>Л1.5Л2.1 Л2.2<br>Л2.3 Л2.4Л3.1<br>Э1 Э2      |                    |
| 1.17 | Свопы. Рынок свопов. /Пр/   | 8 | 2 | ПК-10 | Л1.1 Л1.2<br>Л1.5Л2.2 Л2.3<br>Л2.4Л3.1<br>Э1 Э2           |                    |
| 1.18 | Свопы. Рынок свопов. /Ср/   | 8 | 8 | ПК-10 | Л1.1 Л1.2 Л1.4<br>Л1.5Л2.2 Л2.3<br>Л2.4Л3.1<br>Э1 Э2      |                    |
| 1.19 | Экзотические производные<br>финансовые инструменты и<br>инструменты, защищающие от<br>кредитного риска. /Лек/ | 8 | 0 | ПК-10 | Л1.2 Л1.3<br>Л1.4Л2.1 Л2.2<br>Л2.3 Л2.4Л3.1<br>Э1 Э2      |                    |
| 1.20 | Экзотические производные<br>финансовые инструменты и<br>инструменты, защищающие от<br>кредитного риска. /Пр/  | 8 | 4 | ПК-10 | Л1.2 Л1.3 Л1.4<br>Л1.5Л2.2 Л2.3<br>Л2.4Л3.1<br>Э1 Э2      |                    |
| 1.21 | Экзотические производные<br>финансовые инструменты и<br>инструменты, защищающие от<br>кредитного риска. /Ср/  | 8 | 8 | ПК-10 | Л1.2 Л1.3 Л1.4<br>Л1.5Л2.1 Л2.2<br>Л2.3 Л2.4Л3.1<br>Э1 Э2 |                    |
| 1.22 | /Контр.раб./  | 8 | 0 | ПК-10 | Л1.1 Л1.2 Л1.3<br>Л1.4Л2.1Л3.1<br>Э1 Э2                   | Контрольная работа |
| 1.23 | /Зачёт/   | 8 | 0 | ПК-10 | Л1.1 Л1.2 Л1.3<br>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.,<br>Аршавский А. Ю.,<br>Галанова А. В.,<br>Касаткин Д. М.,<br>Красильников А. С.,<br>Курочкин С. В.,<br>Меньшиков С. М.,<br>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.,<br>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. |