

Министерство науки и высшего образования РФ  
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение  
высшего образования  
«СИБИРСКИЙ ФЕДЕРАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»  
**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

Б1.В.ДВ.18.04 Оценка производных финансовых  
инструментов

наименование дисциплины (модуля) в соответствии с учебным планом

Направление подготовки / специальность

38.03.01 ЭКОНОМИКА

Направленность (профиль)

38.03.01 ЭКОНОМИКА

Форма обучения

очно-заочная

Год набора

2020

Красноярск 2023

## РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Программу составили \_\_\_\_\_

д-р экон. наук, профессор, Григорьев А.В.

\_\_\_\_\_  
должность, инициалы, фамилия

## 1 Цели и задачи изучения дисциплины

### 1.1 Цель преподавания дисциплины

Основная цель обучения по курсу «ОЦЕНКА ПРОЗВОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ИНСТРУМЕНТОВ» - выработать у студентов системное видение решения стратегических и тактических проблем управления финансовыми потоками фирмы в условиях неопределенности; сформировать систему знаний и практических навыков, необходимых для принятия управленческих решений в этой области.

### 1.2 Задачи изучения дисциплины

Цели изучения дисциплины диктуют круг задач, необходимых для их достижения. Задачи изучения дисциплины раскрываются на основе требований к формированию компетенций сформулированных в федеральном государственном общеобразовательном стандарте высшего образования

### 1.3 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Код и наименование индикатора достижения компетенции	Запланированные результаты обучения по дисциплине
<b>ПК-10: способностью использовать для решения коммуникативных задач современные технические средства и информационные технологии</b>	
ПК-10: способностью использовать для решения коммуникативных задач современные технические средства и информационные технологии	как использовать технологии использовать технологии навыками использования технологий
<b>ПК-8: способностью использовать для решения аналитических и исследовательских задач современные технические средства и информационные технологии</b>	
ПК-8: способностью использовать для решения аналитических и исследовательских задач современные технические средства и информационные технологии	как использовать знания использовать знания навыками использования знаний

### 1.4 Особенности реализации дисциплины

Язык реализации дисциплины: Русский.

Дисциплина (модуль) реализуется без применения ЭО и ДОТ.

## 2. Объем дисциплины (модуля)

Вид учебной работы	Всего, зачетных единиц (акад. час)	е
		1
<b>Контактная работа с преподавателем:</b>	<b>0,28 (10)</b>	
практические занятия	0,28 (10)	
<b>Самостоятельная работа обучающихся:</b>	<b>2,72 (98)</b>	
курсовое проектирование (КП)	Нет	
курсовая работа (КР)	Нет	

### 3 Содержание дисциплины (модуля)

#### 3.1 Разделы дисциплины и виды занятий (тематический план занятий)

		Контактная работа, ак. час.							
№ п/п	Модули, темы (разделы) дисциплины	Занятия лекционного типа		Занятия семинарского типа				Самостоятельная работа, ак. час.	
				Семинары и/или Практические занятия		Лабораторные работы и/или Практикумы			
		Всего	В том числе в ЭИОС	Всего	В том числе в ЭИОС	Всего	В том числе в ЭИОС	Всего	В том числе в ЭИОС
<b>1. Теоретические основы оценки производных финансовых инструментов</b>									
	1. 1.1.Этапы развития производных финансовых инструментов 1.2.Типы сделок 1.3.Принципы оценки								
	2. 1.1.Этапы развития производных финансовых инструментов 1.2.Типы сделок 1.3.Принципы оценки			2					
	3. 1.1.Этапы развития производных финансовых инструментов 1.2.Типы сделок 1.3.Принципы оценки							20	
<b>2. Финансовые фьючерсы</b>									
	1. 2.1.Сделки форвардного кэша 2.2.Сделки форвардного кредита								

2. 2.1.Сделки форвардного кэша 2.2.Сделки форвардного кредита			2					
3. 2.1.Сделки форвардного кэша 2.2.Сделки форвардного кредита							25	
<b>3. Свопы</b>								
1. 3.1.Простой процентный своп 3.2.Кредитные свопы								
2. 3.1.Простой процентный своп 3.2.Кредитные свопы			2					
3. 3.1.Простой процентный своп 3.2.Кредитные свопы							25	
<b>4. Опционы</b>								
1. 4.1.Модель Блэка-Шоулза-Мертон 4.2.Биномиальная модель								
2. 4.1.Модель Блэка-Шоулза-Мертон 4.2.Биномиальная модель			4					
3. 4.1.Модель Блэка-Шоулза-Мертон 4.2.Биномиальная модель							28	
Всего			10				98	

## **4 Учебно-методическое обеспечение дисциплины**

### **4.1 Печатные и электронные издания:**

1. Руйга И. Р., Зиненко А. В., Сабодах И. В. Финансовая безопасность корпоративного сектора: учебно-методическое пособие(Красноярск: СФУ).
2. Яковлев А. И. Теория денег: от золота к криптосистеме обмена(Санкт-Петербург: Издательство Санкт-Петербургского университета).

### **4.2 Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в том числе отечественного производства (программное обеспечение, на которое университет имеет лицензию, а также свободно распространяемое программное обеспечение):**

1. Microsoft Office

### **4.3 Интернет-ресурсы, включая профессиональные базы данных и информационные справочные системы:**

1. Студентам обеспечена возможность свободного доступа к фондам учебно-методической документации и интернет ресурсам. Все обучающиеся имеют открытый доступ к базе Электронного каталога и полнотекстовой базе данных внутривузовских изданий (<http://lib.sfu-kras.ru/>); ресурсам Виртуальных читальных залов (<http://lib.sfu-kras.ru/eresources/virtual.php>); к УМКД (<http://lib.sfu-kras.ru/ecollections/umkd.php>); к видеолекциям и учебным фильмам университета (<http://tube.sfu-kras.ru/>); к учебно-методическим материалам институтов.
2. Студентам предоставлены условия и возможности работы в режиме on-line с зарубежными и отечественными лицензионными информационными базами данных по профилю образовательных программ СФУ.
3. - Cambridge University Press  
<http://www.journals.cambridge.org/archives/>
4. - EBSCO Publishing <http://search.ebscohost.com/>
5. - Elsevier (журналы открытого доступа)  
<http://www.sciencedirect.com/>
6. - Institute of Physics <http://iopscience.iop.org/journals?type=archive>
7. - JSTOR <http://www.jstor.org/action/showJournals?browseType=collectionInfoPage&selectCollection=as&>
8. - Nature Publishing Group <http://www.nature.com/>
9. - Oxford University Press (Oxford Journals)  
<http://www.oxfordjournals.org/>
10. - ELSEVIER (SCOPUS) <http://www.scopus.com/home.url>
11. - QPAT - патентная база компании Questel  
<http://www.qpat.com/index.htm>

12. - Royal Society of Chemistry (RSC) - Королевское химическое общество (Журналы открытого доступа) <http://pubs.rsc.org/en/Journals?key=Title&value=Current>
13. - AAAS: Журнал «Science» <http://www.sciencemag.org/magazine>
14. - Электронные журналы издательства Sage Publications <http://online.sagepub.com/>
15. - Springer, Kluwer <http://link.springer.com/>
16. - Taylor&Francis <http://www.tandfonline.com/>
17. - Архив научных публикаций arXiv.org <http://arxiv.org/>
18. - Информационно-аналитическая система "Статистика"
19. <http://www.ias-stat.ru/module/Free/News.aspx>
20. - Ист Вью (eastview) <http://www.ebiblioteka.ru/search/simple>
21. - Научная электронная библиотека: Российские академические журналы
22. - (elibrary.RU) <http://elibrary.ru/defaultx.asp>
23. - Университетская информационная система Россия (УИС РОССИЯ)
24. - <Http://uisrussia.msu.ru/is4/main.jsp>
25. - Электронная библиотека издательского дома "Гребенников" <http://grebennikon.ru/>
26. - POLPRED.COM <http://polpred.com/?Ns=1>

## **5 Фонд оценочных средств**

Оценочные средства находятся в приложении к рабочим программам дисциплин.

## **6 Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)**

Осуществление образовательного процесса по дисциплине «Управление рисками» предусматривает использование специальных помещений: учебных аудиторий из аудиторного фонда ФГАОУ ВО «Сибирский федеральный университет» для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, а также помещений для самостоятельной работы. Специальные помещения укомплектованы специализированной мебелью и техническими средствами обучения, служащими для представления учебной информации большой аудитории.

Для проведения занятий лекционного типа предлагаются наборы демонстрационного оборудования и учебно-наглядных пособий, обеспечивающие тематические иллюстрации, соответствующие рабочей учебной программе дисциплины.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду организации через систему Wi-Fi.