

АННОТАЦИЯ УЧЕБНЫХ ДИСЦИПЛИН МАГИСТЕРСКОЙ ПРОГРАММЫ «ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ И ИНСТИТУТЫ»

«Финансовые инновации и деривативы»

ФИО преподавателя: Байдина О. С., к.э.н.

Входные требования для освоения дисциплины:

Эта дисциплина основана на знаниях, навыках и умениях, приобретенных в ходе изучения следующих дисциплин:

1. Макроэкономика и микроэкономика (понимание базовых основ функционирования экономических систем)
2. Управление организацией (понимание места управления рисками в процессе управления организацией)
3. Финансовые рынки (понимание функционирования финансовых инструментов, их характеристики и основные параметры, методы торговли и виды торговых площадок, навыки расчета дюрации облигаций, цены опциона, дохода от опционных стратегий)
4. Статистика (понимание принципов изучения массовых явлений, знание методов построения и анализа основных статистических показателей, знание основных методов обработки и анализа данных, способность использовать их в профессиональной деятельности)
5. Эконометрика (систематические теоретические знания и практические навыки в области современных методов эконометрического моделирования и анализа социально-экономических процессов, которые позволяют использовать их для количественного анализа реальных экономических явлений)
6. Линейная алгебра и математический анализ (знание основных понятий и методов линейной алгебры для вычисления различных количественных характеристик в задачах)

Место дисциплины в учебном плане: по выбору, 4(четвертый)триместр

Краткое содержание дисциплины:

Тема 1. Общие характеристики производных инструментов. Финансовые инновации. Структурированные продукты. Биткойн и виртуальные валюты

Тема 2. Фьючерсные контракты на финансовые инструменты. Система расчетов. Хеджирование (8 часов)

Тема 3. Опционные контракты. Опционные хеджирующие стратегии. Комплексные стратегии опционов. Модель Black Sholes (8 часов)

Тема 4. Свопы (4 часа)

Общая трудоемкость дисциплины: 3 зачетные единицы, 108 часов.

Итоговый контроль: Экзамен