

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Суворов Антон Дмитриевич
Должность: Ректор
Дата подписания: 26.09.2023 11:49:43
Уникальный программный ключ:
a39bdb15d680d3b0adbfced0af5c1efb14747dc0

УТВЕРЖДАЮ
ректор А.Д. Суворов
«28» июня 2023 г.

Протокол Совета программы
«Финансы, инвестиции, банки»
от 05 июня 2023 г. № 3

Аннотация рабочей программы дисциплины

ИНСТРУМЕНТЫ С ФИКСИРОВАННОЙ ДОХОДНОСТЬЮ

Направление подготовки 38.04.01 Экономика Программа «Финансы, инвестиции, банки»

1. Цели и задачи дисциплины

Цель курса – ознакомить студентов с базовой теорией, необходимой для практического анализа инструментов с фиксированной доходностью. Курс концентрируется на анализе высокодоходных и стрессовых облигаций, а также на представлении нескольких сценариев реструктуризации долга. Задача курса – научить студентов рассчитывать цены облигаций и сроки их погашения; студенты получают понимание процентных кривых, общих методов хеджирования и некоторых общих принципов кредитного анализа.

2. Планируемые результаты

В результате освоения дисциплины выпускник должен:

знать инструменты с фиксированной доходностью и стратегии управления портфолио облигаций; стратегии хедж-фондов и традиционных институциональных управляющих активами.

уметь анализировать и оценивать инструменты с фиксированной доходностью; анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о различных процессах и явлениях; осуществлять выбор инструментальных средств для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные выводы.

владеть информацией о высокодоходных облигациях; навыками управления финансовыми активами; современными методиками расчета и статистического анализа показателей, характеризующих финансовые рынки; современными методами сбора, обработки и анализа данных; современными методиками расчета и анализа информации.

3. Компетенции, формируемые дисциплиной

Дисциплина направлена на формирование универсальных компетенций:

УК-1. Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий	Осуществляет критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывает стратегию действий
УК-2. Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	Принимает участие в управлении проектом на всех этапах его жизненного цикла
УК-3. Способен организовывать и руководить работой команды, вырабатывая командную стратегию для достижения поставленной цели	Принимает участие в организации и руководстве работой команды, вырабатывая командную стратегию для достижения поставленной цели
УК-4. Способен применять современные коммуникативные технологии, в том числе на иностранном(ых) языке(ах), для академического и профессионального взаимодействия	Применяет современные коммуникативные технологии, в том числе на иностранном(ых) языке(ах), для академического и профессионального взаимодействия
УК-6. Способен определять и реализовывать приоритеты собственной деятельности и способы ее совершенствования на основе самооценки	Определяет и реализует приоритеты собственной деятельности и способы ее совершенствования на основе самооценки

Дисциплина направлена на формирование общепрофессиональных компетенций:

ОПК-2. Способен применять продвинутое инструментальное экономическое анализ в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях	Применяет продвинутое инструментальное экономическое анализ в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях
ОПК-4. Способен принимать экономически и финансово обоснованные организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и нести за них ответственность	Принимает экономически и финансово обоснованные организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и нести за них ответственность
ОПК-5. Способен использовать современные информационные	Использует современные информационные технологии и

технологии и программные средства при решении профессиональных задач	программные средства при решении профессиональных задач
--	---

Дисциплина направлена на формирование профессиональных компетенций:

ПК-1. Способен организовать торговлю на финансовом рынке	Участвует в разработке и совершенствовании методологии сбора и обработки статистических данных
	Участвует в разработке и совершенствовании систем статистических показателей и методик их расчета
	Участвует в проектировании новых форм статистической отчетности, вопросников и анкет, подготовке инструкций по их заполнению
ПК-2. Способен осуществлять финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг	Предоставляет потребителю финансовых услуг информацию о состоянии и перспективах рынка, тенденциях в изменении курсов ценных бумаг, иностранной валюты, условий по банковским продуктам и услугам
	Разъясняет суть финансовых продуктов, юридических и экономических характеристик финансовых продуктов и услуг
	Обеспечивает взаимодействие структурных подразделений организации при совместной деятельности; участвует в планировании мероприятий, направленных на повышение качества финансового сервиса организации

4. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Инструменты с фиксированной доходностью» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений Блока 1 учебного плана.

Трудоёмкость дисциплины составляет 3 зачётных единицы.

Общий объём академических часов – 108 часов, в том числе:

Лекции – 28 часов,

Семинары – 14 часов.

5. Содержание дисциплины

Процентные ставки. Денежный рынок. Долг. Инструменты.

Основы облигаций. Расчет портфеля облигаций. Хеджирование рисков по

облигациям.

Основы облигаций. Форвардные и фьючерсные цены облигаций. REPO с облигациями. Ценообразование.

Процентные свопы. Основы оценки IRS.

Обмен активами. Основы оценки.

Кредитные дефолтные свопы. Основы оценки CDS.

Обзор курса и обзор рынка ценных бумаг с фиксированным доходом.

Структурированные инструменты с фиксированным доходом: CLO, ABS, MBS.

Обзор текущих вопросов и проблем долгового рынка.

6. Форма промежуточной аттестации

Промежуточная аттестация проходит в форме экзамена.