

Рабочая программа дисциплины «Управление рисками в энергетике-1»

Направление подготовки 38.04.01 Экономика (уровень магистратуры)
для подготовки студентов – магистров очного отделения

Автор - составитель программы: Декан Фантаццини

1. Цели и задачи дисциплины:

А. Цели дисциплины

Иметь представление:

- о наиболее актуальных проблемах современного эконометрического анализа, связанных с анализом динамики экономических показателей и с построением моделей социально-экономических процессов, основанных на моделях так называемых панельных данных;
- о специфике и преимуществах анализа и экономической интерпретации моделей панельных данных по сравнению с анализом и интерпретацией моделей, построенных на данных временного ряда или пространственных данных (“cross-section data”);
- об основных постановках социально - экономических задач в рамках моделей панельных данных и об основных подходах и их решению.

Б. Задачи дисциплины

Знать основные положения:

- теории построения моделей панельных данных;
- методологии их анализа и экономической интерпретации;
- прикладного эконометрического анализа панельных данных.
- теоретические знания к практическому построению социально-экономических моделей в форме моделей панельных данных;
- современные эконометрические пакеты программ, на примере пакета STATA (или Eviews)

2. Информация о месте дисциплины в учебном плане:

- первый курс;
- первый семестр;

3. Форма промежуточной аттестации (зачет);

4. Объем дисциплины:

Курс объемом в 72 часа предусматривает следующие формы проведения занятий:

Лекции 30 ч., семинарские занятия 6 ч., самостоятельная работа 36 ч.; промежуточный контроль проводится в форме четырех контрольных работ, по две в каждом семестре (12 ч.).

5. Тематический план:

| № п/п | Наименование разделов и тем дисциплины |
|-------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. | <i>Форвардные контракты и фьючерсы, торгуемые на фондовых рынках</i> |
| 2. | <i>Энергетические свопы</i> <i>Энергетические опционы</i> |
| 3. | <i>Экзотические опционы</i> |
| 4. | <i>Управление рисками опционов</i> <i>Оценка реальных опционов</i> <i>Хеджирование рисков, связанных с энергоносителями</i> |

6. Перечень компетенций, формируемых в результате освоения дисциплины

владение иностранным языком в устной и письменной форме для осуществления коммуникации в учебной, научной, профессиональной и социально-культурной сферах общения
владение терминологией специальности на иностранном языке; умение готовить публикации, проводить презентации, вести дискуссии и защищать представленную работу на иностранном языке (М-ИК-1);

способность к самостоятельному обучению и разработке новых методов исследования, к изменению научного и научно-производственного профиля деятельности; к инновационной научно-образовательной деятельности (М-СК-3);

способность проводить самостоятельные исследования в соответствии с разработанной программой, уметь осуществлять профессиональную самооценку (М-ПК- 3);

способность разрабатывать стратегии поведения экономических агентов на различных рынках (М-ПК-6);

способность готовить аналитические материалы для оценки мероприятий в области экономической политики и принятия стратегических решений на микро- и макроуровне (М-ПК-7);

способность анализировать и использовать различные источники информации для проведения экономических расчетов (М-ПК-8);

способность разрабатывать варианты управленческих решений и обосновывать их выбор на основе критериев социально-экономической эффективности, (М-ПК-10);

способность к применению теоретических знаний для решения практических проблем рационального и эффективного использования ресурсов при осуществлений экономического выбора (М-ПК-14).

7. Основная литература:

- 1) Steven Errera and Stewart L. Brown. Fundamentals of Trading Energy Futures Options. PennWell Books, 2003
- 2) Robert McDonald. Derivatives Markets. Pearson Education, 2006
- 3) Vincent Kaminski . Managing Energy Price Risk . Risk Books, 2004
- 4) Les Clewlow and Chris Strickland. Energy Derivatives: Pricing and Risk Management London. Lacima Publications, 2000
- 5) Alexander Triantis. Handbook of Modern Finance. Research Institute of America, 2003
- 6) William Bailey, Benoit Couet, Ashish Bhandari, Soussan Faiz, Sunaram Srinivasan and Helen Weeds. Unlocking the Value of Real Options . Oilfield Review Winter , 2003
- 7) Steve Leppard . Energy Risk Management: A non-technical introduction to Energy Derivatives. Risk Books, 2005
- 8) Geoffrey Considine. Introduction to weather derivatives. Weather Derivatives Group, Aquila Energy - CME, 2011
- 9) Kevin Baumert and Mindy Selman. . Data Note: Heating and Cooling Degree Days. World Resources Institute, 2003