

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Ястребов Олег Александрович
Должность: Ректор
Дата подписания: 25.05.2023 14:05:15
Уникальный программный ключ:
ca953a0120d891083f939673078ef1a989dae18a

**Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования
«Российский университет дружбы народов имени Патриса Лумумбы»
Экономический факультет**

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

FINANCIAL RISK MANAGEMENT

Рекомендована МССН для направления подготовки/специальности:

38.04.08 Финансы и кредит

Освоение дисциплины ведется в рамках реализации основной профессиональной образовательной программы высшего образования (ОП ВО):

Современные финансовые технологии в инвестировании и банковском бизнесе

2023 г.

1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Целью освоения дисциплины «**Financial risk management**» является получение знаний и развитие навыков осмысленного применения инструментальных методов анализа мировых финансовых рынков с акцентом на рынок ценных бумаг.

2. ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Освоение дисциплины «**Financial risk management**» направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций (части компетенций):

Таблица 2.1. Перечень компетенций, формируемых у обучающихся при освоении дисциплины (результаты освоения дисциплины)

Шифр	Компетенция	Индикаторы достижения компетенции (в рамках данной дисциплины)
ПКО-1	Способен анализировать и прогнозировать основные социально-экономические показатели, предлагать стратегические направления экономического развития, минимизации рисков, обеспечения финансовой устойчивости организаций и финансовой системы в целом, составлять обзоры и экспертные заключения по вопросам своей профессиональной области	ПКО-1.1 "Способен производить оценку достоверности исходных данных из достоверных источников; работать со служебной документацией специализированных программных комплексах осуществлять анализ цен, факторов и тенденций в инвестиционно-финансовой и банковской сферах, оценку денежных потоков и платежей с учетом требований национального законодательства и международных стандартов и факторов риска" ПКО-1.2 "Способен осуществлять сравнительный анализ источников финансирования, анализ результатов применения конкретных финансовых инструментов; анализ результатов расчетов по разработанным методикам и результатов выполнения конкретных мероприятий" ПКО-1.3 Способен осуществлять планирование финансовых показателей, индикаторов и конкретных мероприятий по результатам проведенного анализа
УК-7	искать нужные источники информации и данные, воспринимать, анализировать, запоминать и передавать информацию с использованием цифровых средств, а также с помощью алгоритмов при работе с полученными из различных источников данными с целью эффективного использования полученной информации для решения задач; проводить оценку	УК-7.1 Осуществляет поиск нужных источников информации и данных, воспринимает, анализирует, запоминает и передает информацию с использованием цифровых средств, а также с помощью алгоритмов при работе с полученными из различных источников данными с целью эффективного использования полученной информации для решения задач УК-7.2 Проводит оценку информации, ее достоверность, строит логические умозаключения на основании поступающих информации и данных

Шифр	Компетенция	Индикаторы достижения компетенции (в рамках данной дисциплины)
	информации, ее достоверность, строить логические умозаключения на основании поступающих информации и данных	

3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОП ВО

Дисциплина «**Financial risk management**» относится к обязательной части блока Б1 ОП ВО (вариативная компонента).

В рамках ОП ВО обучающиеся также осваивают другие дисциплины и/или практики, способствующие достижению запланированных результатов освоения дисциплины «**Financial risk management**».

Таблица 3.1. Перечень компонентов ОП ВО, способствующих достижению запланированных результатов освоения дисциплины

Шифр	Наименование компетенции	Предшествующие дисциплины/модули, практики*	Последующие дисциплины/модули, практики*
ПКО-1	Способен анализировать и прогнозировать основные социально-экономические показатели, предлагать стратегические направления экономического развития, минимизации рисков, обеспечения финансовой устойчивости организаций и финансовой системы в целом, составлять обзоры и экспертные заключения по вопросам своей профессиональной области	Математическое обеспечение инвестиционных решений	Финансовый анализ (продвинутый уровень) обеспечение Управление процессом внедрения финансовых технологий Государственно-частное партнерство Инновационные инструменты финансирования бизнеса Управление портфелем ценных бумаг Преддипломная практика

Шифр	Наименование компетенции	Предшествующие дисциплины/модули, практики*	Последующие дисциплины/модули, практики*
УК-7	искать нужные источники информации и данные, воспринимать, анализировать, запоминать и передавать информацию с использованием цифровых средств, а также с помощью алгоритмов при работе с полученными из различных источников данными с целью эффективного использования полученной информации для решения задач; проводить оценку информации, ее достоверность, строить логические умозаключения на основании поступающих информации и данных	Математическое обеспечение инвестиционных решений	Финансовый анализ (продвинутый уровень) обеспечение Управление процессом внедрения финансовых технологий Государственно-частное партнерство Инновационные инструменты финансирования бизнеса Управление портфелем ценных бумаг Преддипломная практика

* - заполняется в соответствии с матрицей компетенций и СУП ОП ВО

4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ И ВИДЫ УЧЕБНОЙ РАБОТЫ

Общая трудоемкость дисциплины «**Financial risk management**» составляет 3 зачетные единицы.

Таблица 4.1. Виды учебной работы по периодам освоения ОП ВО для **ОЧНОЙ** формы обучения

Вид учебной работы	ВСЕГО, ак.ч.	Семестр(-ы)			
		3			
<i>Контактная работа, ак.ч.</i>	36	36			
в том числе:					
Лекции (ЛК)					
Лабораторные работы (ЛР)					
Практические/семинарские занятия (СЗ)	36	36			
<i>Самостоятельная работа обучающихся, ак.ч.</i>	72	72			
<i>Контроль (экзамен/зачет с оценкой), ак.ч.</i>					
Общая трудоемкость дисциплины	ак.ч.	108	108		

Вид учебной работы	ВСЕГО, ак.ч.	Семестр(-ы)			
		3			
зач.ед.	3	3			

5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Таблица 5.1. Содержание дисциплины (модуля) по видам учебной работы

Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела (темы)	Вид учебной работы*
Information support of financial management	Topic 1. Fundamental concepts of financial management Topic 2. Financial reporting in the financial management system	СЗ - 12
Financial management tactics (current financial decisions)	Topic 3. Working capital management of the organization Topic 4. Operating lever model and profitability planning Topic 5. Sources of short-term financing.	СЗ - 12
Capital structure management and long-term investment decisions	Topic 6. Investment policy of the organization Topic 7. Capital price management. Topic 8. Risk management of capital formation. Topic 9. Models of financial leverage and capital structure management. Topic 10. The company's dividend policy Topic 11. Valuation of the company.	СЗ - 12

* - заполняется только по **ОЧНОЙ** форме обучения: ЛК – лекции; ЛР – лабораторные работы; СЗ – семинарские занятия.

6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Таблица 6.1. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Тип аудитории	Оснащение аудитории	Специализированное учебное/лабораторное оборудование, ПО и материалы для освоения дисциплины (при необходимости)
Компьютерный класс	Компьютерный класс для проведения занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, оснащенная персональными компьютерами (в количестве ___ шт.), доской (экраном) и техническими средствами мультимедиа презентаций.	ауд. 430 Моноблок Lenovo AIO-300-22ISH Intel I5 2200 MHz/8 GB/1000 GB/DVD/audio, монитор 21" MS Windows 10 64bit 86626883 Microsoft Office 2016 86626883 Expert Systems 18487N

Тип аудитории	Оснащение аудитории	Специализированное учебное/лабораторное оборудование, ПО и материалы для освоения дисциплины (при необходимости)
		SAP договор № С-16/15 Корпорация Галактика free Система БЭСТ-ОФИС 40475 Eviews10 70U00460 7-Zip free FastStone Image Viewer free FreeCommander free Adobe Reader free K-Lite Codec Pack free АЛЬТ-Инвест Сумм 8 95326045 АЛЬТ-Финансы 3 80603974 MS Power BI Desktop free

* - аудитория для самостоятельной работы обучающихся указывается

ОБЯЗАТЕЛЬНО!

7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Основная литература:

1. Основы портфельного инвестирования: учебник для бакалавриата и магистратуры / Т. В. Никитина, А. В. Репета-Турсунова, М. Фрёммель, А. В. Ядрин. — 2-е изд., испр. и доп. — М. : Издательство Юрайт, 2019
2. Эконометрика в задачах и решениях [Текст/электронный ресурс] : Учебное пособие для магистров / С.А. Балашова, И.В. Лазанюк. – 2-е изд. -Электронные текстовые данные. - М. : Изд-во РУДН, 2017. - 188 с. : ил. - ISBN 978-5-209-05771-0 : 105.19.
3. Фондовый рынок: курс для начинающих / науч. ред. А. Ильин ; пер. В. Ионов. - 3-е изд. - Москва : Альпина Паблишерз, 2016. - 278 с. : схем., табл., ил. - (Reuters для финансистов). - ISBN 978-5-9614-1460-8 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=85846> (17.09.2018).

Дополнительная литература:

1. Васин С.М., шутов В.С. Управление рисками на предприятии: учебное пособие. – М.: КНОРУС, 2010.
2. Щуклов Л. Финансовый менеджмент в условиях кризиса. Опыт компаний малого и среднего бизнеса, М.: Издательство: Либроком, 2010

3. Норман П. Управляя рисками. Клиринг с участием центральных контрагентов на глобальных финансовых рынках Переводчики: О. Александрова, О. Антонова, Ольга Поборцева, Любовь Сумм, М.: Издательство: Манн, Иванов и Фербер, 2013
4. Пименов Н. Управление финансовыми рисками в системе экономической безопасности, М.: Издательство: Юрайт, 2013
5. Горбунов В. Бизнес-планирование с оценкой рисков и эффективности проектов, М.: Издательство: РИОР, Инфра-М, 2013
6. Финансовые инструменты. / Под ред. Фабоцци Ф. – М.: Эксмо, 2010. – 864 с.
7. Шарп У.Ф., Александер Г., Бейли Дж. Инвестиции: Пер. с англ.- М.: Инфра-М, 2010. – 1028 с.
8. Philippe Jorion. Financial Risk Management Handbook. Wiley.2003.
9. C.Alexander, E.Sheedy. Professional Risk Managers Handbook. Wiley.2005.
10. L.Esch, R.Kieffer, t.Lopez. Asset and Risk Management. Wiley. 2005.
11. K.Horcher. Essencials of Financial Risk Management. Wiley. 2006
12. B.Warwick. The Handbook of Risk. Wiley. 2003.
13. J-P. Bouchaud. Theory of Financial Risks. CambridgeUniversityPress.2001.

Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:

1. ЭБС РУДН и сторонние ЭБС, к которым студенты университета имеют доступ на основании заключенных договоров:

- Электронно-библиотечная система РУДН – ЭБС РУДН <http://lib.rudn.ru/MegaPro/Web>
- ЭБС «Университетская библиотека онлайн» <http://www.biblioclub.ru>
- ЭБС Юрайт <http://www.biblio-online.ru>
- ЭБС «Консультант студента» www.studentlibrary.ru
- ЭБС «Лань» <http://e.lanbook.com/>
- ЭБС «Троицкий мост»

2. Базы данных и поисковые системы:

- электронный фонд правовой и нормативно-технической документации <http://docs.cntd.ru/>
- поисковая система Яндекс <https://www.yandex.ru/>
- поисковая система Google <https://www.google.ru/>
- реферативная база данных SCOPUS <http://www.elsevierscience.ru/products/scopus/>
- <http://www.gks.ru/> – портал Федеральной службы государственной статистики РФ
- <http://www.cbr.ru/> – портал Центрального банка РФ
- <http://data.worldbank.org/> - база данных Мирового банка
- <https://ec.europa.eu/eurostat/data/database> - база данных стран Евросоюза
- <https://www.imf.org/external/datamapper/datasets> - базы данных Международного валютного фонда

Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся при освоении дисциплины/модуля:*

1. Курс лекций по дисциплине «**Financial risk management**».
<https://esystem.rudn.ru/course/view.php?id=2680>

* - все учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся размещаются в соответствии с действующим порядком на странице дисциплины **в ТУИС!**

8. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ И БАЛЛЬНО-РЕЙТИНГОВАЯ СИСТЕМА ОЦЕНИВАНИЯ УРОВНЯ СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Оценочные материалы и балльно-рейтинговая система* оценивания уровня сформированности компетенций (части компетенций) по итогам освоения дисциплины «Эконометрика финансовых рынков» представлены в Приложении к настоящей Рабочей программе дисциплины.

* - ОМ и БРС формируются на основании требований соответствующего локального нормативного акта РУДН.

РАЗРАБОТЧИКИ:

Доцент phd



Вукович Дарко

Должность, БУП

Подпись

Фамилия И.О.

РУКОВОДИТЕЛЬ БУП:

И.о. зав. кафедрой «Финансы
и кредит»



Е.М. Григорьева

Наименование БУП

Подпись

Фамилия И.О.

РУКОВОДИТЕЛЬ ОП ВО:

профессор кафедры
«Финансы и кредит»



А.Я. Быстряков