

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Ястребов Олег Александрович
Должность: Ректор
Дата подписания: 20.06.2022 11:11:29
Уникальный программный код:
ca953a0120d891083f939673078ef1a989dae18a

**Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования «Российский университет дружбы народов»**

Экономический факультет

(наименование основного учебного подразделения (ОУП)-разработчика ОП ВО)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Инвестиционные и банковские риски

(наименование дисциплины/модуля)

Рекомендована МСН для направления подготовки/специальности:

38.04.01 «Экономика»

(код и наименование направления подготовки/специальности)

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

«Финансовое управление в секторах экономики»

(наименование (профиль/специализация) ОП ВО)

2022г.

1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель курса – формирование у магистрантов современных фундаментальных знаний в области теории и практики управления рисками на современных рынках фондов и ссудного капитала, раскрытие сущностных основ взаимодействия теории и практики риск-менеджмента.

2. ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Освоение дисциплины «Инвестиционные и банковские риски» 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)
УК-3	Способен организовывать и руководить работой команды, вырабатывая командную стратегию для достижения поставленной цели	УК-3.1 Определяет свою роль в команде, исходя из стратегии сотрудничества для достижения поставленной цели УК-3.2 Формулирует и учитывает в своей деятельности особенности поведения групп людей, выделенных в зависимости от поставленной цели УК-3.3 Анализирует возможные последствия личных действий и планирует свои действия для достижения заданного результата
ОПК-2	Способен применять продвинутое инструментальные методы экономического анализа в прикладных и/или фундаментальных исследованиях	ОПК-2.1 Обладает знаниями о продвинутом инструментальных методах экономического анализа ОПК-2.2 Умеет применять знания о продвинутом инструментальных методах экономического и финансового анализа при проведении прикладных и/или фундаментальных исследований
ПК-2	Способен проводить мониторинг и анализ социально-экономической ситуации стран и регионов с использованием ГИС-технологий на основе Big Data и цифровизации информации	ПК-2.1 Способен проводить мониторинг и анализ социально-экономической ситуации территорий с использованием ГИС-технологий ПК-2.2 Способен проводить мониторинг и анализ социально-экономической ситуации развития территорий на основе Big Data и цифровизации информации
ПКО-2	Способен осуществлять анализ и оценку направлений развития денежно-кредитных, финансовых институтов и рынков с учетом мировых и страновых факторов	ПКО-2.1 Способен проводить анализ, оценку и прогнозирование динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, мезо- и макроуровне ПКО-2.2 Способен обосновывать стратегические направления экономического развития, минимизации рисков, обеспечения финансовой устойчивости организаций и финансовой системы в целом

3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОП ВО

Дисциплина «Инвестиционные и банковские риски» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений блока Б1 ОП ВО.

В рамках ОП ВО обучающиеся также осваивают другие дисциплины и/или практики, способствующие достижению запланированных результатов освоения дисциплины «Налоговый менеджмент в корпоративном и государственном секторе»

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

Шифр	Наименование компетенции	Предшествующие дисциплины/модули, практики*	Последующие дисциплины/модули, практики*
УК-3	Способен организовывать и руководить работой команды, вырабатывая командную стратегию для достижения поставленной цели	-	Подготовка и сдача государственного экзамена Государственная итоговая аттестация
ОПК-2	Способен применять продвинутое инструментальные методы экономического анализа в прикладных и/или фундаментальных исследованиях	Корпоративные финансы	Государственно-частное партнерство в развитии экономики регионов
ПК-2	Способен проводить мониторинг и анализ социально-экономической ситуации стран и регионов с использованием ГИС-технологий на основе Big Data и цифровизации информации	Корпоративные финансы	
ПКО-2	Способен осуществлять анализ и оценку направлений развития денежно-кредитных, финансовых институтов и рынков с учетом мировых и страновых факторов	Корпоративные финансы	Проектное финансирование и экспертиза технико-экономического обоснования Актуальные проблемы финансов

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

4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ И ВИДЫ УЧЕБНОЙ РАБОТЫ

Общая трудоемкость дисциплины «Инвестиционные и банковские риски» составляет 3 зачетных единиц.

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

Вид учебной работы	ВСЕГО, ак.ч.	Семестр(-ы)							
		1	2	3	4	5	6	7	8
<i>Контактная работа, ак.ч.</i>									
Лекции (ЛК)									
Лабораторные работы (ЛР)									
Практические/семинарские занятия (СЗ)			18						
<i>Самостоятельная работа обучающихся, ак.ч.</i>			54						
<i>Контроль (экзамен/зачет с оценкой), ак.ч.</i>			18						
Общая трудоемкость дисциплины	ак.ч.		108						
	зач.ед.		3						

5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

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

Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела (темы)	Вид учебной работы*
Оценка и прогнозирование инвестиционного рынка	<p>Понятие инвестиционного рынка, его состав, основные сегменты и элементы.</p> <p>Конъюнктурный цикл инвестиционного рынка.</p> <p>Этапы изучения конъюнктуры инвестиционного рынка.</p> <p>Оценка и прогнозирование макроэкономических показателей развития инвестиционного рынка.</p> <p>Оценка и прогнозирование инвестиционной привлекательности отраслей экономики.</p> <p>Оценка и прогнозирование инвестиционной привлекательности регионов.</p> <p>Инвестиционная привлекательность экономических субъектов.</p>	СЗ 4
Формирование инвестиционной стратегии	<p>Понятие инвестиционной стратегии.</p> <p>Принципы разработки инвестиционной стратегии.</p> <p>Основные этапы процесса формирования инвестиционной стратегии.</p> <p>Стратегические цели инвестиционной деятельности.</p> <p>Обоснование стратегических направлений и форм инвестиционной деятельности.</p> <p>Разработка стратегических направлений формирования инвестиционных ресурсов.</p>	СЗ 4
Применение рискованных стратегий	<p>Формы проявления риска при осуществлении сделок на фондовом рынке, рынке ссудного капитала, и других.</p> <p>Виды инвестиционных стратегий.</p> <p>Практические аспекты применения финансовых инструментов в различных стратегиях.</p>	СЗ 3

<p>Портфель реальных инвестиционных проектов</p>	<p>Особенности портфеля реальных инвестиционных проектов. Характеристика основных стадий формирования портфеля. Финансовый анализ инвестиционных проектов, его роль в формировании портфеля. Критерии отбора инвестиционных проектов в портфель. Выбор критерия в сравнительном анализе альтернативных, взаимоисключающих проектов. Критерий выбора при анализе инвестиционных проектов с неординарным типом денежного потока. Критерий отбора в портфель проектов, имеющих разные сроки жизни. Оптимальный бюджет капитальных вложений и формирование портфеля. Характеристика основных этапов процесса оперативного управления портфелем реальных инвестиционных проектов.</p>	<p>СЗ 4</p>
<p>Портфель ценных бумаг предприятия</p>	<p>Особенности портфеля ценных бумаг. Типы портфелей и цели портфельного инвестирования предприятия. Характеристика основных этапов процесса формирования портфеля ценных бумаг. Способы управления портфелем ценных бумаг финансовым менеджером. Определение (выработка) инвестиционной политики инвестора. Осуществление финансового анализа ценных бумаг. Формирование портфеля ценных бумаг. Пересмотр портфеля ценных бумаг. Оценка эффективности сформированного портфеля. Оценка меры эффективного управления портфелем.</p>	<p>СЗ 3</p>

* - 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 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:

а) основная литература:

1. Финансовые риски [Текст] : Учебное пособие / И.П Хомнич. - 2-е изд., стереотип. - М. : ЮРАЙТ, 2018. - 345 с. : ил. - (Бакалавриат). - ISBN 978-5-534-01019-0
2. Система управления рисками : Учебное пособие / П. Н. Афонин. - СПб. : Троицкий мост, 2016. - 125 с. - ISBN 978-5-4377-0067-9.

Дополнительная литература:

1. 1. Агаркова Л.В. Управление финансовыми рисками корпорация / Л.В. Агаркова // Аллея науки. 2018. Т. 4. № 1 (17). - С. 561-564.
2. Бланк И.А. Управление финансовыми рисками. Учеб. курс. - 6-е изд., перераб. и доп. - К.: Эльга, Ника-Центр, 2014. - 582 с.
3. Леонова Н.Г. Финансовые риски и новые информационные технологии / Н.Г. Леонова

// Наука и бизнес: пути развития. 2018. № 3 (81). - С. 62-64.

4. Маслова Е.Ю. Основные принципы и методы управления финансовыми рисками / Е.Ю. Маслова // Инновационное развитие. 2017. № 12 (17). - С. 128-129.

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/>

1. <https://esystem.rudn.ru/course/view.php?id=5053>

Курс лекций по дисциплине.

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 «Налоговый менеджмент» представлены в Приложении к настоящей Рабочей программе дисциплины.

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

РАЗРАБОТЧИКИ:

К.э.н., доцент

Должность, БУП



Подпись

Гиринский А.В.

Фамилия И.О.

**И.о. зав. кафедрой «Финансы
и кредит»**

Наименование БУП



Подпись

Е.М. Григорьева

Фамилия И.О.

РУКОВОДИТЕЛЬ ОП ВО:

**профессор кафедры
«Финансы и кредит»**



А.Я. Быстряков
