

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Ястребов Олег Александрович

Должность: Ректор

Дата подписания: 13.05.2024 10:46:24

Уникальный программный ключ:

ca953a0120d891083f939673078ef1a989dae18a

**Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования**

**«Российский университет дружбы народов имени Патриса Лумумбы»**

**Институт мировой экономики и бизнеса**

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

## **РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

### **УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ**

(наименование дисциплины/модуля)

**Рекомендована МССН для направления подготовки/специальности:**

### **38.03.01 ЭКОНОМИКА**

(код и наименование направления подготовки/специальности)

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

### **МЕЖДУНАРОДНАЯ ЭКОНОМИЧЕСКАЯ БЕЗОПАСНОСТЬ**

(наименование (профиль/специализация) ОП ВО)

**2024 г.**

## 1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина «Управление рисками» входит в программу бакалавриата «Международная экономическая безопасность» по направлению 38.03.01 «Экономика» и изучается в 6 семестре 3 курса. Дисциплину реализует Институт мировой экономики и бизнеса. Дисциплина состоит из 5 разделов и 15 тем и направлена на изучение процессов и методологий, которые позволяют идентифицировать, анализировать, оценивать и управлять потенциальными угрозами или негативными последствиями, которые могут повлиять на достижение целей организации, проекта или индивидуального предпринимательства.

Целью освоения дисциплины является обеспечение углубленного изучения основных понятий риск-менеджмента в контексте международного бизнеса или проекта, обеспечение изучения и применения лучших международных практик и методов идентификации и анализа рисков, формирование базы знаний, позволяющей принимать сбалансированные инвестиционные/кредитные/ управленческие решения с учетом фактора риска.

## 2. ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Освоение дисциплины «Управление рисками» 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-10	Способен принимать обоснованные экономические решения в различных областях жизнедеятельности	УК-10.1 Понимает базовые принципы функционирования экономики и экономического развития, цели формы участия государства в экономике; УК-10.2 Применяет методы личного экономического и финансового планирования для достижения текущих и долгосрочных финансовых целей; УК-10.3 Использует финансовые инструменты для управления личными финансами (личным бюджетом), контролирует собственные экономические и финансовые риски;
ОПК-2	Способен осуществлять сбор, обработку и статистический анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач	ОПК-2.1 Определяет методы сбора информации, способы и вид ее представления, применяя современное программное обеспечение; ОПК-2.2 Выбирает соответствующие содержанию профессиональных задач инструментарий обработки и анализа данных, современные информационные технологии и программное обеспечение; ОПК-2.3 Осуществляет визуализацию данных и презентацию решений в информационной среде;
ПК-4	Составление и представление финансовой отчетности экономического субъекта (ПС №309 "Бухгалтер")	ПК-4.1 Понимает методы сбора, анализа, систематизации, хранения и поддержания в актуальном состоянии финансовой информации экономического субъекта; ПК-4.2 Использует информационные технологии (программное обеспечение) в объеме, необходимом для составления финансовой отчетности;
ПК-8	Способен критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений, разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных	ПК-8.1 Знает виды различных управленческих решений, принципы и методы анализа кризисных ситуаций в организациях; пути и возможности выхода из кризисных ситуаций с минимальными потерями; ПК-8.2 Умеет принимать оптимальные управленческие решения в условиях неопределенности, экстремальных ситуаций, острой конкурентной борьбы, дефицита ресурсов и неплатежеспособности предприятий; анализировать взаимосвязь управления с теорией макро- и

Шифр	Компетенция	Индикаторы достижения компетенции (в рамках данной дисциплины)
	социально-экономических последствий	микроэкономики, инновационным, маркетинговым, финансовым и стратегическим менеджментами, общей теорией систем и исследованием систем управления; ПК-8.3 Обладает навыками реализации проектного подхода к внедрению антикризисных технологий; анализа влияния рыночных и финансовых аспектов на устойчивость развития предприятия; принятия решений в области реализации антикризисного менеджмента, выбора средств для его эффективной реализации;

### 3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОП ВО

Дисциплина «Управление рисками» относится к обязательной части блока 1 «Дисциплины (модули)» образовательной программы высшего образования.

В рамках образовательной программы высшего образования обучающиеся также осваивают другие дисциплины и/или практики, способствующие достижению запланированных результатов освоения дисциплины «Управление рисками».

*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-10	Способен принимать обоснованные экономические решения в различных областях жизнедеятельности	Микроэкономика; Макроэкономика; Экономическая безопасность; Мировая продовольственная безопасность; <i>"Мягкая сила" в мировой экономике**;</i>	Преддипломная практика; Современные аспекты международной экономической безопасности (мастер-классы); Основы таможенно-тарифного регулирования;
ОПК-2	Способен осуществлять сбор, обработку и статистический анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач	Ознакомительная практика; Статистика; Бухгалтерский учет; Налоги и налогообложение; Технологии и практика программирования на языке Python для гуманитарных специальностей; Линейная алгебра; Математический анализ; Теория вероятностей и математическая статистика; Эконометрика; Экономическая география; Геополитика;	Преддипломная практика;
ПК-4	Составление и представление финансовой отчетности экономического субъекта (ПС №309 "Бухгалтер")		Преддипломная практика; Международная экономическая безопасность; <i>Геофинансы**;</i>
ПК-8	Способен критически оценить предлагаемые	Экономическая безопасность;	Преддипломная практика; Международная

<b>Шифр</b>	<b>Наименование компетенции</b>	<b>Предшествующие дисциплины/модули, практики*</b>	<b>Последующие дисциплины/модули, практики*</b>
	варианты управленческих решений, разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий		экономическая безопасность; Международные экономические организации; <i>Управление государственной собственностью**</i> ;

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

\*\* - элективные дисциплины /практики

#### 4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ И ВИДЫ УЧЕБНОЙ РАБОТЫ

Общая трудоемкость дисциплины «Управление рисками» составляет «5» зачетных единиц.

Таблица 4.1. Виды учебной работы по периодам освоения образовательной программы высшего образования для очной формы обучения.

Вид учебной работы	ВСЕГО, ак.ч.		Семестр(-ы)
			6
<i>Контактная работа, ак.ч.</i>	34		34
Лекции (ЛК)	17		17
Лабораторные работы (ЛР)	0		0
Практические/семинарские занятия (СЗ)	17		17
<i>Самостоятельная работа обучающихся, ак.ч.</i>	119		119
<i>Контроль (экзамен/зачет с оценкой), ак.ч.</i>	27		27
<b>Общая трудоемкость дисциплины</b>	<b>ак.ч.</b>	<b>180</b>	<b>180</b>
	<b>зач.ед.</b>	<b>5</b>	<b>5</b>

## 5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

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

Номер раздела	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела (темы)		Вид учебной работы*
Раздел 1	Основы риск-менеджмента	1.1	Понятие риска и содержание риск-менеджмента. Экономические риски. Оценка риска.	ЛК, СЗ
		1.2	Виды рисков. Экономические риски. Оценка риска.	ЛК, СЗ
		1.3	Методы управления рисками. Управление рисками коммерческого банка. Интегрированный риск-менеджмент	ЛК, СЗ
Раздел 2	Классификация рисков	2.1	Основные принципы классификации рисков. Кредитные риски и финансовые риски. Базельские соглашения.	ЛК, СЗ
		2.2	Управление процентным риском.	ЛК, СЗ
		2.3	Управление валютным риском	ЛК, СЗ
Раздел 3	Методы анализа, оценки и управления рисками	3.1	Методы анализа рисков. Инструментарий анализа рисков. Качественный и количественный анализ рисков. Анализ рыночных рисков.	ЛК, СЗ
		3.2	Управление операционным риском	ЛК, СЗ
		3.3	Практика оценки кредитного риска международными рейтинговыми агентствами и финансовыми институтами. Финансовое моделирование и планирование для целей оценки риска.	ЛК, СЗ
Раздел 4	Риски международной компании или проекта	4.1	Понятие суверенного (странового) риска.	ЛК, СЗ
		4.2	Инструменты финансирования международных компаний и проектов и специфические риски.	ЛК, СЗ
		4.3	Практическое использование методов оценки кредитного риска при принятии инвестиционного/кредитного решения международной кредитной организацией.	ЛК, СЗ
Раздел 5	Управление рисками международной компании или проекта	5.1	Управление политическими рисками в зарубежной коммерческой деятельности и международной банковской деятельности.	ЛК, СЗ
		5.2	Методы хеджирования политических, валютных и процентных рисков. Управление рыночными (ценовыми) рисками.	ЛК, СЗ
		5.3	ESG-риски	ЛК, СЗ

\* - заполняется только по **ОЧНОЙ** форме обучения: ЛК – лекции; ЛР – лабораторные работы; СЗ – практические/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)
Лекционная	Аудитория для проведения занятий лекционного типа, оснащенная комплектом специализированной мебели; доской (экраном) и техническими	

	средствами мультимедиа презентаций.	
Семинарская	Аудитория для проведения занятий семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, оснащенная комплектом специализированной мебели и техническими средствами мультимедиа презентаций.	
Для самостоятельной работы	Аудитория для самостоятельной работы обучающихся (может использоваться для проведения семинарских занятий и консультаций), оснащенная комплектом специализированной мебели и компьютерами с доступом в ЭИОС.	

\* - аудитория для самостоятельной работы обучающихся указывается **ОБЯЗАТЕЛЬНО!**

## 7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

### *Основная литература:*

1. Michel Crouhy, Dan Galai and Robert Mark, The Essentials of Risk Management, 2nd Edition (New York: McGraw- Hill, 2014).

[Издание на русском языке: Мишель Круи, Дэн Галэй, Роберт М. Марк, Основы риск-менеджмента, Пер. с англ. Н. Сологуб, изд. Юрайт: 2018. — 390 с.]

Chapter 1. Risk Management: A Helicopter View

Chapter 2. Corporate Risk Management: A Primer

Chapter 4. Corporate Governance and Risk Management

Chapter 9. Credit Scoring and Retail Credit Risk Management

2. Blaise Ganguin, John Bilardello, Standard & Poor's Fundamentals of Corporate Credit Analysis, 1 edition (New York: McGraw-Hill, 2004).

3. Гусаков Николай Павлович. Международные валютно-кредитные отношения [Электронный ресурс] : Учебник / Н.П. Гусаков, И.Н. Белова, М.А. Стренина; Под общ. ред. Н.П. Гусакова. - 2-е изд., перераб. и доп. ; Электронные текстовые данные. - М. : ИНФРА-М, 2015. - 314 с. <http://lib.rudn.ru/MegaPro/Web/SearchResult/ToPage/1>

### *Дополнительная литература:*

1. В. Бочаров. Финансовый анализ. Краткий курс. 2-е изд. СПб.: 2009. — 240 с.

2. Brealey R., Myers S., Allen F. Principles of Corporate Finance (Finance, Insurance, and Real Estate). McGraw-Hill/Irwin – 2010, 968 pages, 10th Edition

[Издание на русском языке: Брэйли Р., Майерс С. Принципы корпоративных финансов. Пер. с англ. Н. Барышниковой. — М.: ЗАО «Олимп—Бизнес», 2008. — 1008 с.]

3. Jon Gregory, Counterparty Credit Risk and Credit Value Adjustment: A Continuing Challenge for Global Financial Markets, 2nd Edition (West Sussex, UK: John Wiley & Sons, 2012).

Chapter 3. Defining Counterparty Credit Risk

4. Jonathan Golin and Philippe Delhaise, The Bank Credit Analysis Handbook, 2nd Edition (Hoboken, NJ: John Wiley & Sons, 2013).

Chapter 1. The Credit Decision

Chapter 2. The Credit Analyst

*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](http://www.studentlibrary.ru)

- 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/>

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

1. Курс лекций по дисциплине «Управление рисками».

\* - 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 «Управление рисками» представлены в Приложении к настоящей Рабочей программе дисциплины.

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

**РАЗРАБОТЧИК:**

Доцент

*Должность, БУП*

*Подпись*

Григорьев Владимир

Николаевич

*Фамилия И.О.*

**РУКОВОДИТЕЛЬ БУП:**

*Должность БУП*

*Подпись*

*Фамилия И.О.*

**РУКОВОДИТЕЛЬ ОП ВО:**

Заведующий кафедрой

*Должность, БУП*

*Подпись*

Андропова Инна

Витальевна

*Фамилия И.О.*