

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Ястребов Олег Александрович
Должность: Ректор
Дата подписания: 22.05.2024 13:13:21
Уникальный программный ключ:
ca953a0120d891083f939673078ef1a989dae18a

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

Экономический факультет

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

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

УПРАВЛЕНИЕ ФИНАНСОВЫМИ РИСКАМИ И ВАЛЮТНЫМИ ПОЗИЦИЯМИ

(наименование дисциплины/модуля)

Рекомендована МССН для направления подготовки/специальности:

38.04.08 ФИНАНСЫ И КРЕДИТ

(код и наименование направления подготовки/специальности)

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

СОВРЕМЕННЫЕ ФИНАНСОВЫЕ ТЕХНОЛОГИИ В ИНВЕСТИРОВАНИИ И БАНКОВСКОМ БИЗНЕСЕ

(наименование (профиль/специализация) ОП ВО)

2024 г.

1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина «Управление финансовыми рисками и валютными позициями» входит в программу магистратуры «Современные финансовые технологии в инвестировании и банковском бизнесе» по направлению 38.04.08 «Финансы и кредит» и изучается в 3 семестре 2 курса. Дисциплину реализует Кафедра финансов и кредита. Дисциплина состоит из 9 разделов и 18 тем и направлена на изучение Основной целью преподавания данной дисциплины является изучение особенностей рисков, а также экономических основ управления различными их видами для снижения финансовых потерь и обеспечения условий успешного функционирования компании. □Задачами данной дисциплины являются: □• детальное изучение сущности и видов экономических рисков, □• выявление причин возникновения каждого вида рисков; □• исследование сферы возникновения чистых и спекулятивных, в т.ч. финансовых рисков; □• освоение стратегических и тактических приемов управления различными видами рисков, а также возможности их сочетания.

Целью освоения дисциплины является Основной целью преподавания данной дисциплины является изучение особенностей рисков, а также экономических основ управления различными их видами для снижения финансовых потерь и обеспечения условий успешного функционирования компании. □Задачами данной дисциплины являются: □• детальное изучение сущности и видов экономических рисков, □• выявление причин возникновения каждого вида рисков; □• исследование сферы возникновения чистых и спекулятивных, в т.ч. финансовых рисков; □• освоение стратегических и тактических приемов управления различными видами рисков, а также возможности их сочетания.

2. ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Освоение дисциплины «Управление финансовыми рисками и валютными позициями» 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-1	Способен осуществлять поиск, критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, выработать стратегию действий	УК-1.1 Описывает и аргументировано диагностирует ситуацию как проблемную; УК-1.2 Критически и всесторонне анализирует проблемную ситуацию на основе системного подхода, выявляя ее компоненты и причинно-следственные связи; УК-1.3 Формирует стратегию действий в выработать проблемной ситуации: выработывает обоснованные варианты ее оценивая возможные риски и предлагая пути их нейтрализации, осуществляет мониторинг принятых решений;
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	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

Шифр	Компетенция	Индикаторы достижения компетенции (в рамках данной дисциплины)
	экспертные заключения по вопросам своей профессиональной области	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;
ПКО-2	Способен разрабатывать методики и оценивать эффективность экономических проектов с учетом рисков, принимать решения на основе полученных результатов	ПКО-2.1 Способен разрабатывать показатели индикаторы характеристики процессов, событий и явлений; нормативные документы, методические указания, методики и инструкции решения задач в инвестиционно-финансовой и банковской сферах; ПКО-2.2 Способен разрабатывать алгоритмы и описывать процессы для решения задач в финансово-инвестиционно и банковской сферах деятельности; ПКО-2.3 Способен разрабатывать финансовые модели реализации проектов, в том числе в инвестиционно-финансовой и банковской сферах, учетом требований национального и законодательства и международных стандартов;

3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОП ВО

Дисциплина «Управление финансовыми рисками и валютными позициями» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений 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 финансовыми рисками и валютными позициями».

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-1	Способен осуществлять поиск, критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, выработать стратегию действий	Актуальные проблемы финансов; Международные стандарты управления банковской деятельностью; Стратегии и современная модель управления в сфере денежно-кредитных отношений; Управление инвестиционным портфелем; Инвестиционный менеджмент; Адаптивный курс по основам экономики;	Преддипломная практика;
ПКО-1	Способен анализировать и прогнозировать основные социально-экономические показатели, предлагать стратегические направления экономического развития,	Научно-исследовательская работа; Математическое обеспечение инвестиционных решений; Финансовые рынки и финансово-кредитные институты; Методология научного	Преддипломная практика;

Шифр	Наименование компетенции	Предшествующие дисциплины/модули, практики*	Последующие дисциплины/модули, практики*
	минимизации рисков, обеспечения финансовой устойчивости организаций и финансовой системы в целом, составлять обзоры и экспертные заключения по вопросам своей профессиональной области	исследования; Актуальные проблемы финансов; Финансовый анализ (продвинутый уровень); Международные стандарты управления банковской деятельностью; Стратегии и современная модель управления в сфере денежно-кредитных отношений; Инвестиционные и банковские риски; Корпоративные финансы; Инвестиционный менеджмент; <i>Эконометрика финансовых рынков**</i> ; <i>Financial risk management**</i> ;	
ПКО-2	Способен разрабатывать методики и оценивать эффективность экономических проектов с учетом рисков, принимать решения на основе полученных результатов	Финансовые рынки и финансово-кредитные институты; Управление инвестиционным портфелем; Инвестиционные и банковские риски; Корпоративные финансы; Инвестиционный менеджмент; Научно-исследовательская работа;	Преддипломная практика;

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

** - элективные дисциплины /практики

4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ И ВИДЫ УЧЕБНОЙ РАБОТЫ

Общая трудоемкость дисциплины «Управление финансовыми рисками и валютными позициями» составляет «3» зачетные единицы.

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)
			3
Контактная работа, ак.ч.	36		36
Лекции (ЛК)	0		0
Лабораторные работы (ЛР)	0		0
Практические/семинарские занятия (СЗ)	36		36
Самостоятельная работа обучающихся, ак.ч.	72		72
Контроль (экзамен/зачет с оценкой), ак.ч.	0		0
Общая трудоемкость дисциплины	ак.ч.	108	108
	зач.ед.	3	3

Общая трудоемкость дисциплины «Управление финансовыми рисками и валютными позициями» составляет «3» зачетные единицы.

Таблица 4.2. Виды учебной работы по периодам освоения образовательной программы высшего образования для очно-заочной формы обучения.

Вид учебной работы	ВСЕГО, ак.ч.		Семестр(-ы)
			4
Контактная работа, ак.ч.	36		36
Лекции (ЛК)	18		18
Лабораторные работы (ЛР)	0		0
Практические/семинарские занятия (СЗ)	18		18
Самостоятельная работа обучающихся, ак.ч.	54		54
Контроль (экзамен/зачет с оценкой), ак.ч.	18		18
Общая трудоемкость дисциплины	ак.ч.	108	108
	зач.ед.	3	3

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	Риск как объект управления	1.1	Риск как экономическая категория. Особенности риска. Три уровня субъектов, для которых возникает экономический риск	СЗ
		1.2	Классификация рисков по различным признакам. Квалификационная система рисков. Категории, группы, виды, подвиды и разновидности рисков.	СЗ
Раздел 2	Риск-менеджмент: понятие, стратегия и методы	2.1	Понятие риск-менеджмента и управления риском.	СЗ
		2.2	Проблемы управления рисками. Конфликт интересов. Стратегия и тактика управления риском	СЗ
Раздел 3	Оценка риска	3.1	Финансовый риск как функция времени. «Дерево вероятностей» как метод количественной оценки риска.	СЗ
		3.2	Метод построения «дерева вероятностей». Исходная вероятность. Условная вероятность. Совместная вероятность	СЗ
Раздел 4	Банковские риски	4.1	Классификация рисков банковской деятельности. Внешние и внутренние риски. Риски пассивных и активных операций	СЗ
		4.2	Дискуссионные вопросы содержания рыночного риска банковской деятельности.	СЗ
Раздел 5	Управление инфляционным риском	5.1	Явление инфляции и инфляционные процессы в экономике. Виды инфляции. Дефляция. Индекс инфляции. Темп инфляции	СЗ
		5.2	Понятие и сущность инфляционного риска. Основные методы компенсации потерь от снижения покупательной способности денег.	СЗ
Раздел 6	Управление валютным риском	6.1	Понятие валютного риска и его виды. Операционный, трансляционный и экономический валютные риски	СЗ
		6.2	Особенности управления трансляционным валютным риском	СЗ
Раздел 7	Управление кредитным риском	7.1	Понятие кредитного риска и его особенности	СЗ
		7.2	Оценка кредитного риска.	СЗ
Раздел 8	Управление процентным риском	8.1	Понятие процентного риска и сфера его возникновения.	СЗ
		8.2	Виды процентного риска: риск потерь от изменения потоков денежных средств, портфельный риск и экономический риск	СЗ
Раздел 9	Хеджирование как способ управления рисками	9.1	Инструменты хеджирования – срочные контракты. Механизм функционирования срочного рынка	СЗ
		9.2	Особенности и виды форвардов, фьючерсов, опционов и свопов	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)
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.	<p>Моноблок Lenovo AIO-300-22ISH Intel I5 2200 MHz/8 GB/1000 GB/DVD/audio, монитор 21"</p> <p>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</p>
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.	<p>Моноблок Lenovo AIO-300-22ISH Intel I5 2200 MHz/8 GB/1000 GB/DVD/audio, монитор 21"</p> <p>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</p>

		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. Управление финансовыми рисками [Текст] : Учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / Под ред. И.П.Хоминич, И.В.Пещанской. - М. : Юрайт, 2022. - 345 с.

2. Сорокин Л.В. Проектные риски: классификация методы анализа и управление [Электронный ресурс] : Учебное пособие / Л.В. Сорокин; Под ред. В.М. Матюшка. - Электронные текстовые данные. - М. : Изд-во РУДН, 2019. - 64 с.

Дополнительная литература:

1. . Шорохов Сергей Геннадьевич. Введение в модели количественной оценки кредитных рисков [Текст/электронный ресурс] : Учебно-методическое пособие / С.Г. Шорохов. - Электронные текстовые данные. - М. : Изд-во РУДН, 2018. - 84 с

2. Блохина Татьяна Константиновна. Риск-менеджмент на фондовом рынке Российской Федерации в условиях санкций [Текст/электронный ресурс] : Монография / Т.К. Блохина, О.А. Карпенко. - Электронные текстовые данные. - М. : Изд-во РУДН, 2017. - 152 с.

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 «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 финансовыми рисками и валютными позициями».

* - 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 финансовыми рисками и валютными позициями» представлены в Приложении к настоящей Рабочей программе дисциплины.

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

РАЗРАБОТЧИК:

<hr/> <i>Должность, БУП</i>	<hr/> <i>Подпись</i>	<hr/> Гиринский Андрей Владимирович <i>Фамилия И.О.</i>
-----------------------------	----------------------	---

РУКОВОДИТЕЛЬ БУП:

<hr/> Заведующий кафедрой <i>Должность БУП</i>	<hr/> <i>Подпись</i>	<hr/> Динец Дарья Александровна <i>Фамилия И.О.</i>
---	----------------------	---

РУКОВОДИТЕЛЬ ОП ВО:

<hr/> Доцент <i>Должность, БУП</i>	<hr/> <i>Подпись</i>	<hr/> Ахмедов Фахраддин Насраддин оглы <i>Фамилия И.О.</i>
---------------------------------------	----------------------	--