



АВТОНОМНАЯ НЕКОММЕРЧЕСКАЯ ОРГАНИЗАЦИЯ
ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ПРОФЕССИОНАЛЬНОГО ОБРАЗОВАНИЯ
"ЕВРАЗИЙСКАЯ АКАДЕМИЯ"

УТВЕРЖДАЮ
Ректор
_____ /Замельный А.Ю./



"05" июня 2025 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ
«Управление финансовыми рисками»

Дополнительная профессиональная программа
**«Менеджмент и бизнес (экономика, финансы, административно-управленческая
деятельность)»**

г. Москва
Территория Инновационного центра Сколково

Наименование учебной дисциплины: Управление финансовыми рисками.

Цель освоения учебной дисциплины: достижение запланированных результатов освоения образовательной программы - формирование установленных в образовательной программе компетенций.

Задачи освоения учебной дисциплины: достижение запланированных в настоящей рабочей программе результатов освоения дисциплин - приобретение обучающимся запланированных знаний, умений, навыков.

Планируемые результаты освоения учебной дисциплины

Обучающийся должен сформировать следующие результаты освоения дисциплины «Управление финансовыми рисками»:

Знания: Знание основных видов финансовых рисков, включая рыночный, кредитный, операционный, ликвидности и правовой риски, а также методологий их оценки и управления. Знание ключевых нормативных актов и стандартов, регулирующих управление финансовыми рисками. Понимание принципов построения системы управления финансовыми рисками в организации. Знание современных инструментов и технологий, используемых для управления финансовыми рисками (например, VaR, stress-тестирование). Знание основ финансового моделирования и анализа.

Умения: Навыки проведения количественной оценки финансовых рисков с использованием различных методик. Навыки построения моделей для оценки и управления финансовыми рисками. Навыки разработки и внедрения процедур управления финансовыми рисками. Навыки мониторинга и контроля эффективности системы управления финансовыми рисками. Навыки подготовки отчетов и презентаций по результатам анализа и управления финансовыми рисками.

Навыки: Умение идентифицировать и анализировать различные виды финансовых рисков, с которыми сталкивается организация. Умение применять количественные и качественные методы оценки финансовых рисков. Умение разрабатывать стратегии и планы управления финансовыми рисками. Умение использовать специализированное программное обеспечение для моделирования и анализа финансовых рисков. Умение интерпретировать результаты анализа рисков и формулировать рекомендации по их минимизации.

Объем (трудоемкость) учебной дисциплины: определен в учебном плане образовательной программы.

Форма промежуточной аттестации по учебной дисциплине определена в учебном плане образовательной программы.

Текущий контроль успеваемости осуществляется посредством аналитического отчета обучающегося по дисциплине.

Структура и содержание учебной дисциплины определяется тематическим планом учебной дисциплины.

Тематический план учебной дисциплины

- Тема № 1: Введение в управление финансовыми рисками
- Тема № 2: Идентификация финансовых рисков
- Тема № 3: Оценка финансовых рисков
- Тема № 4: Методы количественной оценки рисков
- Тема № 5: Методы качественной оценки рисков
- Тема № 6: Рыночный риск
- Тема № 7: Кредитный риск
- Тема № 8: Риск ликвидности
- Тема № 9: Операционный риск
- Тема № 10: Правовой риск
- Тема № 11: Репутационный риск
- Тема № 12: Стратегический риск
- Тема № 13: Риск процентной ставки
- Тема № 14: Валютный риск
- Тема № 15: Товарный риск
- Тема № 16: Риск акций
- Тема № 17: Риск облигаций
- Тема № 18: Риск деривативов
- Тема № 19: Моделирование финансовых рисков
- Тема № 20: VaR (Value at Risk)
- Тема № 21: Expected Shortfall (ES)
- Тема № 22: Стресс-тестирование
- Тема № 23: Backtesting моделей оценки рисков
- Тема № 24: Управление рыночным риском
- Тема № 25: Управление кредитным риском
- Тема № 26: Управление риском ликвидности
- Тема № 27: Управление операционным риском
- Тема № 28: Управление правовым риском
- Тема № 29: Управление репутационным риском
- Тема № 30: Управление стратегическим риском
- Тема № 31: Хеджирование финансовых рисков
- Тема № 32: Деривативы для хеджирования
- Тема № 33: Страхование финансовых рисков
- Тема № 34: Диверсификация портфеля
- Тема № 35: Регулирование и надзор в сфере управления финансовыми рисками
- Тема № 36: Базельские соглашения
- Тема № 37: Корпоративное управление рисками
- Тема № 38: Роль риск-менеджера
- Тема № 39: Примеры управления финансовыми рисками из практики

Содержание самостоятельной работы обучающихся по учебной дисциплине: подготовка к занятиям: изучение теоретического материала, чтение учебников и дополнительных источников, конспектирование; подготовка к промежуточной аттестации; самостоятельное

изучение дополнительных материалов; анализ и интерпретация данных – составление аналитического отчета обучающегося по дисциплине.

Условия реализации рабочей программы дисциплины

Материально-техническое обеспечение реализации дисциплины соответствует материально-техническому обеспечению, указанному в разделе 3 образовательной программы.

Учебно-методическое обеспечение (электронные учебно-методические материалы) освоения учебной дисциплины

Электронные учебные издания

Куклина, Е. Н. Организация самостоятельной работы студента / Е. Н. Куклина, М. А. Мазниченко, И. А. Мушкина. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 235 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-06270-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/562503>

Зорина, Е. М. Метапредметная компетенция преподавателей и обучающихся / Е. М. Зорина. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 130 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-17997-2. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт].

Электронные методические издания

Мотивация студентов к обучению и воспитательная деятельность — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 1 с. — (Юрайт.Академия). — ISBN 978-5-534-14536-6. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/533252>

Мотивация студентов к обучению и профессиональному развитию — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 5 с. — (Юрайт.Академия). — ISBN 978-5-534-14536-6. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/509597>

Информационное обеспечение освоения учебной дисциплины представляет собой перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем.

Каждый обучающийся обеспечивается индивидуальным неограниченным доступом к электронно-библиотечной системе (цифровой (электронной) библиотеке) «ЮРАЙТ» (<https://urait.ru/>), содержащей издания учебно-методической и иной литературы.

Каждый обучающийся обеспечивается индивидуальным неограниченным доступом к федеральной государственной информационной системе «Национальная электронная библиотека» (<https://rusneb.ru/>).

Состав необходимого комплекта лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства: Яндекс Браузер (реестровая запись №3722 от 23.07.2017 в едином реестре российских программ для электронных вычислительных машин и баз данных); Яндекс.Телемост (реестровая запись №13556 от 20.05.2022 в едином реестре российских программ для электронных

вычислительных машин и баз данных)

Электронные информационные ресурсы (ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»):

- Состав современных профессиональных баз данных

Федеральная служба государственной статистики (<https://rosstat.gov.ru/>)

Открытые данные России (<https://data.gov.ru/>)

Статистический Отдел Организации Объединенных Наций (United Nations Statistics Division) (<http://data.un.org/>)

База данных ЮНЕСКО (<https://www.unesco.org/en/key-data>)

- Состав информационных справочных систем

База знаний Открытого правительства (<http://wiki.ac-forum.ru/>)

Высшая аттестационная комиссия при Министерстве науки и высшего образования Российской Федерации (<https://vak.minobrnauki.gov.ru/main>)

Российский фонд фундаментальных исследований (<https://www.rfbr.ru/>)

Официальный интернет-портал правовой информации (Государственная система правовой информации) (<http://pravo.gov.ru/>)

Система обеспечения законодательной деятельности (<https://sozd.duma.gov.ru/>)

Собрание законодательства Российской Федерации (<https://www.szrf.ru/>)

Государственная автоматизированная система Российской Федерации «Правосудие» (ГАС «Правосудие») (<https://sudrf.ru/>)

Нормативные правовые акты в Российской Федерации. Министерство юстиции Российской Федерации (<http://pravo.minjust.ru/>)

- Иные информационные ресурсы - информационные ресурсы органов государственной власти

Президент России (<http://kremlin.ru/>)

Правительство России (<http://government.ru/>)

Министерство науки и высшего образования РФ (<https://www.minobrnauki.gov.ru/>)

Министерство просвещения РФ (<https://edu.gov.ru/>)

Министерство экономического развития Российской Федерации (<https://www.economy.gov.ru/>)

Министерство цифрового развития, связи и массовых коммуникаций Российской Федерации (<https://digital.gov.ru/>)

- Иные информационные ресурсы - периодическими издания

ТАСС (<https://tass.ru/>)

РИА НОВОСТИ (<https://ria.ru/>)

Коммерсантъ (<https://www.kommersant.ru/>)

RT (<https://rt.com/>)

- Информационные поисковые системы

Яндекс (<https://ya.ru/>)

MAIL.RU (<https://www.mail.ru/>)