

## АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

### Риск-менеджмент наименование дисциплины

**Автор:** К.э.н. Мищенко В.В.

**Код и наименование направления подготовки, профиля:** 38.03.02 Менеджмент

**Квалификация (степень) выпускника:** Бакалавр

**Форма обучения:** Очная

#### Цель освоения дисциплины:

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
ПК-15	Умение анализа рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании	ПК-15.2	Способность применять на практике общие алгоритмы принятия решений.

#### План курса:

№	Наименование	Содержание
Тема 1	<b>Введение в управление рисками</b>	Базовые типы рисков, типы инвесторов, сравнение риск/доходность, процесс управления рисками, управление рисками предприятия
Тема 2	<b>Кредитный риск</b>	Вероятность дефолта (PD), Потери в случае дефолта (LGD), метод доходность капитала с учетом риска (RAROC), Рейтинговые агентства, Кредитный кризис 2007 года
Тема 3	<b>Контракты с последующим объявлением условий</b>	
Тема 4	<b>Деривативы. Введение</b>	Определение дериватива, типы деривативов, арбитраж, рынки и участники рынка, документирование транзакций, хеджирование
Тема 5	<b>Форвардные контракты и свопы</b>	Форвардное ценообразование, характеристики форвардных контрактов на иностранную валюту, форвард с открытой датой, беспоставочный форвардный контракт, расторжение форвардного контракта, ценообразование свопов, своп как

№	Наименование	Содержание
Тема 6	<b>Опционы</b>	Типы опционов, разновидности опционов, типы волатильности, <<ухмылка волатильности>>, ценообразование опционов, паритет опционов пут и колл,
Тема 7	<b>Стратегии спекуляций опционами, экзотические опционы</b>	Синтетический форвард, срочная сделка участия, пороговый форвард, реверсия риска, спред колл-пут, барьерные опционы
Тема 8	<b>Процентные деривативы</b>	Рынок процентных ставок и участники рынка, форвард на процентную ставку (FRA), своп на процентную ставку, своп на процентную ставку в задолженностях, опционы на процентные ставки и стратегии спекуляций опционами, межвалютные
Тема 9	<b>Хеджирование сделок с сырьевыми товарами и структурированные финансовые инструменты</b>	Инструменты хеджирования сделок с сырьевыми товарами: форварды, свопы, опционы - базовые принципы, хеджирование золотодобывающих предприятий, хеджирование НПЗ, предварительная оплата сырьевых товаров, структурированные деривативы - базовые принципы, волатильность при продаже: - бивалютный депозит - бивалютные займы - Минимальные/максимальные
Тема 10	<b>Кредитные риски при торговле деривативами.</b>	Операционные риски, оценка суммы кредита - денежная добавленная стоимость (CVA), кредитное обеспечение, дополнение об обеспечении заимствования - условия и механизмы, операционные риски

#### **Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:**

Текущий контроль: диспут, диспут, тестирование

Промежуточная аттестация: экзамен

#### **Основная литература:**

1. Walker, Russell. Winning with Risk Management, World Scientific Publishing Co Pte Ltd, 2014. ProQuest Ebook Central, <https://ebookcentral.proquest.com/lib/ranepa-ebooks/detail.action?docID=1223950>.