

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ
ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ

"БРАТСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ"

УТВЕРЖДАЮ

Проректор по образовательной деятельности

_____ А.М. Патрусова

_____ 22 мая _____ 2025 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.01.07 Управление финансовыми рисками и фондовым портфелем

Закреплена за кафедрой **Базовая кафедра менеджмента и информационных технологий**

Учебный план gz380402_25_ФМ.plx

Направление подготовки 38.04.02 Менеджмент

Квалификация **магистр**

Форма обучения **заочная**

Общая трудоемкость **6 ЗЕТ**

Виды контроля на курсах:

Курсовая работа 2, Экзамен 2

Распределение часов дисциплины по курсам

Курс	2		Итого	
Вид занятий	уп	рп		
Лекции	2	2	2	2
Лабораторные	6	6	6	6
Практические	8	8	8	8
В том числе инт.	14	14	14	14
В том числе в форме практ.подготовки	14	14	14	14
Итого ауд.	16	16	16	16
Контактная работа	16	16	16	16
Сам. работа	191	191	191	191
Часы на контроль	9	9	9	9
Итого	216	216	216	216

Программу составил(и):

к.э.н., доц., *Афанасьев Алексей Сергеевич* _____

Рабочая программа дисциплины

Управление финансовыми рисками и фондовым портфелем

разработана в соответствии с ФГОС:

Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - магистратура по направлению подготовки 38.04.02 Менеджмент (приказ Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 952)

составлена на основании учебного плана:

Направление подготовки 38.04.02 Менеджмент
утвержденного приказом ректора от 04.02.2025 № 67.

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры

Базовая кафедра менеджмента и информационных технологий

Протокол от 25 апреля 2025 г. № 10

Срок действия программы: 2 года 5 месяцев

И.о. зав. кафедрой Гончарова Н.А.

Председатель НМС ФМП

декан, доцент, к.т.н., Видищева Е.А. 25 апреля 2025 г. протокол №07

Ответственный за реализацию ОПОП _____ Гончарова Н.А.

Директор библиотеки _____ Сотник Т.Ф.

№ регистрации _____ 14 _____

Визирование РПД для исполнения в учебном году

Председатель НМС

_____ 20__ г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для
исполнения в 20__ -20__ учебном году на заседании кафедры

Базовая кафедра менеджмента и информационных технологий

Внесены изменения/дополнения (Приложение _____)

Протокол от _____ 20__ г. № _____

Зав. кафедрой _____

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1	Формирование у обучающихся профессиональных компетенций, необходимых для составления инвестиционного портфеля клиента и проведения консультаций по вопросам состояния и перспектив финансового рынка, тенденций в изменении курсов ценных бумаг, иностранной валюты.
-----	--

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП

Цикл (раздел) ООП:		Б1.В.01.07
2.1	Требования к предварительной подготовке обучающегося:	
2.1.1	Антикризисный финансовый менеджмент	
2.2	Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:	
2.2.1	Преддипломная практика	
2.2.2	Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы	

3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

ПК-1: Способен осуществлять финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг, корпоративному финансированию, управлению финансами, стратегическому развитию

ПК-1.1: Консультирует по вопросам состояния и перспектив финансового рынка, тенденций в изменении курсов ценных бумаг, иностранной валюты

Знать: необходимый спектр финансовых продуктов и услуг, характеристики ценных бумаг, иностранной валюты;

Уметь: осуществлять подбор финансовых продуктов и услуг, ориентируясь на потребности и интересы клиента;

Владеть: навыками разъяснения сути финансовых продуктов, юридических и экономических характеристик финансовых продуктов и услуг

ПК-2: Способен разрабатывать финансовый план для клиента и инвестиционный портфель

ПК-2.2: Составляет инвестиционный портфель клиента

Знать: принципы портфельного управления инвестированием, подбора и распределения активов, соотношения риска и доходности;

Уметь: рассчитывать величину портфеля, достаточную для покрытия финансовых целей;

Владеть: навыками моделирования целевого портфеля клиента, расчета параметров целевого инвестиционного портфеля.

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Код занятия	Вид занятия	Наименование разделов и тем	Семестр / Курс	Часов	Индикаторы	Литература	Инте ракт.	Примечание
	Раздел	Раздел 1. Теоретические основы финансового риск-менеджмента						
1.1	Лек	Понятие неопределенности и риска. Классификация финансовых рисков	2	0,25	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	0,25	Лекция-беседа
1.2	Пр	Понятие неопределенности и риска. Классификация финансовых рисков	2	1	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	0	
1.3	Лаб	Понятие неопределенности и риска. Классификация финансовых рисков	2	1	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	1	Работа в малых группах
1.4	Лек	Понятие и основы управления фондовым портфелем организации	2	0,25	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	0,25	Лекция-беседа
1.5	Пр	Понятие и основы управления фондовым портфелем организации	2	1	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	1	Работа в малых группах
1.6	Лаб	Понятие и основы управления фондовым портфелем организации	2	1	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	1	Работа в малых группах
1.7	Ср	Теоретические основы финансового риск-менеджмента	2	46	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	0	
1.8	КР	Выполнение курсовой работы	2	9	ПК-1.1 ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	0	

1.9	Экзамен	Подготовка к экзамену	2	3	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	0	
	Раздел	Раздел 2. Методические основы оценки и управления основными финансовыми рисками						
2.1	Лек	Методы оценки и управления рыночными рисками и риском ликвидности	2	0,25	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	0,25	Лекция-беседа
2.2	Пр	Методы оценки и управления рыночными рисками и риском ликвидности	2	1	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	1	Работа в малых группах
2.3	Лаб	Методы оценки и управления рыночными рисками и риском ликвидности	2	1	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	1	Работа в малых группах
2.4	Лек	Методы оценки и управления валютными и процентными рисками	2	0,25	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	0,25	Лекция-беседа
2.5	Пр	Методы оценки и управления валютными и процентными рисками	2	1	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	1	Работа в малых группах
2.6	Лаб	Методы оценки и управления валютными и процентными рисками	2	1	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	1	Работа в малых группах
2.7	Лек	Методы оценки и управления кредитными рисками и операционными рисками	2	0,5	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	0,5	Лекция-беседа
2.8	Пр	Методы оценки и управления кредитными рисками и операционными рисками	2	2	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	1	Работа в малых группах
2.9	Лаб	Методы оценки и управления кредитными рисками и операционными рисками	2	1	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	1	Работа в малых группах
2.10	Ср	Методические основы оценки и управления основными финансовыми рисками	2	56	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	0	
2.11	КР	Выполнение курсовой работы	2	12	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	0	
2.12	Экзамен	Подготовка к экзамену	2	3	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	0	
	Раздел	Раздел 3. Производные финансовые инструменты и их роль в управлении фондовым портфелем организации						
3.1	Лек	Форвардные и фьючерсные контракты, их роль в управлении фондовым портфелем организации	2	0,25	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	0,25	Лекция-беседа
3.2	Пр	Форвардные и фьючерсные контракты, их роль в управлении фондовым портфелем организации	2	1	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	1	Работа в малых группах
3.3	Лаб	Форвардные и фьючерсные контракты, их роль в управлении фондовым портфелем организации	2	0,5	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	0,5	Работа в малых группах
3.4	Лек	Использование опционов, процентных и валютных свопов в управлении фондовым портфелем организации	2	0,25	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	0,25	Лекция-беседа

3.5	Пр	Использование опционов, процентных и валютных свопов в управлении фондовым портфелем организации	2	1	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	1	Работа в малых группах
3.6	Лаб	Использование опционов, процентных и валютных свопов в управлении фондовым портфелем организации	2	0,5	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	0,5	Работа в малых группах
3.7	Ср	Производные финансовые инструменты и их роль в управлении фондовым портфелем организации	2	56	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	0	
3.8	КР	Выполнение курсовой работы	2	12	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	0	
3.9	Экзамен	Подготовка к экзамену	2	3	ПК-2.2	Л1.1Л2.1 Л2.2 Л2.3	0	

5. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

Технология коллективного взаимодействия (работа в малых группах) (самостоятельное изучение обучающимися нового материала посредством сотрудничества в малых группах, дает возможность всем участникам участвовать в работе, практиковать навыки сотрудничества, межличностного общения)

Технология дистанционного обучения (получение образовательных услуг без посещения университета, с помощью современных систем телекоммуникации (электронная почта, Интернет и др.))

Образовательные технологии с использованием активных методов обучения (лекция – беседа)

Традиционная (репродуктивная) технология (преподаватель знакомит обучающихся с порядком выполнения задания, наблюдает за выполнением и при необходимости корректирует работу обучающихся)

6. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

6.1. Текущий контроль

Текущий контроль успеваемости обучающихся имеет комплексный характер. Система оценки результатов учитывает активность обучающегося на занятиях во время контактной работы с преподавателем, своевременность и качество выполнения заданий в ходе самостоятельной работы, участие в научно-исследовательской работе и др.

Текущим контролем успеваемости обучающихся является межсессионная аттестация - единовременное подведение итогов текущей успеваемости не менее одного раза в семестр по всем дисциплинам.

Порядок проведения, содержание и особенности текущего контроля успеваемости представлены в Фонде оценочных средств для данной дисциплины.

6.2. Темы письменных работ

Курсовая работа на тему «Современные аспекты формирования инвестиционного портфеля»

6.3. Промежуточная аттестация

Промежуточная аттестация проводится в форме экзамена.

Порядок проведения, содержание и критерии оценивания промежуточной аттестации представлены в Фонде оценочных средств для данной дисциплины.

6.4. Перечень видов оценочных средств

ПЗ, ЛР, КР, тестовые задания, экзаменационные вопросы

7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

7.1. Рекомендуемая литература

7.1.1. Основная литература

	Авторы,	Заглавие	Издательство,	Кол-во	Эл. адрес
Л1. 1	Фомичев А. Н.	Риск-менеджмент: учебник	Москва: Дашков и К°, 2025	1	https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=720241

7.1.2. Дополнительная литература

	Авторы,	Заглавие	Издательство,	Кол-во	Эл. адрес
Л2. 1	Шапкин А.С.	Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций: учебное пособие	Москва: Дашков и К°, 2007	5	

	Авторы,	Заглавие	Издательство,	Кол-во	Эл. адрес
Л2. 2	Каранина Е. В.	Риск-менеджмент: учебник	Москва Берлин: Директ-Медиа, 2020	1	http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=576201
Л2. 3	Воронцовский, А. В.	Управление инвестициями: инвестиции и инвестиционные риски в реальном секторе экономики: учебник и практикум для вузов	Москва : Издательство Юрайт, 2025	1	https://urait.ru/bcode/566776

7.3.1 Перечень программного обеспечения

7.3.1.1	Microsoft Office 2007 Russian Academic OPEN No Level
7.3.1.2	Microsoft Windows Professional 7 Russian Upgrade Academic OPEN No Level
7.3.1.3	Adobe Acrobat Reader DC
7.3.1.4	doPDF
7.3.1.5	Apache OpenOffice
7.3.1.6	Ай-Логос
7.3.1.7	Программное обеспечение для мультимедиа-лингфонного комплекта RINEL-LINGO

7.3.2 Перечень информационных справочных систем

7.3.2.1	ЭОС "Образовательная платформа ЮРАЙТ"
7.3.2.2	Справочно-правовая система «Консультант Плюс»
7.3.2.3	Университетская информационная система РОССИЯ (УИС РОССИЯ)
7.3.2.4	Национальная электронная библиотека НЭБ
7.3.2.5	Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU
7.3.2.6	Электронная библиотека БрГУ
7.3.2.7	Электронный каталог библиотеки БрГУ
7.3.2.8	«Университетская библиотека online»
7.3.2.9	Издательство "Лань" электронно-библиотечная система

8. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Аудитория	Назначение	Оснащение аудитории	Вид занятия
3111	Учебная аудитория (мультимедийный класс)	Основное оборудование: □ ПК: AMD Ryzen 5 7600X/16Gb/SSD 1Tb; □ Монитор MSI Pro MP242V; □ интерактивная доска ActivBoard 595 Pro; □ интерактивный планшет Wacom PL-720; □ проектор CASIO XJ-UT312WN; □ колонки акустические. Дополнительно: □ маркерная/меловая (поворотная) доска – 1 шт. Учебная мебель: □ комплект мебели (посадочных мест/АРМ) – 42 шт.; □ комплект мебели (посадочных мест/АРМ) для преподавателя – 1/1 шт.	Лек
3128	Учебная аудитория (мультимедийный класс/дисплейный класс) Помещение для самостоятельной работы обучающихся	Основное оборудование: Интерактивная доска SMART Board X885ix со встроенным проектором UX 60 – 1 шт. Монитор MSI 23.8MP 242V – 16 шт. Системный блок – 16 шт. Принтер лазерный HP LaserJet Enterprise P3015dn – 1 шт. Сканер CANOSCAN LIDE220 – 1 шт. Дополнительное оборудование: Маркерная доска – 1 шт. Меловая доска – 1 шт. Учебная мебель: Комплект мебели (посадочных мест/АРМ) – 26/15 шт. Комплект мебели (посадочных мест) для преподавателя – 1 шт	Пр
2201	читальный зал №1	Комплект мебели (посадочных мест) Стеллажи Комплект мебели (посадочных мест) для библиотекаря Выставочные шкафы ПК i5-2500/H67/4Gb (монитор TFT19 Samsung) (10шт.); принтер HP Laser Jet P2055D (1шт.)	Ср
3128	Учебная аудитория (мультимедийный класс/дисплейный класс)	Основное оборудование: Интерактивная доска SMART Board X885ix со встроенным проектором UX 60 – 1 шт.	Лаб

	Помещение для самостоятельной работы обучающихся	Монитор MSI 23.8MP 242V – 16 шт. Системный блок – 16 шт. Принтер лазерный HP LaserJet Enterprise P3015dn – 1 шт. Сканер CANOSCAN LIDE220 – 1 шт. Дополнительное оборудование: Маркерная доска – 1 шт. Меловая доска – 1 шт. Учебная мебель: Комплект мебели (посадочных мест/АРМ) – 26/15 шт. Комплект мебели (посадочных мест) для преподавателя – 1 шт	
2201	читальный зал №1	Комплект мебели (посадочных мест) Стеллажи Комплект мебели (посадочных мест) для библиотекаря Выставочные шкафы ПК i5-2500/H67/4Gb (монитор TFT19 Samsung) (10шт.); принтер HP Laser Jet P2055D (1шт.)	КР
3111	Учебная аудитория (мультимедийный класс)	Основное оборудование: □ПК: AMD Ryzen 5 7600X/16Gb/SSD 1Tb; □Монитор MSI Pro MP242V; □интерактивная доска ActivBoard 595 Pro; □интерактивный планшет Wacom PL-720; □проектор CASIO XJ-UT312WN; □колонки акустические. Дополнительно: □маркерная/меловая (поворотная) доска – 1 шт. Учебная мебель: □комплект мебели (посадочных мест/АРМ) – 42 шт.; □комплект мебели (посадочных мест/АРМ) для преподавателя – 1/1 шт.	Экзамен

9. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Практические занятия и лабораторные работы реализуются в форме практической подготовки при освоении образовательной программы в условиях выполнения обучающимися определенных видов заданий, связанных с будущей профессиональной деятельностью и направленных на формирование, закрепление, развитие практических навыков и компетенций по профилю образовательной программы.

Организация самостоятельной работы обучающихся зависит от вида учебных занятий:

- лекции

В процессе формирования конспекта лекций, обучающийся должен кратко, последовательно фиксировать основные положения, выводы, формулировки, обобщения; пометать важные мысли, выделять ключевые слова, термины.

Самостоятельно осуществлять проверку терминов с помощью энциклопедий, словарей, справочников с выписыванием толкований в тетрадь. Обозначить вопросы, термины, материал, который вызывает трудности, пометить и попытаться найти ответ в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удастся разобраться в материале, необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на консультации, практическом занятии.

- практические занятия

При подготовке к практическим занятиям обучающийся должен осуществлять работу с конспектом лекций (обобщение, систематизация, углубление и конкретизация полученных теоретических знаний), выработка способности и готовности их использования на практике. В процессе практических занятий у обучающегося формируется интеллектуальное умение, готовность к ответам на контрольные и дополнительные вопросы, навык работы с основной и дополнительной литературой, необходимой для освоения дисциплины и осуществляется выполнение заданий, решение задач, активное участие в интерактивной, активной, инновационной формах обучения, составление письменных отчетов.

- лабораторные занятия

При подготовке к лабораторным занятиям обучающийся должен осуществлять работу с конспектом лекций (обобщение, систематизация, углубление и конкретизация полученных теоретических знаний), выработка способности и готовности их использования на практике. В процессе лабораторных занятий у обучающегося формируется интеллектуальное умение, готовность к ответам на контрольные и дополнительные вопросы, навык работы с основной и дополнительной литературой, необходимой для освоения дисциплины и осуществляется выполнение заданий, решение задач, активное участие в интерактивной, активной, инновационной формах обучения, составление письменных отчетов.

- самостоятельная работа обучающихся

Проработка основной и дополнительной литературы, терминов, сведений, требующихся для запоминания и являющихся основополагающими в теме/разделе. Конспектирование прочитанных литературных источников. Проработка материалов по изучаемому вопросу, с использованием рекомендуемых ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет». Выполнение заданий преподавателя, необходимых для подготовки к участию в интерактивной, активной, инновационных формах обучения по изучаемой теме.

- курсовую работу

При выполнении курсовой работы производится углубление профессиональных компетенций, необходимых для составления инвестиционного портфеля клиента и проведения консультаций по вопросам состояния и перспектив финансового рынка, тенденций в изменении курсов ценных бумаг, иностранной валюты. Курсовая работа выполняется на основе углубленного изучения учебной, методической и научно-практической литературы по исследуемому вопросу.

- подготовка к экзамену

При подготовке к экзамену необходимо ориентироваться на конспекты лекций, рекомендуемую литературу, использовать

рекомендуемые ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет».
