

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по УМР

_____ Е.В. Коновалова

15 июня 2023 г., протокол УМС №5

МОДУЛЬ ДИСЦИПЛИН ПРОФИЛЬНОЙ НАПРАВЛЕННОСТИ

Финансовые риски

рабочая программа дисциплины (модуля)

Закреплена за кафедрой **Финансов, денежного обращения и кредита**

Учебный план b380301-ФиК-23-3.plx
38.03.01 Экономика
Направленность (профиль): Финансы и кредит

Квалификация **бакалавр**

Форма обучения **очная**

Общая трудоемкость **3 ЗЕТ**

Часов по учебному плану 108

в том числе:

аудиторные занятия 48

самостоятельная работа 33

часов на контроль 27

Виды контроля в семестрах:

экзамены 6

Распределение часов дисциплины по семестрам

| Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>) | 6 (3.2) | | Итого | |
|---|---------|-----|-------|-----|
| | уп | рп | уп | рп |
| Неделя | 16 2/6 | | | |
| Вид занятий | уп | рп | уп | рп |
| Лекции | 16 | 16 | 16 | 16 |
| Практические | 32 | 32 | 32 | 32 |
| Итого ауд. | 48 | 48 | 48 | 48 |
| Контактная работа | 48 | 48 | 48 | 48 |
| Сам. работа | 33 | 33 | 33 | 33 |
| Часы на контроль | 27 | 27 | 27 | 27 |
| Итого | 108 | 108 | 108 | 108 |

Программу составил(и):

к.э.н., доцент, Киященко Т.П.

Рабочая программа дисциплины

Финансовые риски

разработана в соответствии с ФГОС:

Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - бакалавриат по направлению подготовки 38.03.01 Экономика (приказ Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 954)

составлена на основании учебного плана:

38.03.01 Экономика

Направленность (профиль): Финансы и кредит

утвержденного учебно-методическим советом вуза от 15.06.2023 протокол № 5.

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры

Финансов, денежного обращения и кредита

Зав. кафедрой д.э.н., профессор Каратаев А.С.

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

| | |
|-----|--|
| 1.1 | развить способности выполнять профессиональные обязанности в процессе текущей деятельности как институтов финансового рынка, так и финансовых служб, отделов компаний различных отраслей экономики; формировать и внедрять системы оценки рисков, основанные на математических методах, сборе и анализе статистических баз данных; вырабатывать управленческие решения по эффективному формированию и использованию экспертных оценок рисков |
|-----|--|

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП

| | |
|--------------------|--|
| Цикл (раздел) ООП: | Б1.В.01 |
| 2.1 | Требования к предварительной подготовке обучающегося: |
| 2.1.1 | Финансы |
| 2.1.2 | Финансовый менеджмент |
| 2.2 | Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее: |
| 2.2.1 | Производственная практика, научно-исследовательская работа |
| 2.2.2 | Производные финансовые инструменты |
| 2.2.3 | Технический анализ на рынке ценных бумаг |
| 2.2.4 | Актуарные расчеты |
| 2.2.5 | Страхование |

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

| | |
|----------------|---|
| ПК-4.1: | Выполняет профессиональные обязанности в процессе текущей деятельности как институтов финансового рынка, так и финансовых служб, и отделов компаний различных отраслей экономики |
| ПК-2.1: | Формирует и внедряет системы оценки рисков, основанные на математических методах, сборе и анализе статистических баз данных |
| ПК-2.2: | Вырабатывает управленческие решения по эффективному формированию и использованию экспертных оценок рисков |

В результате освоения дисциплины обучающийся должен

| | |
|------------|---|
| 3.1 | Знать: |
| 3.1.1 | особенности деятельности институтов финансового рынка, финансовых служб, отделов компаний различных отраслей экономики; |
| 3.1.2 | системы оценки рисков, основанные на математических методах, сборе и анализе статистических баз данных; |
| 3.1.3 | теоретические основы формирования и использования экспертных оценок рисков |
| 3.2 | Уметь: |
| 3.2.1 | выполнять профессиональные обязанности в процессе текущей деятельности как институтов финансового рынка, так и финансовых служб, отделов компаний различных отраслей экономики; |
| 3.2.2 | формировать и внедрять системы оценки рисков, основанные на математических методах, сборе и анализе статистических баз данных; |
| 3.2.3 | вырабатывать управленческие решения по эффективному формированию и использованию экспертных оценок рисков |
| 3.3 | Владеть: |
| 3.3.1 | навыками формирования и внедрения систем оценки рисков, основанных на математических методах, сборе и анализе статистических баз данных; |
| 3.3.2 | способностями к выработке управленческих решений по эффективному формированию и использованию экспертных оценок рисков |

| 4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) | | | | | | |
|---|---|----------------|-------|----------------------|--|------------|
| Код занятия | Наименование разделов и тем /вид занятия/ | Семестр / Курс | Часов | Компетен-ши | Литература | Примечание |
| | Раздел 1. | | | | | |
| 1.1 | Риск как экономическая категория, его сущность /Лек/ | 6 | 2 | ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-4.1 | Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.3Л3.1 Э2 | |
| 1.2 | Риск как экономическая категория, его сущность /Пр/ | 6 | 2 | ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-4.1 | Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.3Л3.1 Э1 | |
| 1.3 | Риск как экономическая категория, его сущность /Ср/ | 6 | 7 | ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-4.1 | Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.3Л3.1 Э1 Э2 | |
| 1.4 | Оценка финансовых рисков. Экспертные оценки риска /Лек/ | 6 | 4 | ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-4.1 | Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.3Л3.1 Э2 | |
| 1.5 | Оценка финансовых рисков. Экспертные оценки риска /Пр/ | 6 | 6 | ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-4.1 | Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.3Л3.1 Э2 | |
| 1.6 | Оценка финансовых рисков. Экспертные оценки риска /Ср/ | 6 | 7 | ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-4.1 | Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.2 Л2.3Л3.1 Э2 | |
| 1.7 | Управление финансовыми рисками предприятия /Лек/ | 6 | 4 | ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-4.1 | Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э2 | |
| 1.8 | Управление финансовыми рисками предприятия /Пр/ | 6 | 8 | ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-4.1 | Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э2 | |
| 1.9 | Управление финансовыми рисками предприятия /Ср/ | 6 | 7 | ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-4.1 | Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э2 | |
| 1.10 | Механизмы нейтрализации финансовых рисков предприятия /Лек/ | 6 | 2 | ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-4.1 | Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э2 | |

| | | | | | |
|------|--|---|----|----------------------|---|
| 1.11 | Механизмы нейтрализации финансовых рисков предприятия /Пр/ | 6 | 8 | ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-4.1 | Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 |
| 1.12 | Механизмы нейтрализации финансовых рисков предприятия /Ср/ | 6 | 7 | ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-4.1 | Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э2 |
| 1.13 | Особенности управления финансовыми рисками в инвестиционной деятельности предприятия /Лек/ | 6 | 4 | ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-4.1 | Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э2 |
| 1.14 | Особенности управления финансовыми рисками в инвестиционной деятельности предприятия /Пр/ | 6 | 8 | ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-4.1 | Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э2 |
| 1.15 | Особенности управления финансовыми рисками в инвестиционной деятельности предприятия /Ср/ | 6 | 5 | ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-4.1 | Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э2 |
| 1.16 | /Контр.раб./ | 6 | 0 | ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-4.1 | Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 |
| 1.17 | /Экзамен/ | 6 | 27 | ПК-2.1 ПК-2.2 ПК-4.1 | Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 |

5. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА

5.1. Оценочные материалы для текущего контроля и промежуточной аттестации

Представлены отдельным документом

5.2. Оценочные материалы для диагностического тестирования

Представлены отдельным документом

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

6.1. Рекомендуемая литература

6.1.1. Основная литература

| | | | | |
|--|---------------------|----------|-------------------|----------|
| | Авторы, составители | Заглавие | Издательство, год | Колич-во |
|--|---------------------|----------|-------------------|----------|

| | Авторы, составители | Заглавие | Издательство, год | Колич-во |
|---|---|---|-----------------------|----------|
| Л1.1 | Гэлаи Д., Кроуи М., Марк Р., Минасян В. Б. | Основы риск-менеджмента: - | Электронный ресурс | 1 |
| Л1.2 | Вяткин В. Н., Гамза В. А., Маевский Ф. В. | Риск-менеджмент: Учебник | Электронный ресурс | 1 |
| Л1.3 | Чернова Г. В., Базанов А. Н., Белозёров С. А., Болдырева Н. Б., Власов П. А., Зайцев М. Б., Калайда С. А., Комарова Н. В., Кудрявцев А. А., Кузнецова Н. П., Писаренко Ж. В., Радионон А. В., Солопенко Е. В., Фаизова А. А., Фомин И. А., Рязанов М. В., Федорова Т. И., Халин В. Г., Харитонова Н. В., Черногузова Т. Н. | Страхование и управление рисками: Учебник для бакалавров | Электронный ресурс | 1 |
| Л1.4 | Шапкин А. С., Шапкин В. А. | Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций: Пособие | Электронный ресурс | 1 |
| 6.1.2. Дополнительная литература | | | | |
| | Авторы, составители | Заглавие | Издательство, год | Колич-во |
| Л2.1 | Казакова Н. А. | Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски: Учебное пособие | Электронный ресурс | 1 |
| Л2.2 | Серебрякова Т.Ю. | Риски организации и внутренний экономический контроль: Монография | Электронный ресурс | 1 |
| Л2.3 | Ряховская А.Н., Крюкова О. Г. | Риск-менеджмент - основа устойчивости бизнеса: Учебное пособие | Электронный ресурс | 1 |

| 6.1.3. Методические разработки | | | | |
|---------------------------------------|---------------------------------|--|--------------------|----------|
| | Авторы, составители | Заглавие | Издательство, год | Колич-во |
| ЛЗ.1 | Киященко Т. П. | Финансовые риски: методические рекомендации и задания для практических занятий и самостоятельных работ | Электронный ресурс | 1 |
| ЛЗ.2 | Киященко Т. П., Уткина О. В. | Научный семинар "Управление рисками и страхование": методические рекомендации и задания для практических занятий и самостоятельных работ | Электронный ресурс | 1 |

6.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"

| | |
|----|---|
| Э1 | официальный сайт Федеральной службы государственной статистики, www.gks.ru |
| Э2 | официальный сайт научно-практического журнала "Проблемы анализа риска", https://www.risk-journal.com/jour |

6.3.1 Перечень программного обеспечения

| | |
|---------|---|
| 6.3.1.1 | Пакет прикладных программ Microsoft Office, |
| 6.3.1.2 | Операционная система Windows |

6.3.2 Перечень информационных справочных систем

| | |
|---------|--|
| 6.3.2.1 | Справочная правовая система «КонсультантПлюс» [Электронный ресурс] – Режим доступа: www.consultant.ru . |
| 6.3.2.2 | Справочная правовая система «Гарант» [Электронный ресурс] – Режим доступа: www.garant.ru . |

7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

| | |
|-----|---|
| 7.1 | Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа (лабораторных занятий), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации оснащена: комплект специализированной учебной мебели, маркерная (меловая) доска, комплект переносного мультимедийного оборудования - компьютер, проектор, проекционный экран, компьютеры с возможностью выхода в Интернет и доступом в электронную информационно-образовательную среду. Обеспечен доступ к сети Интернет и в электронную информационную среду организации. |
|-----|---|