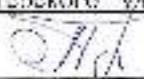


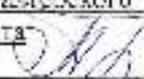
Министерство образования и науки РФ
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«СИБИРСКИЙ ФЕДЕРАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

СОГЛАСОВАНО
Заведующий кафедрой
Бухгалтерского учета, анализа и
аудита

 А.Т. Петрова

« 21 » декабря 2013 г.
Торгово-экономический институт

УТВЕРЖДАЮ
Заведующий кафедрой
Бухгалтерского учета, анализа и
аудита

 А.Т. Петрова

« 21 » декабря 2013 г.
Торгово-экономический институт

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
УПРАВЛЕНИЕ ФИНАНСОВЫМИ РИСКАМИ**

Дисциплина Б1.В.ДВ.11.1 Управление финансовыми рисками

Направление подготовки 38.03.01 Экономика

Направленность (профиль) 38.03.01.04.07 Финансы и кредит (финансы организаций)

форма обучения очная

год набора 2014

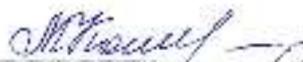
Красноярск 2017

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

составлена в соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по укрупненной группе 38.00.00 ЭКОНОМИКА И УПРАВЛЕНИЕ

Направления подготовки /специальность (профиль/специализация)
38.03.01 Экономика (профиль 38.03.01.04.07 Финансы и кредит (финансы организации)

Программу составила М.А.Конищева



Заведующий кафедрой (разработчик) А.Т.Петрова

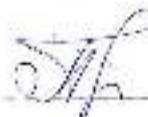


«21» декабря 2017г.

Рабочая программа обсуждена на заседании кафедры (выпускающей)
Бухгалтерского учета, анализа и аудита

«21» декабря 2017г. протокол № 11

Заведующий кафедрой (выпускающей) А.Т.Петрова



1 Цель и задачи изучения дисциплины

1.1 Цель преподавания дисциплины

Целью преподавания дисциплины «Управление финансовыми рисками» является овладение студентами теоретическими знаниями, практическими умениями и навыками в области выявления, оценки и управления финансовыми рисками, позволяющими принимать и реализовать эффективные управленческие решения по оптимизации финансовых рисков в деятельности организации.

1.2 Задачи изучения дисциплины.

Основными задачами изучения дисциплины являются:

- выяснение сущности каждого вида финансового риска, полного спектра воздействующих факторов, особенностей проявления, методов оценки и управления;
- изучение механизма воздействия финансовых рисков на производственную, инвестиционную и финансовую деятельность субъектов экономики;
- формирование современного представления об управлении предпринимательскими рисками,
- раскрытие сущности, принципов, критериев обоснования выбора конкретного метода управления финансовым риском;
- получение практических навыков по оценке финансовых рисков.

1.3 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

В соответствии с ФГОС ВО и учебным планом в результате изучения дисциплины «Управление финансовыми рисками» формируется следующая компетенция:

- способность на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты (ПК-4).

По результатам изучения дисциплины бакалавры должны знать:

- сущность, определение и классификацию финансовых рисков;

- понятийный аппарат в области финансовой среды и финансового риска;
- объекты, субъекты, цель и задачи управления финансовыми рисками;
- взаимосвязь между финансовыми рисками и результатами финансовой (инвестиционной) деятельности;
- методы и показатели оценки финансовых рисков;
- подходы в управлении финансовыми рисками;
- принципы организации управления финансовыми рисками;
- методы и способы управления различными видами финансовых рисков.

По результатам изучения дисциплины бакалавры должны уметь:

- определять финансовые риски;
- оценивать уровни финансовых рисков;
- правильно использовать методы оценки финансовых рисков;
- работать со статистическим и финансовым материалом для анализа и оценки финансовых рисков;
- оценивать последствия реализации различных финансовых рисков;
- выбирать оптимальные методы управления финансовыми рисками;

По результатам изучения дисциплины бакалавры должны владеть навыками:

- оценки величины риска и возможного ущерба;
- выбора метода управления финансовым риском в зависимости от его вида и степени влияния на финансовые результаты.
- создания, мониторинга и корректировки программы управления рисками на предприятии;

1.4 Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Управление финансовыми рисками» входит в вариативную часть дисциплин учебного плана как дисциплина по выбору студента (Б1.В.ДВ.11.1).

Дисциплина «Управление финансовыми рисками» базируется на изучении в полном объеме таких дисциплин как: Методы оптимальных решений, Статистика, Финансы организаций, Финансовые рынки и институты, Финансовый менеджмент.

1.5 Особенности реализации дисциплины

Реализация дисциплины осуществляется на русском языке

2. Объем дисциплины и виды учебной работы

Вид учебной работы	Всего, зачетных единиц (акад. часов)	В том числе Семестр 7
Общая трудоемкость дисциплины	2,0(72)	2,0(72)
Контактная работа с преподавателем	0,2 (18)	0,2 (18)
занятия лекционного типа	0,27 (10)	0,27 (10)
занятия семинарского типа	0,22 (8)	0,22 (8)
в т.ч. семинары		
практические занятия	0,22 (8)	0,22 (8)
практикумы	-	-
лабораторные работы	-	-
Другие виды контактной работы	-	-
в том числе: курсовое проектирования	-	-
групповые консультации	-	-
индивидуальные консультации	-	-
иные виды внеаудиторной контактной работы	-	-
Самостоятельная работа обучающихся	1,39 (50)	1,39 (50)
Изучение теоретического курса	1,39 (50)	1,39 (50)
Расчетные задания, задачи (РЗ)	-	-
Реферат, эссе	-	-
Курсовое проектирование	-	-
Вид промежуточной аттестации (зачет)	0,11 (4)	0,11 (4)

3 Содержание дисциплины

3.1 Содержание разделов (тем) дисциплины

№ темы	Название темы дисциплины	Лекции (акад. часов)	СЗ или ПЗ (акад. часов)	Самостоятельная работа (акад. часов)	Реализуемые компетенции
1	Финансовый риск как объект управления	1	-	8	ПК-4
2	Классификация финансовых рисков	2	-	6	ПК-4
3	Риск-менеджмент: понятие, стратегия и методы.	-	-	6	ПК-4

4	Оценка финансовых рисков	2	2	6	ПК-4
5	Механизмы нейтрализации финансовых рисков	2	2	6	ПК-4
6	Управление инфляционным и валютным рисками	1	-	6	ПК-4
7	Управление финансовыми рисками в операционной деятельности предприятия	2	4	6	ПК-4
8	Управление финансовыми рисками в инвестиционной деятельности организации	-	-	6	ПК-4
	Итого	10	8	50	-

3.2 Занятия лекционного типа

№ п/п	№ раздела дисциплины	Наименование занятий	Объем в акад. часах	
			всего	в том числе в инновационной форме
1.	1	Финансовый риск как объект управления	1	-
2.	2	Классификация финансовых рисков	2	2
3.	3	Риск-менеджмент: понятие, стратегия и методы.	-	-
4.	4	Оценка финансовых рисков	2	2
5.	5	Механизмы нейтрализации финансовых рисков	2	2
6.	6	Управление инфляционным и валютным рисками	1	-
7.	7	Управление финансовыми рисками в операционной деятельности предприятия	2	-
8.	8	Управления финансовыми рисками в инвестиционной деятельности организации	-	-
		Итого	10	6

3.3 Занятия семинарского типа

№ п/п	№ раздела дисциплины	Наименование занятий	Объем в акад. часах	
			всего	в том числе в инновационной форме
9.	1	Семинарское занятие : Финансовый риск как объект управления. Виды финансовых рисков	-	-
10.	3	Семинарское занятие: Современная система риск-менеджмента организации	-	-
11.	4	Практическое занятие : Оценка уровня риска с использованием экономико-статистических, экспертных, аналоговых методов	2	-

12.	5	Практическое занятие : Методы обоснования управленческих решений в условиях риска и неопределенности	2	-
13.	6	Практическое занятие : Управление риском снижения финансовой устойчивости	2	2
		Практическое занятие : Управление риском неплатежеспособности предприятия	2	2
14.	7	Практическое занятие : Управление инфляционным и валютным рисками	-	-
15.	8	Практическое занятие : Управление финансовыми рисками в инвестиционной деятельности организации	-	-
		Итого	8	4

3.4 Лабораторные занятия.

Учебным планом лабораторные занятия не предусмотрены

4 Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

Учебно-методическое обеспечение дисциплины для самостоятельной работы обучающихся представлено разработками, размещенными в научной библиотеке СФУ и в учебно-методическом комплексе дисциплины:

1 Управление рисками организации [Электронный ресурс] : учебное пособие / Г. Д. Антонов, О. П. Иванова, В. М. Тумин. - Москва : НИЦ ИНФРА-М, 2015. Режим доступа:

<http://znanium.com/bookread2.php?book=475625>

2 Управление рисками организации: Учебное пособие / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2015. - 153 с. Режим доступа: <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=475625>)

3 Управление рисками в условиях финансовой нестабильности/Домащенко Д. В., Финогенова Ю. Ю. - М.: Магистр, ИНФРА-М Издательский Дом, 2015. - 240 с.

Режим доступа: <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=502885>

5 Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации

Оценочные средства и критерии их оценивания приведены в Фонде оценочных средств в **приложении А** к рабочей программе.

В качестве текущего контроля усвоения дисциплины выступают терминологический диктант, контрольные работы и тесты., вопросы к зачету. Фонд тестовых заданий по курсу включает вопросы по всем темам курса, различных типов. Вопрос «Множественный выбор» – предполагает выбор

студентом ответа на вопрос из нескольких предложенных ему вариантов, причем вопросы могут предполагать один или несколько правильных ответов. Вопрос «На соответствие» - предполагает выбор соответствующего ответа для каждого подвопроса. Для каждого из подвопросов только один ответ является правильным. Каждый подвопрос автоматически имеет одинаковый вес. «Открытый вопрос» - предполагает самостоятельное написание обучающимся ответа на вопрос.

Форма текущей аттестации по дисциплине – зачет в письменном виде по зачетному заданию, которое содержит 2 теоретических вопроса, двадцать тестовых вопросов по курсу и одну задачу.

«Зачтено» - выставляется при условии, если студент показывает хорошие знания изученного учебного материала; полностью раскрывает содержание и смысл предлагаемых вопросов; владеет основными терминами и понятиями изученного курса и правильно дает ответы на 60% заданных тестовых вопросов ; показывает умение переложить теоретические знания на предполагаемый практический опыт, т.е. правильно решает задачу.

«Не зачтено» - выставляется при наличии серьезных упущений в процессе изложения учебного материала; в случае отсутствия знаний основных понятий и определений курса или присутствии большого количества ошибок при интерпретации основных определений; если студент показывает поверхностные знания или их отсутствие при ответе на предложенные теоретические и тестовые вопросы; при условии отсутствия правильно решенной задачи.

6 Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

6.1 Основная (нормативная) литература

1.Гражданский кодекс Российской Федерации от 14.12.2002 № 138-ФЗ - Режим доступа : КонсультантПлюс.

2.Об организации страхового дела в Российской Федерации, Закон РФ от 27.11.1992 г. № 4015-1

3.ГОСТ Р 50779.10-2000 (ИСО 3534-1-93) Статистические методы. Вероятность и основы статистики. Термины и определения

4.ГОСТ Р 51897-2002 Менеджмент риска. Термины и определения

5.ГОСТ Р 51901.2-2005 (МЭК 60300-1:2003) Менеджмент риска. Системы менеджмента надежности

6.ГОСТ Р 51901.16-2005 (МЭК 61164:1995) Менеджмент риска. Повышение надежности. Статистические критерии и методы оценки

7.О несостоятельности (банкротстве). Федеральный закон от 26.10.2002 N 127-ФЗ (принят ГД ФС РФ 27.09.2002) – Режим доступа : КонсультантПлюс.

8.О рынке ценных бумаг: Федеральный закон от 22.04.1996 № 39-ФЗ -
Режим доступа: КонсультантПлюс.

6.2 Основная (учебная) литература

1 Управление рисками организации [Электронный ресурс] : учебное пособие / Г. Д. Антонов, О. П. Иванова, В. М. Тумин. - Москва : НИЦ ИНФРА-М, 2015. Режим доступа:

<http://znanium.com/bookread2.php?book=475625>

2 Управление рисками организации: Учебное пособие / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2015. - 153 с. Режим доступа:

<http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=475625>)

3 Управление рисками в условиях финансовой нестабильности/Домашенко Д. В., Финогенова Ю. Ю. - М.: Магистр, ИНФРА-М Издательский Дом, 2015. - 240 с.

Режим доступа: <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=502885>

6.3 Дополнительная литература

4 Механизм комплексной оценки и управления рисками предприятий промышленности: Монография / М.Р. Дзагоева, А.Р. Цховребов, Л.Э. Комаева. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2014. - 120 с. Режим доступа:

<http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=453832>)

5 Савицкая Г.В. Анализ эффективности и рисков предпринимательской деятельности: методологические аспекты. – М.:ИНФРА-М, 2014. – 272 с. – (Научная мысль). НИЦ ИНФРА-М, 2014 Режим доступа:

<http://znanium.com/bookread2.php?book=428007>

6 Сутягин В. Ю. Финансовая среда предпринимательства: Учебное пособие / В.Ю. Сутягин, М.В. Беспалов, Р.Ю. Черкашнев. - М.: НИЦ ИНФРА -М, 2014. - 269 с.

Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=443588>

7 Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины (модуля)

www.cbr.ru

Центральный Банк Российской Федерации

bankir.ru

Информационно-аналитический портал

[www. finansist-kras.ru](http://www.finansist-kras.ru)

Информационно-аналитический портал в
Красноярском крае

www.finansy.ru

Экономика и финансы

[Бизнес-математические модели прогноза
финансового состояния](http://www.business-</p></div><div data-bbox=)

math.com/program2.php

Хеджинг без риска

www.hedging.ru

Годовые отчёты российских компаний

www.annualreport.ru

www.opec.ru	Экспертный канал
www.economist.com	The Economist
www.euromoney.com/default.asp	Euromoney
news.ft.com/home/rw	FinancialTimes
public.wsj.com/home.html	WallStreetJournal
www.worldeconomy.ru	Западные СМИ о мировой экономике
www.wtrg.com	Анализ по oil&gas
www.iet.ru	Институт экономики переходного периода Е. Гайдара
www.urbc.ru	Уралбизнесконсалтинг
www.cbonds.ru/index.phtml	Российский рынок облигаций
www.cfin.ru/index.shtml	Корпоративные финансы
www.disclosure.ru/rus/stats/title.jsp	Система раскрытия информации на РЦБ
www.forecast.ru	Центр макроэкономического анализа и краткосрочного прогнозирования
www.prmia.org	The Professional Risk Managers' International Association - Global Association of Risk Professionals
www.riskmanager.ru	Клуб российских риск-менеджеров
www.gifa.ru	Гильдия Инвестиционных и Финансовых Аналитиков
rrm.rea.ru	РЭА Риск-менеджмент
www.risks.ru	Институт управления рисками
risk.ifci.ch	International Finance & Commodities Institute
www.riskcenter.com	A Financial Risk Management News Media Company: Daily Risk News Feed
www.bacee.hu	ВАСЕЕ - Banking Association for Central and Eastern Europe
www.aimr.com	The Association for Investment Management and Research (AIMR), CFA сертификация
www.globalriskregulator.com	Global Risk Regulator (The independent and authoritative news source on risk based regulation)
www.standardandpoors.com	Рейтинговое агентство Standard&Poor's
www.moody.com/cust/default.asp	Moody's Ratings
http://www.micex.ru	Официальный сайт ММВБ
http://www.marketanalysis.ru	Портал по инструментам фондового рынка
http://www.raexpert.ru	Официальный сайт Рейтингового агентства «Эксперт»

8 Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Дисциплина «Управление финансовыми рисками» включает лекционный курс, семинарские (практические занятия), выполнение контрольной работы (для студентов заочного обучения).

На лекционных занятиях студентам излагаются основные положения теоретического материала по курсу «Управление финансовыми рисками» с сопровождением презентаций в Power Point.

Небольшое количество лекционных часов, отводимых программой на освещение каждой темы, требует самостоятельного изучения программных вопросов в процессе самостоятельной внеаудиторной работы, на которую программой дисциплины предполагается 58 часов.

Закрепление и углубление теоретического материала в процессе изучения дисциплины осуществляется на практических занятиях. Для студентов заочной формы обучения занятие проводится в форме практического занятия, посвященного решению хозяйственной ситуации.

Для успешной подготовки устных сообщений на семинарских и практических занятиях, кроме рекомендуемой к изучению литературы, студентам необходимо использовать публикации по изучаемой теме в журналах «Коммерсант», «Российское предпринимательство», «Управление риском», «Управление финансовыми рисками», «Финансовая аналитика: проблемы и решения», «Финансовый директор», «Финансовый менеджмент».

Для управления самостоятельной работой студентов используются следующие формы контроля:

- тематические консультации, в ходе которых студенты осмысливают полученную информацию, преподаватель определяет степень понимания темы и оказывает необходимую помощь;
- следящий контроль, который осуществляется на лекциях и практических занятиях, в форме бесед, устных ответов студентов, контрольных работ, тестов, опросов;
- текущий контроль осуществляется в ходе проверки и анализа отдельных видов самостоятельных работ, выполненных во внеаудиторное время. К ним относятся работы индивидуального характера: доклады, рефераты;
- итоговый контроль осуществляется через зачет, предусмотренный учебным планом.

Студенты заочной формы обучения до наступления экзаменационной сессии должны представить контрольную работу, выполненную в соответствии с методическими указаниями.

9 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине

9.1 Перечень необходимого программного обеспечения

Операционная система	Microsoft Windows Professional,
Офисный пакет	Microsoft Office Professional,
Браузер	Mozilla FireFox
Антивирус	ESET NOD32 Antivirus,

9.2 Перечень необходимых информационно-справочных систем

Информационно-справочные системы:

- СПС «Гарант»,
- СПС «Консультант Плюс»,

Информационные технологии:

- Поисковые системы: Google или Яндекс

Каждый обучающийся обеспечен доступом к электронно-библиотечной системе, содержащей издания по изучаемой дисциплине и сформированной по согласованию с правообладателями учебной и учебно-методической литературы. Библиотечный фонд укомплектован печатными и электронными изданиями основной учебной литературы по дисциплине, изданными за последние 5 лет.

Электронно-библиотечная система обеспечивает возможность индивидуального доступа для каждого обучающегося из любой точки, в которой имеется доступ к сети Интернет:

- 1 Научная библиотека СФУ <http://bik.sfu-kras.ru/>
- 2 Словари. ру. <http://slovari.ru/dictsearch>
- 3 Электронно-библиотечная система «Лань»: <http://e.lanbook.com>
- 4 Электронно-библиотечная система "ИНФРА-М":
<http://www.znaniyum.com>
- 5 ЭБ Издательского дома «Гребенников»: <http://grebennikon.ru>
- 6 Научная электронная библиотека (eLIBRARY.RU):
<http://elibrary.ru>

10 Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине

Для чтения лекций в виде презентаций используется ноутбук и проектор. Лекционные занятия по дисциплине проводятся с использованием презентационных материалов.

- 1 компьютерный класс с 25 компьютерами;
- 5 лекционных аудиторных комплексов снабженных: мультимедийными проекторами Optoma, ViewSonic, с пультами дистанционного управления, настенными экранами;
- 5 ноутбуков (ASUS X551MAV, Aser Aspire E1-571G, Dell Inspiron 3521, HP Pavilion dv6-3332er, Samsung R528);
- 1 методический кабинет с 6 компьютерами.