

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Клочков Юрий Владимирович  
Должность: и.о. ректора  
Дата подписания: 06.12.2024 10:58:59  
Уникальный программный ключ:  
4e7c4ea90328ec8e65c5d8058549a2538d7400d1

**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**  
Федеральное государственное бюджетное  
образовательное учреждение высшего образования  
**«ТЮМЕНСКИЙ ИНДУСТРИАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»**

**УТВЕРЖДАЮ**

\_\_\_\_\_ 2023 г.  
« \_\_\_\_\_ » \_\_\_\_\_

## **РАБОЧАЯ ПРОГРАММА**

дисциплины: Финансовый риск-менеджмент

специальность: **08.05.01** Строительство уникальных зданий и сооружений; **08.05.02** Строительство, эксплуатация, восстановление и техническое прикрытие автомобильных дорог, мостов, тоннелей; **21.05.02** Прикладная геология

Рабочая программа рассмотрена  
на заседании кафедры МТЭК  
Протокол № \_\_\_\_\_ от «\_\_\_» \_\_\_\_\_ 2023 г.

Заведующий кафедрой \_\_\_\_\_ В. В. Пленкина

Рабочую программу разработал:

С.В.Фролова, старший преподаватель \_\_\_\_\_

## 1. Цели и задачи освоения дисциплины

**Цель** дисциплины «Финансовый риск-менеджмент» - структуризация первоначальных знаний о системе управления рисками компании, формирование знаний у обучающихся об инструментах идентификации и классификации финансовых рисков, методиках оценки, а также получение навыков по снижению вероятности реализации рисков событий.

**Задачами** освоения дисциплины являются: знакомство обучающихся с основными понятиями менеджмента риска в сфере финансов; системой классификации и идентификации финансовых рисков; методами качественной и количественной оценки финансовых рисков; способами управления финансовыми рисками и их классификацией.

## 2. Место дисциплины в структуре ОПОП ВО

Дисциплина «Финансовый риск-менеджмент» относится к элективным дисциплинам модуля «Управление рисками».

Необходимыми условиями для освоения дисциплины являются:

знание основ управления и логики,

умения искать, систематизировать информацию,

владение навыками обобщения и анализа информации.

## 3. Результаты обучения по дисциплине

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

Таблица 3.1

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции (ИДК)	Код и наименование результата обучения по дисциплине
ПКСд-6 Способен выявлять, идентифицировать и прогнозировать риски с учетом отраслевой специфики; оценивать и управлять различными видами рисков на основе выбора эффективных методов воздействия	ПКСд-6.1 Выявляет, идентифицирует и прогнозирует риски с учетом отраслевой специфики; управляет различными видами рисков на основе выбора эффективных методов воздействия	Знать: 31 методы воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критерии, применяемые при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методы, техники, технологии управления финансовыми рисками; возможности инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации
		Уметь: У1 определять эффективные методы воздействия на финансовый риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на финансовые риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственным за риск сотрудникам в правильной оценке финансового риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления финансовыми рисками с учетом отраслевой специфики; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды финансовых рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности; формировать формы отчетности, дорожные карты для целей

		реализации и мониторинга мероприятий по воздействию на финансовые риски.
		Владеть: В1 навыками осуществления качественной и количественной оценки финансовых рисков; навыками разработки стратегии элиминирования финансовых рисков (хеджирование, диверсификация, страхование); навыками использования современных методов управления финансовыми рисками нефинансовых компаний для обеспечения динамического развития их бизнеса, проведения самостоятельных исследований в области управления финансовыми рисками нефинансовых компаний в соответствии с разработанной программой; навыками разработки прогнозов развития определенной области знаний (технологий) в условиях риска и неопределенности; способностью разрабатывать (формулировать) основные стратегии управления финансовыми рисками; навыками определения качественных и количественных критериев эффективности системы управления финансовыми рисками.

#### 4. Объем дисциплин

Общий объем дисциплины составляет 3 зачетных единиц, 108 часов.

Таблица 4.1.

Форма обучения	Курс/ семестр	Аудиторные занятия/контактная работа, час.			Самостоятельная работа, час.	Контроль, час	Форма промежуточной аттестации
		Лекции	Практические занятия	Лабораторные занятия			
очная	3/6	18	34	-	56	-	зачет
заочная	3/6	6	10	-	88	4	зачет

#### 5. Структура и содержание дисциплины

##### 5.1. Структура дисциплины.

##### очная форма обучения (ОФО)

Таблица 5.1.1

№ п/п	Структура дисциплины		Аудиторные занятия, час.			СРС, час.	Всего, час.	Код ИДК	Оценочные средства
	Номер раздела	Наименование раздела	Л.	Пр.	Лаб.				
1	1	Управление финансовыми рисками	6	12	0	18	36	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
2	2	Организация менеджмента финансовых рисков компании	6	12	0	18	36	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
3	3	Основные организационные формы снижения финансового риска	6	10	0	20	36	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
Итого:			18	34	0	56	108		

**заочная форма обучения (ЗФО)**

Таблица 5.1.2

№ п/п	Структура дисциплины		Аудиторные занятия, час.			СРС, час.	Всего, час.	Код ИДК	Оценочные средства
	Номер раздела	Наименование раздела	Л.	Пр.	Лаб.				
1	1	Управление финансовыми рисками	2	4	0	29	35	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
2	2	Организация менеджмента финансовых рисков компании	2	2	0	30	34	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
3	3	Основные организационные формы снижения финансового риска	2	4	0	29	35	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
4	Зачет		-	-	-	-	4		тестирование
Итого:			6	10	0	88	108		

**5.2. Содержание дисциплины.**

**5.2.1. Содержание разделов дисциплины (дидактические единицы).**

Раздел 1. «Управление финансовыми рисками». Активные, пассивные и адаптивные подходы к управлению финансовыми рисками. Финансовая среда предпринимательства и модели управления рисками. Стратегии управления рисками: «Управления инцидентами», «Прогнозирования», «Проактивного управления». Техники менеджмента финансового риска.

Раздел 2. «Организация менеджмента финансовых рисков компании». Функции менеджмента финансового риска. Технологические элементы процесса управления рисками. Информационное обеспечение управления риском. Документирование. Распределение и закрепление ответственности и полномочий. Мониторинг и повторная оценка риска. Планирование управления рисками. Отчет о рисках.

Раздел 3. «Основные организационные формы снижения финансового риска». Распределение риска между участниками проекта. Синдикат. Проектное финансирование. Венчурное финансирование. Андеррайтинг. Лизинг. Франчайзинг. Факторинг. Ипотека.

**5.2.2. Содержание дисциплины по видам учебных занятий.**

**Лекционные занятия**

Таблица 5.2.1

№ п/п	Номер раздела дисциплины	Объем, час.			Тема лекции
		ОФО	ЗФО	ОЗФО	
1	1	6	2	-	Управление финансовыми рисками
2	2	6	2	-	Организация менеджмента финансовых рисков компании
3	3	6	2	-	Основные организационные формы снижения финансового риска
Итого:		18	6	-	-

**Практические занятия**

Таблица 5.2.3

№ п/п	Номер раздела дисциплины	Объем, час.			Тема лекции
		ОФО	ЗФО	ОЗФО	
1	1	12	4	-	Управление финансовыми рисками

2	3	12	2	-	Организация менеджмента финансовых рисков компании
3	4	10	4	-	Основные организационные формы снижения финансового риска
Итого:		34	10	-	-

Лабораторные работы учебным планом не предусмотрены.

### Самостоятельная работа студента

Таблица 5.2.7

№ п/п	Номер раздела дисциплины	Объем, час.			Тема	Вид СРС
		ОФО	ЗФО	ОФО		
1	1	18	29	-	Управление финансовыми рисками	Решение кейса №1
3	2	18	30	-	Организация менеджмента финансовых рисков компании	Решение кейса №2
6	3	20	29	-	Основные организационные формы снижения финансового риска	Решение кейса №3
Итого:		56	88	-		

5.2.3. Преподавание дисциплины ведется с применением следующих видов образовательных технологий:

- визуализация учебного материала в PowerPoint в диалоговом режиме, дискуссия (лекционные занятия);
- работа в малых группах (практические занятия);
- разбор практических ситуаций и кейсов (практические занятия).

## 6. Тематика курсовых работ/проектов

Курсовые работы/проекты учебным планом не предусмотрены.

## 7. Контрольные работы

7.1. Методические указания для выполнения контрольных работ. Контрольная работа выполняется обучающимися **заочной формы** обучения в **6 семестре** и является допуском к промежуточной аттестации. Контрольная работа выполняется по вариантам согласно последней цифре в зачетной книжке обучающегося.

№ варианта	Перечень вопросов
Вариант 1	Понятие риска и его природа. Развитие взглядов на риски
	Особенности деятельности страхового брокера и страхового агента
Вариант 2	Классификация финансовых рисков. Основные виды финансовых рисков и их характеристика.
	Зарубежные модели оценки совокупного финансового риска
Вариант 3	Способы управления финансовыми рисками и их содержание
	Сущность и содержание актуарных расчетов
Вариант 4	Сущность и функции финансового риск-менеджмента
	Страхование прав собственности на недвижимость
Вариант 5	Нормативно-правовая основа управления финансовыми рисками и страхования
	Сравнительная характеристика сострахования и перестрахования

№ варианта	Перечень вопросов
Вариант 6	Задачи и процесс управления финансовыми рисками
	Страхование финансовых рисков (сущность и специфика, краткая характеристика видов и условий)
Вариант 7	Основные математические методы оценки финансовых рисков
	Финансовая устойчивость страховых операций (компаний) и ее показатели
Вариант 8	Диагностика, анализ и картографирование финансовых рисков
	Страхование предпринимательской деятельности (сущность и специфика, краткая характеристика видов и условий)
Вариант 9	Экспертная оценка финансовых рисков: виды, сущность и необходимость использования
	Страховой маркетинг, его функции
Вариант 0	Классификация методов выявления и оценки финансовых рисков
	Активные, пассивные и адаптивные подходы к управлению финансовыми рисками

## 8. Оценка результатов освоения дисциплины

8.1. Критерии оценивания степени полноты и качества освоения компетенций в соответствии с планируемыми результатами обучения приведены в Приложении 1.

8.2. Рейтинговая система оценивания степени полноты и качества освоения компетенций обучающихся очной формы обучения представлена в таблице 8.1.

Таблица 8.1

№ п/п	Виды мероприятий в рамках текущего контроля	Количество баллов
1 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
	<b>ИТОГО за первую текущую аттестацию</b>	<b>0-30</b>
2 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
	<b>ИТОГО за вторую текущую аттестацию</b>	<b>0-30</b>
3 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
2	Тестирование	0-10
	<b>ИТОГО за третью текущую аттестацию</b>	<b>0-40</b>
	<b>ВСЕГО</b>	<b>100</b>

8.3. Рейтинговая система оценивания степени полноты и качества освоения компетенций обучающихся заочной формы обучения представлена в таблице 8.2.

Таблица 8.2

№ п/п	Виды мероприятий в рамках текущего контроля	Количество баллов
1	Выполнение практических кейс-заданий	90
2	Итоговый контроль (тестовый)	10
	<b>ВСЕГО</b>	<b>100</b>

## 9. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

9.1. Перечень рекомендуемой литературы представлен в Приложении 2.

9.2. Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы

- Электронный каталог/Электронная библиотека ТИУ <http://webirbis.tsogu.ru/>

- Цифровой образовательный ресурс – библиотечная система IPR SMART —

<https://www.iprbookshop.ru/>

- Электронно-библиотечная система «Консультант студента» [www.studentlibrary.ru](http://www.studentlibrary.ru)

- Электронно-библиотечная система «Лань» <https://e.lanbook.com>

- Образовательная платформа ЮРАЙТ [www.uraity.ru](http://www.uraity.ru)
  - Научная электронная библиотека ELIBRARY.RU <http://www.elibrary.ru>
  - Национальная электронная библиотека (НЭБ)
  - Библиотеки нефтяных вузов России :
  - Электронная нефтегазовая библиотека РГУ нефти и газа им. Губкина <http://elib.gubkin.ru/>,
  - Электронная библиотека Уфимского государственного нефтяного технического университета <http://bibl.rusoil.net/> ,
  - Библиотечно-информационный комплекс Ухтинского государственного технического университета УГТУ <http://lib.ugtu.net/books>
  - Электронная справочная система нормативно-технической документации «Технорматив»
  - ЭКБСОН- информационная система доступа к электронным каталогам библиотек сферы образования и науки.
11. Информационный портал Правительства Российской Федерации - Правительство.рф
  12. Информационный портал Президента Российской Федерации - Президент.рф
  13. Интернет портал для управленцев <http://www.management.com.ua/?lang=rus>
  14. Экономика и менеджмент. Высокие статистические технологии <http://orlovs.pp.ru/econ.php>

9.3. Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в т.ч. отечественного производства

1. Microsoft Windows
2. Microsoft Office Professional Plus
3. Zoom (свободно-распространяемое ПО)
4. Skype (свободно-распространяемое ПО)

## 10. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Помещения для проведения всех видов работы, предусмотренных учебным планом, укомплектованы необходимым оборудованием и техническими средствами обучения.

Таблица 10.1

### Обеспеченность материально-технических условий реализации ОПОП ВО

№ п/п	Наименование учебных предметов, курсов, дисциплин (модулей), практики, иных видов учебной деятельности, предусмотренных учебным планом образовательной программы	Наименование помещений для проведения всех видов учебной деятельности, предусмотренной учебным планом, в том числе помещения для самостоятельной работы, с указанием перечня основного оборудования, учебно-наглядных пособий и используемого программного обеспечения	Адрес (местоположение) помещений для проведения всех видов учебной деятельности, предусмотренной учебным планом (в случае реализации образовательной программы в сетевой форме дополнительно указывается наименование организации, с которой заключен договор)
1	2	3	4
1	Финансовый риск-менеджмент	<p>Лекционные занятия: Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа; групповых и индивидуальных консультаций; текущего контроля и промежуточной аттестации, Оснащенность: Учебная мебель: столы, стулья. Моноблок - 1 шт., проектор - 1 шт., проекционный экран - 1 шт., акустическая система (колонки) - 2 шт., документ - камера - 1 шт.</p> <p>Практические занятия: Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа (практические занятия); групповых и индивидуальных консультаций; текущего контроля и</p>	<p>625039, Тюменская область, г. Тюмень, ул. Мельникайте, д.70</p> <p>625039, Тюменская область, г. Тюмень, ул. Мельникайте, д.70</p>



		промежуточной аттестации, Учебная лаборатория. Оснащенность: Учебная мебель: столы, стулья. Моноблок - 1 шт., проектор - 1 шт., проекционный экран - 1 шт., акустическая система (колонки) - 2 шт., документ - камера - 1 шт.	
--	--	---	--

## 11. Методические указания по организации СРС

### 11.1. Методические указания по подготовке к практическим занятиям.

Одним из результатов обучения является приобретение навыков, это действия, которые вследствие многократных повторений становятся автоматическими, выполняются без видимого контроля со стороны сознания, значит, в учебном процессе должны быть условия для такой многократности. Умения и навыки обучающиеся приобретают и отрабатывают на практических занятиях.

Практические занятия - это занятия, проводимые под руководством преподавателя в учебной аудитории, направленные на углубление научно- теоретических знаний и овладение определенными методами самостоятельной работы. В процессе таких занятий вырабатываются практические умения (вычислений, расчетов, использования таблиц, справочников и др.). Аудиторные практические занятия играют исключительно важную роль в выработке у обучающихся навыков применения полученных знаний для решения практических задач в процессе совместной деятельности с преподавателями. Практические занятия призваны углубить, расширить и детализировать эти знания, содействовать выработке навыков профессиональной деятельности. Практические занятия развивают научное мышление и речь обучающихся, позволяют проверить их знания, в связи с чем, практические работы выступают важным средством достаточно оперативной обратной связи.

Перед практическим занятием обучающемуся следует изучить конспект лекции и рекомендованную преподавателем литературу, обращая внимание на практическое применение теории и на методику решения типовых задач. На практическом занятии обучающийся должен уяснить связь решаемых задач с теоретическими положениями. При решении предложенной задачи обучающийся должен стремиться не только получить правильный ответ, но и усвоить общий метод решения подобных задач.

Логическая связь лекций и практических занятий заключается в том, что информация, полученная на лекции, в процессе самостоятельной работы на практическом занятии осмысливается и перерабатывается, при помощи преподавателя анализируется до мельчайших подробностей, после чего прочно усваивается. Для успешной подготовки к практическим занятиям обучающемуся невозможно ограничиться слушанием лекций. Требуется предварительная самостоятельная работа обучающихся по теме планируемого занятия.

Основное назначение практических занятий - преобразование знаний в умения и навыки, овладение способами деятельности и на этой основе подготовка обучающихся к будущей профессиональной деятельности. Содержанием практических занятий могут быть задачи аналитического характера, разбор кейсов, либо эти занятия могут проводиться по принципу мини-заданий, в том числе групповых, где предложенные обучающимся задания могут быть ориентированы:

- на уровень узнавания, например, на выбор из нескольких понятий нужного;
- на уровень репродукции, т. е. воспроизведение полученных знаний, умений, навыков;
- на вариантно-воспроизводящий уровень (операционный) т.е. осуществление простейших операций по готовым образцам;
- на аналитико-синтетический уровень, т.е. на умение обобщать, дифференцировать знания, умения и навыки, связывать старое с новым;
- на творческий уровень, т. е. на способность переносить имеющиеся знания и умения в новую ситуацию, решать неординарные задачи.

## 11.2. Методические указания по организации самостоятельной работы.

Время, которым располагает обучающийся для выполнения учебного плана, складывается из двух составляющих: одна из них - это аудиторная работа в вузе по расписанию занятий, другая - внеаудиторная самостоятельная работа. Задания и материалы для самостоятельной работы выдаются во время учебных занятий по расписанию, на этих же занятиях преподаватель осуществляет контроль за самостоятельной работой, а также оказывает помощь обучающимся по правильной организации работы.

Самостоятельная работа обучающихся при изучении дисциплины «Методы и модели в управлении» заключается в углубленном рассмотрении отдельных вопросов курса по имеющимся научным, периодическим изданиям, статистической информации, а также с использованием интернет - ресурсов. Кроме того, в целях получения и закрепления практических навыков, а также дальнейшей проработки отдельных тем целесообразно проведение целевых аналитических работ, предполагающих проработку теоретических вопросов, практического опыта и подтверждающей статистической информации при рассмотрении вопросов управления. Подобные задания целесообразно использовать для групповой работы обучающихся под научным руководством преподавателя. Они представляют собой начальную форму самостоятельного научного исследования, результаты которого могут быть представлены в виде сообщений на текущих практических занятиях и выступать в качестве одного из элементов промежуточной аттестации по данной дисциплине. Проверка полученных в процессе обучения и самостоятельной работы знаний осуществляется при помощи вопросов для самоконтроля, а также вопросов и заданий для самостоятельного выполнения.

Самостоятельная работа обучающихся направлена на закрепление, приумножение и приращение знаний, навыков и умений преимущественно в формате профессиональных компетенций.

## Планируемые результаты обучения для формирования компетенции и критерии их оценивания

Дисциплина Финансовый риск-менеджмент

Код, специальность 08.05.01 Строительство уникальных зданий и сооружений; 08.05.02 Строительство, эксплуатация, восстановление и техническое прикрытие автомобильных дорог, мостов, тоннелей; 21.05.02 Прикладная геология

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине (модулю)	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
<p>ПКСд-6 Способен выявлять, идентифицировать и прогнозировать риски с учетом отраслевой специфики; оценивать и управлять различными видами рисков на основе выбора эффективных методов воздействия</p>	<p>ПКСд-6.1 Выявляет, идентифицирует и прогнозирует риски с учетом отраслевой специфики; управляет различными видами рисков на основе выбора эффективных методов воздействия</p>	<p>Знать: 31 методы воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критерии, применяемые при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методы, техники, технологий управления финансовыми рисками; возможности инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации</p>	<p>Не знает методов воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критериев, применяемых при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методов, техники, технологий управления финансовыми рисками; возможностей инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации</p>	<p>Демонстрирует фрагментарные знания методов воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критериев, применяемых при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методов, техники, технологий управления финансовыми рисками; возможностей инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации</p>	<p>Демонстрирует достаточные знания методов воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критериев, применяемых при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методов, техники, технологий управления финансовыми рисками; возможностей инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации</p>	<p>Демонстрирует исчерпывающие знания методов воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критериев, применяемых при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методов, техники, технологий управления финансовыми рисками; возможностей инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации</p>

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине (модулю)	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
		<p>Уметь: У1 определять эффективные методы воздействия на финансовый риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на финансовые риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственному за риск сотрудникам в правильной оценке финансового риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления финансовыми рисками с учетом отраслевой специфики; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды финансовых рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности; формировать формы отчетности, дорожные карты для целей реализации и мониторинга мероприятий по воздействию на финансовые</p>	<p>Не умеет определять эффективные методы воздействия на финансовый риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на финансовые риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственному за риск сотрудникам в правильной оценке финансового риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления финансовыми рисками с учетом отраслевой специфики; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды финансовых рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности; формировать формы отчетности, дорожные карты для целей реализации и мониторинга мероприятий по воздействию на финансовые риски.</p>	<p>Фрагментарно умеет определять эффективные методы воздействия на финансовый риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на финансовые риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственному за риск сотрудникам в правильной оценке финансового риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления финансовыми рисками с учетом отраслевой специфики; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды финансовых рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности; формировать формы отчетности</p>	<p>Умеет определять эффективные методы воздействия на финансовый риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на финансовые риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственному за риск сотрудникам в правильной оценке финансового риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления финансовыми рисками с учетом отраслевой специфики; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды финансовых рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности; формировать формы отчетности, дорожные карты</p>	<p>Умеет уверенно и достоверно определять эффективные методы воздействия на финансовый риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на финансовые риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственному за риск сотрудникам в правильной оценке финансового риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления финансовыми рисками с учетом отраслевой специфики; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды финансовых рисков и эффективно применять их с</p>





**КАРТА**  
**обеспеченности дисциплины учебной и учебно-методической литературой**

дисциплины: Финансовый риск-менеджмент

Код, специальность 08.05.01 Строительство уникальных зданий и сооружений; 08.05.02 Строительство, эксплуатация, восстановление и техническое прикрытие автомобильных дорог, мостов, тоннелей; 21.05.02 Прикладная геология

№ п/п	Название учебного, учебно-методического издания, автор, издательство, вид издания, год издания	Количество экземпляров в БИК	Контингент обучающихся, использую	Обеспеченность обучающихся литературой, %	Наличие электронного варианта в ЭБС (+/-)
1	Слепухина, Ю. Э. Риск-менеджмент на финансовых рынках : учебное пособие / Ю. Э. Слепухина. — Екатеринбург : Уральский федеральный университет, ЭБС АСВ, 2015. — 216 с. — ISBN 978-5-7996-1522-2. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <a href="https://www.iprbookshop.ru/68289.html">https://www.iprbookshop.ru/68289.html</a>	ЭР*	30	100	+
2	Управление финансовыми рисками. Практикум : учебное пособие для вузов / И. П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И. П. Хоминич. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 129 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-13920-4. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/519556">https://urait.ru/bcode/519556</a>	ЭР*	30	100	+
3	Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 1 : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 211 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02606-1. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/512634">https://urait.ru/bcode/512634</a>	ЭР*	30	100	+
4	Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 2 : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 250 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02608-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/512635">https://urait.ru/bcode/512635</a>	ЭР*	30	100	+
5	Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 3 : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 272 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02609-2. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/512636">https://urait.ru/bcode/512636</a>	ЭР*	30	100	+

6	Латышева, Л. А. Финансовый риск-менеджмент : учебник / Л. А. Латышева, Ю. М. Складорова, И. Ю. Складорова. — Ставрополь : СтГАУ, 2021. — 376 с. — ISBN 976-5-9908446-1-2. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <a href="https://e.lanbook.com/book/245735">https://e.lanbook.com/book/245735</a>	ЭР*	30	100	+
---	---	-----	----	-----	---

ЭР\* – электронный ресурс для авторизованных пользователей доступен через Электронный каталог/Электронную библиотеку ТИУ <http://webirbis.tsogu.ru/>



**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**  
Федеральное государственное бюджетное  
образовательное учреждение высшего образования  
«ТЮМЕНСКИЙ ИНДУСТРИАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

**УТВЕРЖДАЮ**

\_\_\_\_\_ 2023 г.  
« \_\_\_\_\_ » \_\_\_\_\_

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА**

дисциплины: Финансовый риск-менеджмент

специальность: **21.05.01 Прикладная геодезия**

Рабочая программа рассмотрена  
на заседании кафедры МТЭК  
Протокол № \_\_\_\_\_ от «\_\_\_» \_\_\_\_\_ 2023 г.

Заведующий кафедрой \_\_\_\_\_ В. В. Пленкина

Рабочую программу разработал:

С.В.Фролова, старший преподаватель \_\_\_\_\_

## 1. Цели и задачи освоения дисциплины

**Цель** дисциплины «Финансовый риск-менеджмент» - структуризация первоначальных знаний о системе управления рисками компании, формирование знаний у обучающихся об инструментах идентификации и классификации финансовых рисков, методиках оценки, а также получение навыков по снижению вероятности реализации рисков событий.

**Задачами** освоения дисциплины являются: знакомство обучающихся с основными понятиями менеджмента риска в сфере финансов; системой классификации и идентификации финансовых рисков; методами качественной и количественной оценки финансовых рисков; способами управления финансовыми рисками и их классификацией.

## 2. Место дисциплины в структуре ОПОП ВО

Дисциплина «Финансовый риск-менеджмент» относится к элективным дисциплинам модуля «Управление рисками».

Необходимыми условиями для освоения дисциплины являются:

знание основ управления и логики,

умения искать, систематизировать информацию,

владение навыками обобщения и анализа информации.

## 3. Результаты обучения по дисциплине

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

Таблица 3.1

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции (ИДК)	Код и наименование результата обучения по дисциплине
ПКСд-6 Способен выявлять, идентифицировать и прогнозировать риски с учетом отраслевой специфики; оценивать и управлять различными видами рисков на основе выбора эффективных методов воздействия	ПКСд-6.1 Выявляет, идентифицирует и прогнозирует риски с учетом отраслевой специфики; управляет различными видами рисков на основе выбора эффективных методов воздействия	Знать: 31 методы воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критерии, применяемые при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методы, техники, технологии управления финансовыми рисками; возможности инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации
		Уметь: У1 определять эффективные методы воздействия на финансовый риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на финансовые риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственным за риск сотрудникам в правильной оценке финансового риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления финансовыми рисками с учетом отраслевой специфики; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды финансовых рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности; формировать формы отчетности, дорожные карты для целей

		реализации и мониторинга мероприятий по воздействию на финансовые риски.
		Владеть: В1 навыками осуществления качественной и количественной оценки финансовых рисков; навыками разработки стратегии элиминирования финансовых рисков (хеджирование, диверсификация, страхование); навыками использования современных методов управления финансовыми рисками нефинансовых компаний для обеспечения динамического развития их бизнеса, проведения самостоятельных исследований в области управления финансовыми рисками нефинансовых компаний в соответствии с разработанной программой; навыками разработки прогнозов развития определенной области знаний (технологий) в условиях риска и неопределенности; способностью разрабатывать (формулировать) основные стратегии управления финансовыми рисками; навыками определения качественных и количественных критериев эффективности системы управления финансовыми рисками.

#### 4. Объем дисциплин

Общий объем дисциплины составляет 3 зачетных единиц, 108 часов.

Таблица 4.1.

Форма обучения	Курс/ семестр	Аудиторные занятия/контактная работа, час.			Самостоятельная работа, час.	Контроль, час	Форма промежуточной аттестации
		Лекции	Практические занятия	Лабораторные занятия			
очная	3/6	16	30	-	62	-	зачет
заочная	3/6	6	10	-	88	4	зачет

#### 5. Структура и содержание дисциплины

##### 5.1. Структура дисциплины.

##### очная форма обучения (ОФО)

Таблица 5.1.1

№ п/п	Структура дисциплины		Аудиторные занятия, час.			СРС, час.	Всего, час.	Код ИДК	Оценочные средства
	Номер раздела	Наименование раздела	Л.	Пр.	Лаб.				
1	1	Управление финансовыми рисками	6	10	0	20	38	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
2	2	Организация менеджмента финансовых рисков компании	6	10	0	20	36	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
3	3	Основные организационные формы снижения финансового риска	4	10	0	22	34	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
Итого:			16	30	0	62	108		

**заочная форма обучения (ОФО)**

Таблица 5.1.2

№ п/п	Структура дисциплины		Аудиторные занятия, час.			СРС, час.	Всего, час.	Код ИДК	Оценочные средства
	Номер раздела	Наименование раздела	Л.	Пр.	Лаб.				
1	1	Управление финансовыми рисками	2	4	0	29	35	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
2	2	Организация менеджмента финансовых рисков компании	2	2	0	30	34	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
3	3	Основные организационные формы снижения финансового риска	2	4	0	29	35	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
4	Зачет		-	-	-	-	4		тестирование
Итого:			6	10	0	88	108		

**5.2. Содержание дисциплины.**

**5.2.1. Содержание разделов дисциплины (дидактические единицы).**

Раздел 1. «Управление финансовыми рисками». Активные, пассивные и адаптивные подходы к управлению финансовыми рисками. Финансовая среда предпринимательства и модели управления рисками. Стратегии управления рисками: «Управления инцидентами», «Прогнозирования», «Проактивного управления». Техники менеджмента финансового риска.

Раздел 2. «Организация менеджмента финансовых рисков компании». Функции менеджмента финансового риска. Технологические элементы процесса управления рисками. Информационное обеспечение управления риском. Документирование. Распределение и закрепление ответственности и полномочий. Мониторинг и повторная оценка риска. Планирование управления рисками. Отчет о рисках.

Раздел 3. «Основные организационные формы снижения финансового риска». Распределение риска между участниками проекта. Синдикат. Проектное финансирование. Венчурное финансирование. Андеррайтинг. Лизинг. Франчайзинг. Факторинг. Ипотека.

**5.2.2. Содержание дисциплины по видам учебных занятий.**

**Лекционные занятия**

Таблица 5.2.1

№ п/п	Номер раздела дисциплины	Объем, час.			Тема лекции
		ОФО	ЗФО	ОЗФО	
1	1	6	2	-	Управление финансовыми рисками
2	2	6	2	-	Организация менеджмента финансовых рисков компании
3	3	4	2	-	Основные организационные формы снижения финансового риска
Итого:		16	6	-	-

**Практические занятия**

Таблица 5.2.3

№ п/п	Номер раздела дисциплины	Объем, час.			Тема лекции
		ОФО	ЗФО	ОЗФО	
1	1	10	4	-	Управление финансовыми рисками

2	3	10	2	-	Организация менеджмента финансовых рисков компании
3	4	10	4	-	Основные организационные формы снижения финансового риска
Итого:		30	10	-	-

Лабораторные работы учебным планом не предусмотрены.

### Самостоятельная работа студента

Таблица 5.2.7

№ п/п	Номер раздела дисциплины	Объем, час.			Тема	Вид СРС
		ОФО	ЗФО	ОФО		
1	1	20	29	-	Управление финансовыми рисками	Решение кейса №1
3	2	20	30	-	Организация менеджмента финансовых рисков компании	Решение кейса №2
6	3	22	29	-	Основные организационные формы снижения финансового риска	Решение кейса №3
Итого:		62	88	-		

5.2.3. Преподавание дисциплины ведется с применением следующих видов образовательных технологий:

- визуализация учебного материала в PowerPoint в диалоговом режиме, дискуссия (лекционные занятия);
- работа в малых группах (практические занятия);
- разбор практических ситуаций и кейсов (практические занятия).

## 6. Тематика курсовых работ/проектов

Курсовые работы/проекты учебным планом не предусмотрены.

## 7. Контрольные работы

7.1. Методические указания для выполнения контрольных работ. Контрольная работа выполняется обучающимися **заочной формы** обучения в **6 семестре** и является допуском к промежуточной аттестации. Контрольная работа выполняется по вариантам согласно последней цифре в зачетной книжке обучающегося.

№ варианта	Перечень вопросов
Вариант 1	Понятие риска и его природа. Развитие взглядов на риски
	Особенности деятельности страхового брокера и страхового агента
Вариант 2	Классификация финансовых рисков. Основные виды финансовых рисков и их характеристика.
	Зарубежные модели оценки совокупного финансового риска
Вариант 3	Способы управления финансовыми рисками и их содержание
	Сущность и содержание актуарных расчетов
Вариант 4	Сущность и функции финансового риск-менеджмента
	Страхование прав собственности на недвижимость
Вариант 5	Нормативно-правовая основа управления финансовыми рисками и страхования
	Сравнительная характеристика сострахования и перестрахования

№ варианта	Перечень вопросов
Вариант 6	Задачи и процесс управления финансовыми рисками
	Страхование финансовых рисков (сущность и специфика, краткая характеристика видов и условий)
Вариант 7	Основные математические методы оценки финансовых рисков
	Финансовая устойчивость страховых операций (компаний) и ее показатели
Вариант 8	Диагностика, анализ и картографирование финансовых рисков
	Страхование предпринимательской деятельности (сущность и специфика, краткая характеристика видов и условий)
Вариант 9	Экспертная оценка финансовых рисков: виды, сущность и необходимость использования
	Страховой маркетинг, его функции
Вариант 0	Классификация методов выявления и оценки финансовых рисков
	Активные, пассивные и адаптивные подходы к управлению финансовыми рисками

## 8. Оценка результатов освоения дисциплины

8.1. Критерии оценивания степени полноты и качества освоения компетенций в соответствии с планируемыми результатами обучения приведены в Приложении 1.

8.2. Рейтинговая система оценивания степени полноты и качества освоения компетенций обучающихся очной формы обучения представлена в таблице 8.1.

Таблица 8.1

№ п/п	Виды мероприятий в рамках текущего контроля	Количество баллов
1 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
	<b>ИТОГО за первую текущую аттестацию</b>	<b>0-30</b>
2 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
	<b>ИТОГО за вторую текущую аттестацию</b>	<b>0-30</b>
3 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
2	Тестирование	0-10
	<b>ИТОГО за третью текущую аттестацию</b>	<b>0-40</b>
	<b>ВСЕГО</b>	<b>100</b>

8.3. Рейтинговая система оценивания степени полноты и качества освоения компетенций обучающихся заочной формы обучения представлена в таблице 8.2.

Таблица 8.2

№ п/п	Виды мероприятий в рамках текущего контроля	Количество баллов
1	Выполнение практических кейс-заданий	90
2	Итоговый контроль (тестовый)	10
	<b>ВСЕГО</b>	<b>100</b>

## 9. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

9.1. Перечень рекомендуемой литературы представлен в Приложении 2.

9.2. Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы

- Электронный каталог/Электронная библиотека ТИУ <http://webirbis.tsogu.ru/>

- Цифровой образовательный ресурс – библиотечная система IPR SMART —

<https://www.iprbookshop.ru/>

- Электронно-библиотечная система «Консультант студента» [www.studentlibrary.ru](http://www.studentlibrary.ru)

- Электронно-библиотечная система «Лань» <https://e.lanbook.com>

- Образовательная платформа ЮРАЙТ [www.urait.ru](http://www.urait.ru)
  - Научная электронная библиотека ELIBRARY.RU <http://www.elibrary.ru>
  - Национальная электронная библиотека (НЭБ)
  - Библиотеки нефтяных вузов России :
  - Электронная нефтегазовая библиотека РГУ нефти и газа им. Губкина <http://elib.gubkin.ru/>,
  - Электронная библиотека Уфимского государственного нефтяного технического университета <http://bibl.rusoil.net/> ,
  - Библиотечно-информационный комплекс Ухтинского государственного технического университета УГТУ <http://lib.ugtu.net/books>
  - Электронная справочная система нормативно-технической документации «Технорматив»
  - ЭКБСОН- информационная система доступа к электронным каталогам библиотек сферы образования и науки.
11. Информационный портал Правительства Российской Федерации - Правительство.рф
  12. Информационный портал Президента Российской Федерации - Президент.рф
  13. Интернет портал для управленцев <http://www.management.com.ua/?lang=rus>
  14. Экономика и менеджмент. Высокие статистические технологии <http://orlovs.pp.ru/econ.php>

9.3. Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в т.ч. отечественного производства

1. Microsoft Windows
2. Microsoft Office Professional Plus
3. Zoom (свободно-распространяемое ПО)
4. Skype (свободно-распространяемое ПО)

## 10. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Помещения для проведения всех видов работы, предусмотренных учебным планом, укомплектованы необходимым оборудованием и техническими средствами обучения.

Таблица 10.1

### Обеспеченность материально-технических условий реализации ОПОП ВО

№ п/п	Наименование учебных предметов, курсов, дисциплин (модулей), практики, иных видов учебной деятельности, предусмотренных учебным планом образовательной программы	Наименование помещений для проведения всех видов учебной деятельности, предусмотренной учебным планом, в том числе помещения для самостоятельной работы, с указанием перечня основного оборудования, учебно-наглядных пособий и используемого программного обеспечения	Адрес (местоположение) помещений для проведения всех видов учебной деятельности, предусмотренной учебным планом (в случае реализации образовательной программы в сетевой форме дополнительно указывается наименование организации, с которой заключен договор)
1	2	3	4
1	Финансовый риск-менеджмент	Лекционные занятия: Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа; групповых и индивидуальных консультаций; текущего контроля и промежуточной аттестации, Оснащенность: Учебная мебель: столы, стулья. Моноблок - 1 шт., проектор - 1 шт., проекционный экран - 1 шт., акустическая система (колонки) - 2 шт., документ - камера - 1 шт.	625039, Тюменская область, г. Тюмень, ул. Мельникайте, д.70
		Практические занятия: Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа (практические занятия); групповых и индивидуальных консультаций; текущего контроля и	625039, Тюменская область, г. Тюмень, ул. Мельникайте, д.70



		промежуточной аттестации, Учебная лаборатория. Оснащенность: Учебная мебель: столы, стулья. Моноблок - 1 шт., проектор - 1 шт., проекционный экран - 1 шт., акустическая система (колонки) - 2 шт., документ - камера - 1 шт.	
--	--	---	--

## 11. Методические указания по организации СРС

### 11.1. Методические указания по подготовке к практическим занятиям.

Одним из результатов обучения является приобретение навыков, это действия, которые вследствие многократных повторений становятся автоматическими, выполняются без видимого контроля со стороны сознания, значит, в учебном процессе должны быть условия для такой многократности. Умения и навыки обучающиеся приобретают и отрабатывают на практических занятиях.

Практические занятия - это занятия, проводимые под руководством преподавателя в учебной аудитории, направленные на углубление научно- теоретических знаний и овладение определенными методами самостоятельной работы. В процессе таких занятий вырабатываются практические умения (вычислений, расчетов, использования таблиц, справочников и др.). Аудиторные практические занятия играют исключительно важную роль в выработке у обучающихся навыков применения полученных знаний для решения практических задач в процессе совместной деятельности с преподавателями. Практические занятия призваны углубить, расширить и детализировать эти знания, содействовать выработке навыков профессиональной деятельности. Практические занятия развивают научное мышление и речь обучающихся, позволяют проверить их знания, в связи с чем, практические работы выступают важным средством достаточно оперативной обратной связи.

Перед практическим занятием обучающемуся следует изучить конспект лекции и рекомендованную преподавателем литературу, обращая внимание на практическое применение теории и на методику решения типовых задач. На практическом занятии обучающийся должен уяснить связь решаемых задач с теоретическими положениями. При решении предложенной задачи обучающийся должен стремиться не только получить правильный ответ, но и усвоить общий метод решения подобных задач.

Логическая связь лекций и практических занятий заключается в том, что информация, полученная на лекции, в процессе самостоятельной работы на практическом занятии осмысливается и перерабатывается, при помощи преподавателя анализируется до мельчайших подробностей, после чего прочно усваивается. Для успешной подготовки к практическим занятиям обучающемуся невозможно ограничиться слушанием лекций. Требуется предварительная самостоятельная работа обучающихся по теме планируемого занятия.

Основное назначение практических занятий - преобразование знаний в умения и навыки, овладение способами деятельности и на этой основе подготовка обучающихся к будущей профессиональной деятельности. Содержанием практических занятий могут быть задачи аналитического характера, разбор кейсов, либо эти занятия могут проводиться по принципу мини-заданий, в том числе групповых, где предложенные обучающимся задания могут быть ориентированы:

- на уровень узнавания, например, на выбор из нескольких понятий нужного;
- на уровень репродукции, т. е. воспроизведение полученных знаний, умений, навыков;
- на вариантно-воспроизводящий уровень (операционный) т.е. осуществление простейших операций по готовым образцам;
- на аналитико-синтетический уровень, т.е. на умение обобщать, дифференцировать знания, умения и навыки, связывать старое с новым;
- на творческий уровень, т. е. на способность переносить имеющиеся знания и умения в новую ситуацию, решать неординарные задачи.

## 11.2. Методические указания по организации самостоятельной работы.

Время, которым располагает обучающийся для выполнения учебного плана, складывается из двух составляющих: одна из них - это аудиторная работа в вузе по расписанию занятий, другая - внеаудиторная самостоятельная работа. Задания и материалы для самостоятельной работы выдаются во время учебных занятий по расписанию, на этих же занятиях преподаватель осуществляет контроль за самостоятельной работой, а также оказывает помощь обучающимся по правильной организации работы.

Самостоятельная работа обучающихся при изучении дисциплины «Методы и модели в управлении» заключается в углубленном рассмотрении отдельных вопросов курса по имеющимся научным, периодическим изданиям, статистической информации, а также с использованием интернет - ресурсов. Кроме того, в целях получения и закрепления практических навыков, а также дальнейшей проработки отдельных тем целесообразно проведение целевых аналитических работ, предполагающих проработку теоретических вопросов, практического опыта и подтверждающей статистической информации при рассмотрении вопросов управления. Подобные задания целесообразно использовать для групповой работы обучающихся под научным руководством преподавателя. Они представляют собой начальную форму самостоятельного научного исследования, результаты которого могут быть представлены в виде сообщений на текущих практических занятиях и выступать в качестве одного из элементов промежуточной аттестации по данной дисциплине. Проверка полученных в процессе обучения и самостоятельной работы знаний осуществляется при помощи вопросов для самоконтроля, а также вопросов и заданий для самостоятельного выполнения.

Самостоятельная работа обучающихся направлена на закрепление, приумножение и приращение знаний, навыков и умений преимущественно в формате профессиональных компетенций.

## Планируемые результаты обучения для формирования компетенции и критерии их оценивания

Дисциплина Финансовый риск-менеджмент

Код, специальность 21.05.01 Прикладная геодезия

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине (модулю)	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
<p>ПКСд-6 Способен выявлять, идентифицировать и прогнозировать риски с учетом отраслевой специфики; оценивать и управлять различными видами рисков на основе выбора эффективных методов воздействия</p>	<p>ПКСд-6.1 Выявляет, идентифицирует и прогнозирует риски с учетом отраслевой специфики; управляет различными видами рисков на основе выбора эффективных методов воздействия</p>	<p>Знать: 31 методы воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критерии, применяемые при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методы, техники, технологии управления финансовыми рисками; возможности инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации</p>	<p>Не знает методов воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критериев, применяемых при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методов, техники, технологий управления финансовыми рисками; возможностей инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации</p>	<p>Демонстрирует фрагментарные знания методов воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критериев, применяемых при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методов, техники, технологий управления финансовыми рисками; возможностей инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации</p>	<p>Демонстрирует достаточные знания методов воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критериев, применяемых при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методов, техники, технологий управления финансовыми рисками; возможностей инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации</p>	<p>Демонстрирует исчерпывающие знания методов воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критериев, применяемых при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методов, техники, технологий управления финансовыми рисками; возможностей инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации</p>





**КАРТА**  
**обеспеченности дисциплины учебной и учебно-методической литературой**

дисциплины: Финансовый риск-менеджмент

Код, специальность 21.05.01 Прикладная геодезия

№ п/п	Название учебного, учебно-методического издания, автор, издательство, вид издания, год издания	Количество экземпляров в БИК	Контингент обучающихся, использую	Обеспеченность обучающихся литературой, %	Наличие электронного варианта в ЭБС (+/-)
1	Слепухина, Ю. Э. Риск-менеджмент на финансовых рынках : учебное пособие / Ю. Э. Слепухина. — Екатеринбург : Уральский федеральный университет, ЭБС АСВ, 2015. — 216 с. — ISBN 978-5-7996-1522-2. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <a href="https://www.iprbookshop.ru/68289.html">https://www.iprbookshop.ru/68289.html</a>	ЭР*	30	100	+
2	Управление финансовыми рисками. Практикум : учебное пособие для вузов / И. П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И. П. Хоминич. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 129 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-13920-4. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/519556">https://urait.ru/bcode/519556</a>	ЭР*	30	100	+
3	Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 1 : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 211 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02606-1. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/512634">https://urait.ru/bcode/512634</a>	ЭР*	30	100	+
4	Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 2 : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 250 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02608-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/512635">https://urait.ru/bcode/512635</a>	ЭР*	30	100	+
5	Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 3 : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 272 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02609-2. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/512636">https://urait.ru/bcode/512636</a>	ЭР*	30	100	+

6	Латышева, Л. А. Финансовый риск-менеджмент : учебник / Л. А. Латышева, Ю. М. Складорова, И. Ю. Складоров. — Ставрополь : СтГАУ, 2021. — 376 с. — ISBN 976-5-9908446-1-2. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <a href="https://e.lanbook.com/book/245735">https://e.lanbook.com/book/245735</a>	ЭР*	30	100	+
---	--	-----	----	-----	---

ЭР\* – электронный ресурс для авторизованных пользователей доступен через Электронный каталог/Электронную библиотеку ТИУ <http://webirbis.tsogu.ru/>

**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**  
Федеральное государственное бюджетное  
образовательное учреждение высшего образования  
«ТЮМЕНСКИЙ ИНДУСТРИАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

**УТВЕРЖДАЮ**

\_\_\_\_\_ 2023 г.  
« \_\_\_\_\_ » \_\_\_\_\_

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА**

дисциплины: Финансовый риск-менеджмент

специальность: **21.05.03** Технология геологической разведки



Рабочая программа рассмотрена  
на заседании кафедры МТЭК  
Протокол № \_\_\_\_\_ от «\_\_\_» \_\_\_\_\_ 2023 г.

Заведующий кафедрой \_\_\_\_\_ В. В. Пленкина

Рабочую программу разработал:

С.В.Фролова, старший преподаватель \_\_\_\_\_

## 1. Цели и задачи освоения дисциплины

**Цель** дисциплины «Финансовый риск-менеджмент» - структуризация первоначальных знаний о системе управления рисками компании, формирование знаний у обучающихся об инструментах идентификации и классификации финансовых рисков, методиках оценки, а также получение навыков по снижению вероятности реализации рисков событий.

**Задачами** освоения дисциплины являются: знакомство обучающихся с основными понятиями менеджмента риска в сфере финансов; системой классификации и идентификации финансовых рисков; методами качественной и количественной оценки финансовых рисков; способами управления финансовыми рисками и их классификацией.

## 2. Место дисциплины в структуре ОПОП ВО

Дисциплина «Финансовый риск-менеджмент» относится к элективным дисциплинам модуля «Управление рисками».

Необходимыми условиями для освоения дисциплины являются:

знание основ управления и логики,

умения искать, систематизировать информацию,

владение навыками обобщения и анализа информации.

## 3. Результаты обучения по дисциплине

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

Таблица 3.1

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции (ИДК)	Код и наименование результата обучения по дисциплине
ПКСд-6 Способен выявлять, идентифицировать и прогнозировать риски с учетом отраслевой специфики; оценивать и управлять различными видами рисков на основе выбора эффективных методов воздействия	ПКСд-6.1 Выявляет, идентифицирует и прогнозирует риски с учетом отраслевой специфики; управляет различными видами рисков на основе выбора эффективных методов воздействия	Знать: 31 методы воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критерии, применяемые при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методы, техники, технологии управления финансовыми рисками; возможности инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации
		Уметь: У1 определять эффективные методы воздействия на финансовый риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на финансовые риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственным за риск сотрудникам в правильной оценке финансового риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления финансовыми рисками с учетом отраслевой специфики; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды финансовых рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности; формировать формы отчетности, дорожные карты для целей

		<p>реализации и мониторинга мероприятий по воздействию на финансовые риски.</p> <p>Владеть: В1 навыками осуществления качественной и количественной оценки финансовых рисков; навыками разработки стратегии элиминирования финансовых рисков (хеджирование, диверсификация, страхование); навыками использования современных методов управления финансовыми рисками нефинансовых компаний для обеспечения динамического развития их бизнеса, проведения самостоятельных исследований в области управления финансовыми рисками нефинансовых компаний в соответствии с разработанной программой; навыками разработки прогнозов развития определенной области знаний (технологий) в условиях риска и неопределенности; способностью разрабатывать (формулировать) основные стратегии управления финансовыми рисками; навыками определения качественных и количественных критериев эффективности системы управления финансовыми рисками.</p>
--	--	--

#### 4. Объем дисциплин

Общий объем дисциплины составляет 3 зачетных единиц, 108 часов.

Таблица 4.1.

Форма обучения	Курс/ семестр	Аудиторные занятия/контактная работа, час.			Самостоятельная работа, час.	Контроль, час	Форма промежуточной аттестации
		Лекции	Практические занятия	Лабораторные занятия			
очная	3/6	14	26	-	68	-	зачет
заочная	3/6	6	10	-	88	4	зачет

#### 5. Структура и содержание дисциплины

##### 5.1. Структура дисциплины.

##### очная форма обучения (ОФО)

Таблица 5.1.1

№ п/п	Структура дисциплины		Аудиторные занятия, час.			СРС, час.	Всего, час.	Код ИДК	Оценочные средства
	Номер раздела	Наименование раздела	Л.	Пр.	Лаб.				
1	1	Управление финансовыми рисками	6	10	0	22	38	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
2	2	Организация менеджмента финансовых рисков компании	4	8	0	22	34	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
3	3	Основные организационные формы снижения финансового риска	4	8	0	24	36	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
Итого:			14	26	0	68	108		

**заочная форма обучения (ЗФО)**

Таблица 5.1.2

№ п/п	Структура дисциплины		Аудиторные занятия, час.			СРС, час.	Всего, час.	Код ИДК	Оценочные средства
	Номер раздела	Наименование раздела	Л.	Пр.	Лаб.				
1	1	Управление финансовыми рисками	2	4	0	29	35	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
2	2	Организация менеджмента финансовых рисков компании	2	2	0	30	34	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
3	3	Основные организационные формы снижения финансового риска	2	4	0	29	35	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
4	Зачет		-	-	-	-	4		тестирование
Итого:			6	10	0	88	108		

**5.2. Содержание дисциплины.**

**5.2.1. Содержание разделов дисциплины (дидактические единицы).**

Раздел 1. «Управление финансовыми рисками». Активные, пассивные и адаптивные подходы к управлению финансовыми рисками. Финансовая среда предпринимательства и модели управления рисками. Стратегии управления рисками: «Управления инцидентами», «Прогнозирования», «Проактивного управления». Техники менеджмента финансового риска.

Раздел 2. «Организация менеджмента финансовых рисков компании». Функции менеджмента финансового риска. Технологические элементы процесса управления рисками. Информационное обеспечение управления риском. Документирование. Распределение и закрепление ответственности и полномочий. Мониторинг и повторная оценка риска. Планирование управления рисками. Отчет о рисках.

Раздел 3. «Основные организационные формы снижения финансового риска». Распределение риска между участниками проекта. Синдикат. Проектное финансирование. Венчурное финансирование. Андеррайтинг. Лизинг. Франчайзинг. Факторинг. Ипотека.

**5.2.2. Содержание дисциплины по видам учебных занятий.**

**Лекционные занятия**

Таблица 5.2.1

№ п/п	Номер раздела дисциплины	Объем, час.			Тема лекции
		ОФО	ЗФО	ОЗФО	
1	1	6	2	-	Управление финансовыми рисками
2	2	4	2	-	Организация менеджмента финансовых рисков компании
3	3	4	2	-	Основные организационные формы снижения финансового риска
Итого:		14	6	-	-

**Практические занятия**

Таблица 5.2.3

№ п/п	Номер раздела дисциплины	Объем, час.			Тема лекции
		ОФО	ЗФО	ОЗФО	
1	1	10	4	-	Управление финансовыми рисками

2	3	8	2	-	Организация менеджмента финансовых рисков компании
3	4	8	4	-	Основные организационные формы снижения финансового риска
Итого:		26	10	-	-

Лабораторные работы учебным планом не предусмотрены.

### Самостоятельная работа студента

Таблица 5.2.7

№ п/п	Номер раздела дисциплины	Объем, час.			Тема	Вид СРС
		ОФО	ЗФО	ОФО		
1	1	22	29	-	Управление финансовыми рисками	Решение кейса №1
3	2	22	30	-	Организация менеджмента финансовых рисков компании	Решение кейса №2
6	3	24	29	-	Основные организационные формы снижения финансового риска	Решение кейса №3
Итого:		68	88	-		

5.2.3. Преподавание дисциплины ведется с применением следующих видов образовательных технологий:

- визуализация учебного материала в PowerPoint в диалоговом режиме, дискуссия (лекционные занятия);
- работа в малых группах (практические занятия);
- разбор практических ситуаций и кейсов (практические занятия).

## 6. Тематика курсовых работ/проектов

Курсовые работы/проекты учебным планом не предусмотрены.

## 7. Контрольные работы

7.1. Методические указания для выполнения контрольных работ. Контрольная работа выполняется обучающимися **заочной формы** обучения в **6 семестре** и является допуском к промежуточной аттестации. Контрольная работа выполняется по вариантам согласно последней цифре в зачетной книжке обучающегося.

№ варианта	Перечень вопросов
Вариант 1	Понятие риска и его природа. Развитие взглядов на риски
	Особенности деятельности страхового брокера и страхового агента
Вариант 2	Классификация финансовых рисков. Основные виды финансовых рисков и их характеристика.
	Зарубежные модели оценки совокупного финансового риска
Вариант 3	Способы управления финансовыми рисками и их содержание
	Сущность и содержание актуарных расчетов
Вариант 4	Сущность и функции финансового риск-менеджмента
	Страхование прав собственности на недвижимость
Вариант 5	Нормативно-правовая основа управления финансовыми рисками и страхования
	Сравнительная характеристика сострахования и перестрахования

№ варианта	Перечень вопросов
Вариант 6	Задачи и процесс управления финансовыми рисками
	Страхование финансовых рисков (сущность и специфика, краткая характеристика видов и условий)
Вариант 7	Основные математические методы оценки финансовых рисков
	Финансовая устойчивость страховых операций (компаний) и ее показатели
Вариант 8	Диагностика, анализ и картографирование финансовых рисков
	Страхование предпринимательской деятельности (сущность и специфика, краткая характеристика видов и условий)
Вариант 9	Экспертная оценка финансовых рисков: виды, сущность и необходимость использования
	Страховой маркетинг, его функции
Вариант 0	Классификация методов выявления и оценки финансовых рисков
	Активные, пассивные и адаптивные подходы к управлению финансовыми рисками

## 8. Оценка результатов освоения дисциплины

8.1. Критерии оценивания степени полноты и качества освоения компетенций в соответствии с планируемыми результатами обучения приведены в Приложении 1.

8.2. Рейтинговая система оценивания степени полноты и качества освоения компетенций обучающихся очной формы обучения представлена в таблице 8.1.

Таблица 8.1

№ п/п	Виды мероприятий в рамках текущего контроля	Количество баллов
1 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
	<b>ИТОГО за первую текущую аттестацию</b>	<b>0-30</b>
2 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
	<b>ИТОГО за вторую текущую аттестацию</b>	<b>0-30</b>
3 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
2	Тестирование	0-10
	<b>ИТОГО за третью текущую аттестацию</b>	<b>0-40</b>
	<b>ВСЕГО</b>	<b>100</b>

8.3. Рейтинговая система оценивания степени полноты и качества освоения компетенций обучающихся заочной формы обучения представлена в таблице 8.2.

Таблица 8.2

№ п/п	Виды мероприятий в рамках текущего контроля	Количество баллов
1	Выполнение практических кейс-заданий	90
2	Итоговый контроль (тестовый)	10
	<b>ВСЕГО</b>	<b>100</b>

## 9. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

9.1. Перечень рекомендуемой литературы представлен в Приложении 2.

9.2. Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы

- Электронный каталог/Электронная библиотека ТИУ <http://webirbis.tsogu.ru/>

- Цифровой образовательный ресурс – библиотечная система IPR SMART —

<https://www.iprbookshop.ru/>

- Электронно-библиотечная система «Консультант студента» [www.studentlibrary.ru](http://www.studentlibrary.ru)

- Электронно-библиотечная система «Лань» <https://e.lanbook.com>

- Образовательная платформа ЮРАЙТ [www.uraity.ru](http://www.uraity.ru)
  - Научная электронная библиотека ELIBRARY.RU <http://www.elibrary.ru>
  - Национальная электронная библиотека (НЭБ)
  - Библиотеки нефтяных вузов России :
  - Электронная нефтегазовая библиотека РГУ нефти и газа им. Губкина <http://elib.gubkin.ru/>,
  - Электронная библиотека Уфимского государственного нефтяного технического университета <http://bibl.rusoil.net/> ,
  - Библиотечно-информационный комплекс Ухтинского государственного технического университета УГТУ <http://lib.ugtu.net/books>
  - Электронная справочная система нормативно-технической документации «Технорматив»
  - ЭКБСОН- информационная система доступа к электронным каталогам библиотек сферы образования и науки.
11. Информационный портал Правительства Российской Федерации - Правительство.рф
  12. Информационный портал Президента Российской Федерации - Президент.рф
  13. Интернет портал для управленцев <http://www.management.com.ua/?lang=rus>
  14. Экономика и менеджмент. Высокие статистические технологии <http://orlovs.pp.ru/econ.php>

9.3. Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в т.ч. отечественного производства

1. Microsoft Windows
2. Microsoft Office Professional Plus
3. Zoom (свободно-распространяемое ПО)
4. Skype (свободно-распространяемое ПО)

## 10. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Помещения для проведения всех видов работы, предусмотренных учебным планом, укомплектованы необходимым оборудованием и техническими средствами обучения.

Таблица 10.1

### Обеспеченность материально-технических условий реализации ОПОП ВО

№ п/п	Наименование учебных предметов, курсов, дисциплин (модулей), практики, иных видов учебной деятельности, предусмотренных учебным планом образовательной программы	Наименование помещений для проведения всех видов учебной деятельности, предусмотренной учебным планом, в том числе помещения для самостоятельной работы, с указанием перечня основного оборудования, учебно-наглядных пособий и используемого программного обеспечения	Адрес (местоположение) помещений для проведения всех видов учебной деятельности, предусмотренной учебным планом (в случае реализации образовательной программы в сетевой форме дополнительно указывается наименование организации, с которой заключен договор)
1	2	3	4
1	Финансовый риск-менеджмент	<p>Лекционные занятия: Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа; групповых и индивидуальных консультаций; текущего контроля и промежуточной аттестации, Оснащенность: Учебная мебель: столы, стулья. Моноблок - 1 шт., проектор - 1 шт., проекционный экран - 1 шт., акустическая система (колонки) - 2 шт., документ - камера - 1 шт.</p> <p>Практические занятия: Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа (практические занятия); групповых и индивидуальных консультаций; текущего контроля и</p>	<p>625039, Тюменская область, г. Тюмень, ул. Мельникайте, д.70</p> <p>625039, Тюменская область, г. Тюмень, ул. Мельникайте, д.70</p>

		промежуточной аттестации, Учебная лаборатория. Оснащенность: Учебная мебель: столы, стулья. Моноблок - 1 шт., проектор - 1 шт., проекционный экран - 1 шт., акустическая система (колонки) - 2 шт., документ - камера - 1 шт.	
--	--	---	--

## 11. Методические указания по организации СРС

### 11.1. Методические указания по подготовке к практическим занятиям.

Одним из результатов обучения является приобретение навыков, это действия, которые вследствие многократных повторений становятся автоматическими, выполняются без видимого контроля со стороны сознания, значит, в учебном процессе должны быть условия для такой многократности. Умения и навыки обучающиеся приобретают и отрабатывают на практических занятиях.

Практические занятия - это занятия, проводимые под руководством преподавателя в учебной аудитории, направленные на углубление научно- теоретических знаний и овладение определенными методами самостоятельной работы. В процессе таких занятий вырабатываются практические умения (вычислений, расчетов, использования таблиц, справочников и др.). Аудиторные практические занятия играют исключительно важную роль в выработке у обучающихся навыков применения полученных знаний для решения практических задач в процессе совместной деятельности с преподавателями. Практические занятия призваны углубить, расширить и детализировать эти знания, содействовать выработке навыков профессиональной деятельности. Практические занятия развивают научное мышление и речь обучающихся, позволяют проверить их знания, в связи с чем, практические работы выступают важным средством достаточно оперативной обратной связи.

Перед практическим занятием обучающемуся следует изучить конспект лекции и рекомендованную преподавателем литературу, обращая внимание на практическое применение теории и на методику решения типовых задач. На практическом занятии обучающийся должен уяснить связь решаемых задач с теоретическими положениями. При решении предложенной задачи обучающийся должен стремиться не только получить правильный ответ, но и усвоить общий метод решения подобных задач.

Логическая связь лекций и практических занятий заключается в том, что информация, полученная на лекции, в процессе самостоятельной работы на практическом занятии осмысливается и перерабатывается, при помощи преподавателя анализируется до мельчайших подробностей, после чего прочно усваивается. Для успешной подготовки к практическим занятиям обучающемуся невозможно ограничиться слушанием лекций. Требуется предварительная самостоятельная работа обучающихся по теме планируемого занятия.

Основное назначение практических занятий - преобразование знаний в умения и навыки, овладение способами деятельности и на этой основе подготовка обучающихся к будущей профессиональной деятельности. Содержанием практических занятий могут быть задачи аналитического характера, разбор кейсов, либо эти занятия могут проводиться по принципу мини-заданий, в том числе групповых, где предложенные обучающимся задания могут быть ориентированы:

- на уровень узнавания, например, на выбор из нескольких понятий нужного;
- на уровень репродукции, т. е. воспроизведение полученных знаний, умений, навыков;
- на вариантно-воспроизводящий уровень (операционный) т.е. осуществление простейших операций по готовым образцам;
- на аналитико-синтетический уровень, т.е. на умение обобщать, дифференцировать знания, умения и навыки, связывать старое с новым;
- на творческий уровень, т. е. на способность переносить имеющиеся знания и умения в новую ситуацию, решать неординарные задачи.



## 11.2. Методические указания по организации самостоятельной работы.

Время, которым располагает обучающийся для выполнения учебного плана, складывается из двух составляющих: одна из них - это аудиторная работа в вузе по расписанию занятий, другая - внеаудиторная самостоятельная работа. Задания и материалы для самостоятельной работы выдаются во время учебных занятий по расписанию, на этих же занятиях преподаватель осуществляет контроль за самостоятельной работой, а также оказывает помощь обучающимся по правильной организации работы.

Самостоятельная работа обучающихся при изучении дисциплины «Методы и модели в управлении» заключается в углубленном рассмотрении отдельных вопросов курса по имеющимся научным, периодическим изданиям, статистической информации, а также с использованием интернет - ресурсов. Кроме того, в целях получения и закрепления практических навыков, а также дальнейшей проработки отдельных тем целесообразно проведение целевых аналитических работ, предполагающих проработку теоретических вопросов, практического опыта и подтверждающей статистической информации при рассмотрении вопросов управления. Подобные задания целесообразно использовать для групповой работы обучающихся под научным руководством преподавателя. Они представляют собой начальную форму самостоятельного научного исследования, результаты которого могут быть представлены в виде сообщений на текущих практических занятиях и выступать в качестве одного из элементов промежуточной аттестации по данной дисциплине. Проверка полученных в процессе обучения и самостоятельной работы знаний осуществляется при помощи вопросов для самоконтроля, а также вопросов и заданий для самостоятельного выполнения.

Самостоятельная работа обучающихся направлена на закрепление, приумножение и приращение знаний, навыков и умений преимущественно в формате профессиональных компетенций.

## Планируемые результаты обучения для формирования компетенции и критерии их оценивания

Дисциплина Финансовый риск-менеджмент

Код, специальность 21.05.03 Технология геологической разведки

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине (модулю)	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
<p>ПКСд-6 Способен выявлять, идентифицировать и прогнозировать риски с учетом отраслевой специфики; оценивать и управлять различными видами рисков на основе выбора эффективных методов воздействия</p>	<p>ПКСд-6.1 Выявляет, идентифицирует и прогнозирует риски с учетом отраслевой специфики; управляет различными видами рисков на основе выбора эффективных методов воздействия</p>	<p>Знать: 31 методы воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критерии, применяемые при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методы, техники, технологий управления финансовыми рисками; возможности инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации</p>	<p>Не знает методов воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критериев, применяемых при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методов, техники, технологий управления финансовыми рисками; возможностей инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации</p>	<p>Демонстрирует фрагментарные знания методов воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критериев, применяемых при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методов, техники, технологий управления финансовыми рисками; возможностей инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации</p>	<p>Демонстрирует достаточные знания методов воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критериев, применяемых при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методов, техники, технологий управления финансовыми рисками; возможностей инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации</p>	<p>Демонстрирует исчерпывающие знания методов воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критериев, применяемых при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методов, техники, технологий управления финансовыми рисками; возможностей инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации</p>

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине (модулю)	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
		<p>Уметь: У1 определять эффективные методы воздействия на финансовый риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на финансовые риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственному за риск сотрудникам в правильной оценке финансового риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления финансовыми рисками с учетом отраслевой специфики; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды финансовых рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности; формировать формы отчетности, дорожные карты для целей реализации и мониторинга мероприятий по воздействию на финансовые</p>	<p>Не умеет определять эффективные методы воздействия на финансовый риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на финансовые риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственному за риск сотрудникам в правильной оценке финансового риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления финансовыми рисками с учетом отраслевой специфики; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды финансовых рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности; формировать формы отчетности, дорожные карты для целей реализации и мониторинга мероприятий по воздействию на финансовые риски.</p>	<p>Фрагментарно умеет определять эффективные методы воздействия на финансовый риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на финансовые риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственному за риск сотрудникам в правильной оценке финансового риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления финансовыми рисками с учетом отраслевой специфики; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды финансовых рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности; формировать формы отчетности</p>	<p>Умеет определять эффективные методы воздействия на финансовый риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на финансовые риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственному за риск сотрудникам в правильной оценке финансового риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления финансовыми рисками с учетом отраслевой специфики; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды финансовых рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности; формировать формы отчетности, дорожные карты</p>	<p>Умеет уверенно и достоверно определять эффективные методы воздействия на финансовый риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на финансовые риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственному за риск сотрудникам в правильной оценке финансового риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления финансовыми рисками с учетом отраслевой специфики; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды финансовых рисков и эффективно применять их с</p>

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине (модулю)	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
		<p>Владеть: В1 навыками осуществления качественной и количественной оценки финансовых рисков; навыками разработки стратегии элиминирования финансовых рисков (хеджирование, диверсификация, страхование); навыками использования современных методов управления финансовыми рисками нефинансовых компаний для обеспечения динамического развития их бизнеса, проведения самостоятельных исследований в области управления финансовыми рисками нефинансовых компаний (хеджирование, диверсификация, страхование); навыками использования современных методов управления финансовыми рисками нефинансовых компаний для обеспечения динамического развития их бизнеса, проведения самостоятельных исследований в области управления финансовыми рисками нефинансовых компаний в соответствии с разработанной программой; навыками разработки прогнозов развития определенной области знаний (технологий) в условиях риска и неопределенности; способностью разрабатывать (формулировать) основные стратегии управления финансовыми рисками; навыками определения качественных и количественных критериев эффективности системы управления</p>	<p>Не владеет навыками осуществления качественной и количественной оценки финансовых рисков; навыками разработки стратегии элиминирования финансовых рисков (хеджирование, диверсификация, страхование); навыками использования современных методов управления финансовыми рисками нефинансовых компаний для обеспечения динамического развития их бизнеса, проведения самостоятельных исследований в области управления финансовыми рисками нефинансовых компаний в соответствии с разработанной программой; навыками разработки прогнозов развития определенной области знаний (технологий) в условиях риска и неопределенности; способностью разрабатывать (формулировать) основные стратегии управления</p>	<p>Пытается применить навыки осуществления качественной и количественной оценки финансовых рисков; навыки разработки стратегии элиминирования финансовых рисков (хеджирование, диверсификация, страхование); навыки использования современных методов управления финансовыми рисками нефинансовых компаний для обеспечения динамического развития их бизнеса, проведения самостоятельных исследований в области управления финансовыми рисками нефинансовых компаний для обеспечения динамического развития их бизнеса, проведения самостоятельных исследований в области управления финансовыми рисками нефинансовых компаний в соответствии с разработанной программой; навыки разработки прогнозов развития определенной области знаний (технологий) в условиях риска и неопределенности; способностью разрабатывать (формулировать)</p>	<p>Владеет навыками осуществления качественной и количественной оценки финансовых рисков; навыками разработки стратегии элиминирования финансовых рисков (хеджирование, диверсификация, страхование); навыками использования современных методов управления финансовыми рисками нефинансовых компаний для обеспечения динамического развития их бизнеса, проведения самостоятельных исследований в области управления финансовыми рисками нефинансовых компаний в соответствии с разработанной программой; навыками разработки прогнозов развития определенной области знаний (технологий) в условиях риска и неопределенности; способностью разрабатывать (формулировать)</p>	<p>Отлично владеет навыками осуществления качественной и количественной оценки финансовых рисков; навыками разработки стратегии элиминирования финансовых рисков (хеджирование, диверсификация, страхование); навыками использования современных методов управления финансовыми рисками нефинансовых компаний для обеспечения динамического развития их бизнеса, проведения самостоятельных исследований в области управления финансовыми рисками нефинансовых компаний в соответствии с разработанной программой; навыками разработки прогнозов развития определенной</p>



**КАРТА**  
**обеспеченности дисциплины учебной и учебно-методической литературой**

дисциплины: Финансовый риск-менеджмент

Код, специальность 21.05.03 Технология геологической разведки

№ п/п	Название учебного, учебно-методического издания, автор, издательство, вид издания, год издания	Количество экземпляров в БИК	Контингент обучающихся, использую	Обеспеченность обучающихся литературой, %	Наличие электронного варианта в ЭБС (+/-)
1	Слепухина, Ю. Э. Риск-менеджмент на финансовых рынках : учебное пособие / Ю. Э. Слепухина. — Екатеринбург : Уральский федеральный университет, ЭБС АСВ, 2015. — 216 с. — ISBN 978-5-7996-1522-2. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <a href="https://www.iprbookshop.ru/68289.html">https://www.iprbookshop.ru/68289.html</a>	ЭР*	30	100	+
2	Управление финансовыми рисками. Практикум : учебное пособие для вузов / И. П. Хоминич [и др.]; под редакцией И. П. Хоминич. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 129 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-13920-4. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/519556">https://urait.ru/bcode/519556</a>	ЭР*	30	100	+
3	Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 1 : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 211 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02606-1. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/512634">https://urait.ru/bcode/512634</a>	ЭР*	30	100	+
4	Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 2 : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 250 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02608-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/512635">https://urait.ru/bcode/512635</a>	ЭР*	30	100	+

5	Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 3 : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 272 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02609-2. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/512636">https://urait.ru/bcode/512636</a>	ЭР*	30	100	+
6	Латышева, Л. А. Финансовый риск-менеджмент : учебник / Л. А. Латышева, Ю. М. Склярова, И. Ю. Скляров. — Ставрополь : СтГАУ, 2021. — 376 с. — ISBN 976-5-9908446-1-2. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <a href="https://e.lanbook.com/book/245735">https://e.lanbook.com/book/245735</a>	ЭР*	30	100	+

ЭР\* – электронный ресурс для авторизованных пользователей для доступен через Электронный каталог/Электронную библиотеку ТИУ <http://webirbis.tsogu.ru/>

# Лист согласования

Внутренний документ "Финансовый риск-менеджмент\_2023\_ТИУ\_Майнер"

Документ подготовил: Фролова Светлана Владимировна

Должность	ФИО	ИО	Результат
Доцент, имеющий ученую степень кандидата наук и ученое звание доцент (высший уровень)	Салько Мирослава Геннадьевна		Согласовано
Старший преподаватель, не имеющий ученой степени (высший уровень)	Фролова Светлана Владимировна		Согласовано
Директор	Медведев Андрей Витальевич		Согласовано
Начальник отдела	Шлык Константин Юрьевич		Согласовано
Специалист 1 категории	Руммо Екатерина Леонидовна		Согласовано
Директор	Каюкова Дарья Хрисановна		Согласовано



**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**  
Федеральное государственное бюджетное  
образовательное учреждение высшего образования  
«ТЮМЕНСКИЙ ИНДУСТРИАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

**УТВЕРЖДАЮ**

\_\_\_\_\_ 2023 г.  
« \_\_\_\_\_ » \_\_\_\_\_

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА**

дисциплины: Финансовый риск-менеджмент

специальность: **21.05.04 Горное дело**

**21.05.06 Нефтегазовая техника и технологии**

**23.05.01 Наземные транспортно-технологические средства**

Рабочая программа рассмотрена  
на заседании кафедры МТЭК  
Протокол № \_\_\_\_\_ от «\_\_\_» \_\_\_\_\_ 2023 г.

Заведующий кафедрой \_\_\_\_\_ В. В. Пленкина

Рабочую программу разработал:

С.В.Фролова, старший преподаватель \_\_\_\_\_

## 1. Цели и задачи освоения дисциплины

**Цель** дисциплины «Финансовый риск-менеджмент» - структуризация первоначальных знаний о системе управления рисками компании, формирование знаний у обучающихся об инструментах идентификации и классификации финансовых рисков, методиках оценки, а также получение навыков по снижению вероятности реализации рисков событий.

**Задачами** освоения дисциплины являются: знакомство обучающихся с основными понятиями менеджмента риска в сфере финансов; системой классификации и идентификации финансовых рисков; методами качественной и количественной оценки финансовых рисков; способами управления финансовыми рисками и их классификацией.

## 2. Место дисциплины в структуре ОПОП ВО

Дисциплина «Финансовый риск-менеджмент» относится к элективным дисциплинам модуля «Управление рисками».

Необходимыми условиями для освоения дисциплины являются:

знание основ управления и логики,

умения искать, систематизировать информацию,

владение навыками обобщения и анализа информации.

## 3. Результаты обучения по дисциплине

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

Таблица 3.1

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции (ИДК)	Код и наименование результата обучения по дисциплине
ПКСд-6 Способен выявлять, идентифицировать и прогнозировать риски с учетом отраслевой специфики; оценивать и управлять различными видами рисков на основе выбора эффективных методов воздействия	ПКСд-6.1 Выявляет, идентифицирует и прогнозирует риски с учетом отраслевой специфики; управляет различными видами рисков на основе выбора эффективных методов воздействия	Знать: 31 методы воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критерии, применяемые при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методы, техники, технологии управления финансовыми рисками; возможности инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации
		Уметь: У1 определять эффективные методы воздействия на финансовый риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на финансовые риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственным за риск сотрудникам в правильной оценке финансового риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления финансовыми рисками с учетом отраслевой специфики; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды финансовых рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности; формировать формы отчетности, дорожные карты для целей

		реализации и мониторинга мероприятий по воздействию на финансовые риски.
		Владеть: В1 навыками осуществления качественной и количественной оценки финансовых рисков; навыками разработки стратегии элиминирования финансовых рисков (хеджирование, диверсификация, страхование); навыками использования современных методов управления финансовыми рисками нефинансовых компаний для обеспечения динамического развития их бизнеса, проведения самостоятельных исследований в области управления финансовыми рисками нефинансовых компаний в соответствии с разработанной программой; навыками разработки прогнозов развития определенной области знаний (технологий) в условиях риска и неопределенности; способностью разрабатывать (формулировать) основные стратегии управления финансовыми рисками; навыками определения качественных и количественных критериев эффективности системы управления финансовыми рисками.

#### 4. Объем дисциплин

Общий объем дисциплины составляет 3 зачетных единиц, 108 часов.

Таблица 4.1.

Форма обучения	Курс/ семестр	Аудиторные занятия/контактная работа, час.			Самостоятельная работа, час.	Контроль, час	Форма промежуточной аттестации
		Лекции	Практические занятия	Лабораторные занятия			
очная	3/6	16	32	-	60	-	зачет
заочная	3/6	6	10	-	88	4	зачет

#### 5. Структура и содержание дисциплины

##### 5.1. Структура дисциплины.

##### очная форма обучения (ОФО)

Таблица 5.1.1

№ п/п	Структура дисциплины		Аудиторные занятия, час.			СРС, час.	Всего, час.	Код ИДК	Оценочные средства
	Номер раздела	Наименование раздела	Л.	Пр.	Лаб.				
1	1	Управление финансовыми рисками	6	12	0	20	38	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
2	2	Организация менеджмента финансовых рисков компании	6	10	0	20	36	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
3	3	Основные организационные формы снижения финансового риска	4	10	0	20	34	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
Итого:			16	32	0	60	108		

**заочная форма обучения (ОФО)**

Таблица 5.1.2

№ п/п	Структура дисциплины		Аудиторные занятия, час.			СРС, час.	Всего, час.	Код ИДК	Оценочные средства
	Номер раздела	Наименование раздела	Л.	Пр.	Лаб.				
1	1	Управление финансовыми рисками	2	4	0	29	35	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
2	2	Организация менеджмента финансовых рисков компании	2	2	0	30	34	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
3	3	Основные организационные формы снижения финансового риска	2	4	0	29	35	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
4	Зачет		-	-	-	-	4		тестирование
Итого:			6	10	0	88	108		

**5.2. Содержание дисциплины.**

**5.2.1. Содержание разделов дисциплины (дидактические единицы).**

Раздел 1. «Управление финансовыми рисками». Активные, пассивные и адаптивные подходы к управлению финансовыми рисками. Финансовая среда предпринимательства и модели управления рисками. Стратегии управления рисками: «Управления инцидентами», «Прогнозирования», «Проактивного управления». Техники менеджмента финансового риска.

Раздел 2. «Организация менеджмента финансовых рисков компании». Функции менеджмента финансового риска. Технологические элементы процесса управления рисками. Информационное обеспечение управления риском. Документирование. Распределение и закрепление ответственности и полномочий. Мониторинг и повторная оценка риска. Планирование управления рисками. Отчет о рисках.

Раздел 3. «Основные организационные формы снижения финансового риска». Распределение риска между участниками проекта. Синдикат. Проектное финансирование. Венчурное финансирование. Андеррайтинг. Лизинг. Франчайзинг. Факторинг. Ипотека.

**5.2.2. Содержание дисциплины по видам учебных занятий.**

**Лекционные занятия**

Таблица 5.2.1

№ п/п	Номер раздела дисциплины	Объем, час.			Тема лекции
		ОФО	ЗФО	ОЗФО	
1	1	6	2	-	Управление финансовыми рисками
2	2	6	2	-	Организация менеджмента финансовых рисков компании
3	3	4	2	-	Основные организационные формы снижения финансового риска
Итого:		16	6	-	-

**Практические занятия**

Таблица 5.2.3

№ п/п	Номер раздела дисциплины	Объем, час.			Тема лекции
		ОФО	ЗФО	ОЗФО	
1	1	12	4	-	Управление финансовыми рисками

2	3	10	2	-	Организация менеджмента финансовых рисков компании
3	4	10	4	-	Основные организационные формы снижения финансового риска
Итого:		32	10	-	-

Лабораторные работы учебным планом не предусмотрены.

### Самостоятельная работа студента

Таблица 5.2.7

№ п/п	Номер раздела дисциплины	Объем, час.			Тема	Вид СРС
		ОФО	ЗФО	ОФО		
1	1	20	29	-	Управление финансовыми рисками	Решение кейса №1
3	2	20	30	-	Организация менеджмента финансовых рисков компании	Решение кейса №2
6	3	20	29	-	Основные организационные формы снижения финансового риска	Решение кейса №3
Итого:		60	88	-		

5.2.3. Преподавание дисциплины ведется с применением следующих видов образовательных технологий:

- визуализация учебного материала в PowerPoint в диалоговом режиме, дискуссия (лекционные занятия);
- работа в малых группах (практические занятия);
- разбор практических ситуаций и кейсов (практические занятия).

## 6. Тематика курсовых работ/проектов

Курсовые работы/проекты учебным планом не предусмотрены.

## 7. Контрольные работы

7.1. Методические указания для выполнения контрольных работ. Контрольная работа выполняется обучающимися **заочной формы** обучения в **6 семестре** и является допуском к промежуточной аттестации. Контрольная работа выполняется по вариантам согласно последней цифре в зачетной книжке обучающегося.

№ варианта	Перечень вопросов
Вариант 1	Понятие риска и его природа. Развитие взглядов на риски
	Особенности деятельности страхового брокера и страхового агента
Вариант 2	Классификация финансовых рисков. Основные виды финансовых рисков и их характеристика.
	Зарубежные модели оценки совокупного финансового риска
Вариант 3	Способы управления финансовыми рисками и их содержание
	Сущность и содержание актуарных расчетов
Вариант 4	Сущность и функции финансового риск-менеджмента
	Страхование прав собственности на недвижимость
Вариант 5	Нормативно-правовая основа управления финансовыми рисками и страхования
	Сравнительная характеристика сострахования и перестрахования

№ варианта	Перечень вопросов
Вариант 6	Задачи и процесс управления финансовыми рисками
	Страхование финансовых рисков (сущность и специфика, краткая характеристика видов и условий)
Вариант 7	Основные математические методы оценки финансовых рисков
	Финансовая устойчивость страховых операций (компаний) и ее показатели
Вариант 8	Диагностика, анализ и картографирование финансовых рисков
	Страхование предпринимательской деятельности (сущность и специфика, краткая характеристика видов и условий)
Вариант 9	Экспертная оценка финансовых рисков: виды, сущность и необходимость использования
	Страховой маркетинг, его функции
Вариант 0	Классификация методов выявления и оценки финансовых рисков
	Активные, пассивные и адаптивные подходы к управлению финансовыми рисками

## 8. Оценка результатов освоения дисциплины

8.1. Критерии оценивания степени полноты и качества освоения компетенций в соответствии с планируемыми результатами обучения приведены в Приложении 1.

8.2. Рейтинговая система оценивания степени полноты и качества освоения компетенций обучающихся очной формы обучения представлена в таблице 8.1.

Таблица 8.1

№ п/п	Виды мероприятий в рамках текущего контроля	Количество баллов
1 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
	<b>ИТОГО за первую текущую аттестацию</b>	<b>0-30</b>
2 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
	<b>ИТОГО за вторую текущую аттестацию</b>	<b>0-30</b>
3 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
2	Тестирование	0-10
	<b>ИТОГО за третью текущую аттестацию</b>	<b>0-40</b>
	<b>ВСЕГО</b>	<b>100</b>

8.3. Рейтинговая система оценивания степени полноты и качества освоения компетенций обучающихся заочной формы обучения представлена в таблице 8.2.

Таблица 8.2

№ п/п	Виды мероприятий в рамках текущего контроля	Количество баллов
1	Выполнение практических кейс-заданий	90
2	Итоговый контроль (тестовый)	10
	<b>ВСЕГО</b>	<b>100</b>

## 9. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

9.1. Перечень рекомендуемой литературы представлен в Приложении 2.

9.2. Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы

- Электронный каталог/Электронная библиотека ТИУ <http://webirbis.tsogu.ru/>

- Цифровой образовательный ресурс – библиотечная система IPR SMART —

<https://www.iprbookshop.ru/>

- Электронно-библиотечная система «Консультант студента» [www.studentlibrary.ru](http://www.studentlibrary.ru)

- Электронно-библиотечная система «Лань» <https://e.lanbook.com>

- Образовательная платформа ЮРАЙТ [www.urait.ru](http://www.urait.ru)
  - Научная электронная библиотека ELIBRARY.RU <http://www.elibrary.ru>
  - Национальная электронная библиотека (НЭБ)
  - Библиотеки нефтяных вузов России :
  - Электронная нефтегазовая библиотека РГУ нефти и газа им. Губкина <http://elib.gubkin.ru/>,
  - Электронная библиотека Уфимского государственного нефтяного технического университета <http://bibl.rusoil.net/> ,
  - Библиотечно-информационный комплекс Ухтинского государственного технического университета УГТУ <http://lib.ugtu.net/books>
  - Электронная справочная система нормативно-технической документации «Технорматив»
  - ЭКБСОН- информационная система доступа к электронным каталогам библиотек сферы образования и науки.
11. Информационный портал Правительства Российской Федерации - Правительство.рф
  12. Информационный портал Президента Российской Федерации - Президент.рф
  13. Интернет портал для управленцев <http://www.management.com.ua/?lang=rus>
  14. Экономика и менеджмент. Высокие статистические технологии <http://orlovs.pp.ru/econ.php>

9.3. Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в т.ч. отечественного производства

1. Microsoft Windows
2. Microsoft Office Professional Plus
3. Zoom (свободно-распространяемое ПО)
4. Skype (свободно-распространяемое ПО)

## 10. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Помещения для проведения всех видов работы, предусмотренных учебным планом, укомплектованы необходимым оборудованием и техническими средствами обучения.

Таблица 10.1

### Обеспеченность материально-технических условий реализации ОПОП ВО

№ п/п	Наименование учебных предметов, курсов, дисциплин (модулей), практики, иных видов учебной деятельности, предусмотренных учебным планом образовательной программы	Наименование помещений для проведения всех видов учебной деятельности, предусмотренной учебным планом, в том числе помещения для самостоятельной работы, с указанием перечня основного оборудования, учебно-наглядных пособий и используемого программного обеспечения	Адрес (местоположение) помещений для проведения всех видов учебной деятельности, предусмотренной учебным планом (в случае реализации образовательной программы в сетевой форме дополнительно указывается наименование организации, с которой заключен договор)
1	2	3	4
1	Финансовый риск-менеджмент	Лекционные занятия: Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа; групповых и индивидуальных консультаций; текущего контроля и промежуточной аттестации, Оснащенность: Учебная мебель: столы, стулья. Моноблок - 1 шт., проектор - 1 шт., проекционный экран - 1 шт., акустическая система (колонки) - 2 шт., документ - камера - 1 шт.	625039, Тюменская область, г. Тюмень, ул. Мельникайте, д.70
		Практические занятия: Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа (практические занятия); групповых и индивидуальных консультаций; текущего контроля и	625039, Тюменская область, г. Тюмень, ул. Мельникайте, д.70



		промежуточной аттестации, Учебная лаборатория. Оснащенность: Учебная мебель: столы, стулья. Моноблок - 1 шт., проектор - 1 шт., проекционный экран - 1 шт., акустическая система (колонки) - 2 шт., документ - камера - 1 шт.	
--	--	---	--

## 11. Методические указания по организации СРС

### 11.1. Методические указания по подготовке к практическим занятиям.

Одним из результатов обучения является приобретение навыков, это действия, которые вследствие многократных повторений становятся автоматическими, выполняются без видимого контроля со стороны сознания, значит, в учебном процессе должны быть условия для такой многократности. Умения и навыки обучающиеся приобретают и отрабатывают на практических занятиях.

Практические занятия - это занятия, проводимые под руководством преподавателя в учебной аудитории, направленные на углубление научно- теоретических знаний и овладение определенными методами самостоятельной работы. В процессе таких занятий вырабатываются практические умения (вычислений, расчетов, использования таблиц, справочников и др.). Аудиторные практические занятия играют исключительно важную роль в выработке у обучающихся навыков применения полученных знаний для решения практических задач в процессе совместной деятельности с преподавателями. Практические занятия призваны углубить, расширить и детализировать эти знания, содействовать выработке навыков профессиональной деятельности. Практические занятия развивают научное мышление и речь обучающихся, позволяют проверить их знания, в связи с чем, практические работы выступают важным средством достаточно оперативной обратной связи.

Перед практическим занятием обучающемуся следует изучить конспект лекции и рекомендованную преподавателем литературу, обращая внимание на практическое применение теории и на методику решения типовых задач. На практическом занятии обучающийся должен уяснить связь решаемых задач с теоретическими положениями. При решении предложенной задачи обучающийся должен стремиться не только получить правильный ответ, но и усвоить общий метод решения подобных задач.

Логическая связь лекций и практических занятий заключается в том, что информация, полученная на лекции, в процессе самостоятельной работы на практическом занятии осмысливается и перерабатывается, при помощи преподавателя анализируется до мельчайших подробностей, после чего прочно усваивается. Для успешной подготовки к практическим занятиям обучающемуся невозможно ограничиться слушанием лекций. Требуется предварительная самостоятельная работа обучающихся по теме планируемого занятия.

Основное назначение практических занятий - преобразование знаний в умения и навыки, овладение способами деятельности и на этой основе подготовка обучающихся к будущей профессиональной деятельности. Содержанием практических занятий могут быть задачи аналитического характера, разбор кейсов, либо эти занятия могут проводиться по принципу мини-заданий, в том числе групповых, где предложенные обучающимся задания могут быть ориентированы:

- на уровень узнавания, например, на выбор из нескольких понятий нужного;
- на уровень репродукции, т. е. воспроизведение полученных знаний, умений, навыков;
- на вариантно-воспроизводящий уровень (операционный) т.е. осуществление простейших операций по готовым образцам;
- на аналитико-синтетический уровень, т.е. на умение обобщать, дифференцировать знания, умения и навыки, связывать старое с новым;
- на творческий уровень, т. е. на способность переносить имеющиеся знания и умения в новую ситуацию, решать неординарные задачи.

## 11.2. Методические указания по организации самостоятельной работы.

Время, которым располагает обучающийся для выполнения учебного плана, складывается из двух составляющих: одна из них - это аудиторная работа в вузе по расписанию занятий, другая - внеаудиторная самостоятельная работа. Задания и материалы для самостоятельной работы выдаются во время учебных занятий по расписанию, на этих же занятиях преподаватель осуществляет контроль за самостоятельной работой, а также оказывает помощь обучающимся по правильной организации работы.

Самостоятельная работа обучающихся при изучении дисциплины «Методы и модели в управлении» заключается в углубленном рассмотрении отдельных вопросов курса по имеющимся научным, периодическим изданиям, статистической информации, а также с использованием интернет - ресурсов. Кроме того, в целях получения и закрепления практических навыков, а также дальнейшей проработки отдельных тем целесообразно проведение целевых аналитических работ, предполагающих проработку теоретических вопросов, практического опыта и подтверждающей статистической информации при рассмотрении вопросов управления. Подобные задания целесообразно использовать для групповой работы обучающихся под научным руководством преподавателя. Они представляют собой начальную форму самостоятельного научного исследования, результаты которого могут быть представлены в виде сообщений на текущих практических занятиях и выступать в качестве одного из элементов промежуточной аттестации по данной дисциплине. Проверка полученных в процессе обучения и самостоятельной работы знаний осуществляется при помощи вопросов для самоконтроля, а также вопросов и заданий для самостоятельного выполнения.

Самостоятельная работа обучающихся направлена на закрепление, приумножение и приращение знаний, навыков и умений преимущественно в формате профессиональных компетенций.

## Планируемые результаты обучения для формирования компетенции и критерии их оценивания

Дисциплина Финансовый риск-менеджмент

Код, специальность 21.05.04 Горное дело; 21.05.06 Нефтегазовая техника и технологии; 23.05.01 Наземные транспортно-технологические средства

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине (модулю)	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
<p>ПКСд-6 Способен выявлять, идентифицировать и прогнозировать риски с учетом отраслевой специфики; оценивать и управлять различными видами рисков на основе выбора эффективных методов воздействия</p>	<p>ПКСд-6.1 Выявляет, идентифицирует и прогнозирует риски с учетом отраслевой специфики; управляет различными видами рисков на основе выбора эффективных методов воздействия</p>	<p>Знать: 31 методы воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критерии, применяемые при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методы, техники, технологии управления финансовыми рисками; возможности инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации</p>	<p>Не знает методов воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критериев, применяемых при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методов, техники, технологий управления финансовыми рисками; возможностей инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации</p>	<p>Демонстрирует фрагментарные знания методов воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критериев, применяемых при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методов, техники, технологий управления финансовыми рисками; возможностей инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации</p>	<p>Демонстрирует достаточные знания методов воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критериев, применяемых при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методов, техники, технологий управления финансовыми рисками; возможностей инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации</p>	<p>Демонстрирует исчерпывающие знания методов воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критериев, применяемых при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методов, техники, технологий управления финансовыми рисками; возможностей инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации</p>

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине (модулю)	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
		<p>Уметь: У1 определять эффективные методы воздействия на финансовый риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на финансовые риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственному за риск сотрудникам в правильной оценке финансового риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления финансовыми рисками с учетом отраслевой специфики; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды финансовых рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности; формировать формы отчетности, дорожные карты для целей реализации и мониторинга мероприятий по воздействию на финансовые</p>	<p>Не умеет определять эффективные методы воздействия на финансовый риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на финансовые риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственному за риск сотрудникам в правильной оценке финансового риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления финансовыми рисками с учетом отраслевой специфики; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды финансовых рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности; формировать формы отчетности, дорожные карты для целей реализации и мониторинга мероприятий по воздействию на финансовые риски.</p>	<p>Фрагментарно умеет определять эффективные методы воздействия на финансовый риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на финансовые риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственному за риск сотрудникам в правильной оценке финансового риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления финансовыми рисками с учетом отраслевой специфики; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды финансовых рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности; формировать формы отчетности</p>	<p>Умеет определять эффективные методы воздействия на финансовый риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на финансовые риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственному за риск сотрудникам в правильной оценке финансового риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления финансовыми рисками с учетом отраслевой специфики; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды финансовых рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности; формировать формы отчетности, дорожные карты</p>	<p>Умеет уверенно и достоверно определять эффективные методы воздействия на финансовый риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на финансовые риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственному за риск сотрудникам в правильной оценке финансового риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления финансовыми рисками с учетом отраслевой специфики; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды финансовых рисков и эффективно применять их с</p>





**КАРТА**  
**обеспеченности дисциплины учебной и учебно-методической литературой**

дисциплины: Финансовый риск-менеджмент

Код, специальность 21.05.04 Горное дело; 21.05.06 Нефтегазовая техника и технологии; 23.05.01

Наземные транспортно-технологические средства

№ п/п	Название учебного, учебно-методического издания, автор, издательство, вид издания, год издания	Количество экземпляров в БИК	Контингент обучающихся, использую	Обеспеченность обучающихся литературой, %	Наличие электронного варианта в ЭБС (+/-)
1	Слепухина, Ю. Э. Риск-менеджмент на финансовых рынках : учебное пособие / Ю. Э. Слепухина. — Екатеринбург : Уральский федеральный университет, ЭБС АСВ, 2015. — 216 с. — ISBN 978-5-7996-1522-2. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <a href="https://www.iprbookshop.ru/68289.html">https://www.iprbookshop.ru/68289.html</a>	ЭР*	30	100	+
2	Управление финансовыми рисками. Практикум : учебное пособие для вузов / И. П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И. П. Хоминич. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 129 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-13920-4. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/519556">https://urait.ru/bcode/519556</a>	ЭР*	30	100	+
3	Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 1 : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 211 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02606-1. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/512634">https://urait.ru/bcode/512634</a>	ЭР*	30	100	+
4	Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 2 : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 250 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02608-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/512635">https://urait.ru/bcode/512635</a>	ЭР*	30	100	+
5	Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 3 : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 272 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02609-2. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/512636">https://urait.ru/bcode/512636</a>	ЭР*	30	100	+

6	Латышева, Л. А. Финансовый риск-менеджмент : учебник / Л. А. Латышева, Ю. М. Складорова, И. Ю. Складоров. — Ставрополь : СтГАУ, 2021. — 376 с. — ISBN 976-5-9908446-1-2. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <a href="https://e.lanbook.com/book/245735">https://e.lanbook.com/book/245735</a>	ЭР*	30	100	+
---	--	-----	----	-----	---

ЭР\* – электронный ресурс для авторизованных пользователей доступен через Электронный каталог/Электронную библиотеку ТИУ <http://webirbis.tsogu.ru/>