Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Клочков Юрий Сергеевич
Должность: и.о. ректора
Дата подписания: 05.12.2024 17:56:55
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

направления подготовки: **01.03.02 Прикладная математика и информатика, 08.03.01 Строительство, 12.03.01 Приборостроение, 12.03.04 Биотехнические системы и технологии, 13.03.02 Электроэнергетика и электротехника, 15.03.01 Машиностроение, 15.03.06 Мехатроника и робототехника, 19.03.04 Технология продукции и организация, общественного питания, 20.03.01 Техносферная безопасность, 21.03.01 Нефтегазовое дело, 21.03.02 Землеустройство и кадастры, 22.03.01 Материаловедение и технологии материалов, 23.03.01 Технология транспортных процессов, 27.03.01 Стандартизация и метрология, 27.03.05 Инноватика**

Рабочая программа разработана в соответствии с утвержденными учебными планами от 30. 08.2021г. и требованиями ОПОП 01.03.02 Прикладная математика и информатика, 08.03.01 Строительство, 12.03.01 Приборостроение, 12.03.04 Биотехнические системы и технологии, 13.03.02 Электроэнергетика и электротехника, 15.03.01 Машиностроение, 15.03.06 Мехатроника и робототехника, 19.03.04 Технология продукции и организация, общественного питания, 20.03.01 Техносферная безопасность, 21.03.01 Нефтегазовое дело, 21.03.02 Землеустройство и кадастры, 22.03.01 Материаловедение и технологии материалов, 23.03.01 Технология транспортных процессов, 27.03.01 Стандартизация и метрология, 27.03.05 Инноватика к результатам освоения дисциплины Финансовый риск-менеджмент

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 рисковых 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: З1 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	4/7	6	10	-	88	4	зачет
очно-заочная	4/7	12	20	-	76	-	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	6	10	0	20	36	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания

		риска							
		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		

очно-заочная форма обучения (ОЗФО)

Таблица 5.1.3

№ 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	4	8	0	26	38	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
2	2	Организация менеджмента финансовых рисков компании	4	6	0	26	36	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
3	3	Основные организационные формы снижения финансового риска	4	6	0	24	34	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
		Итого:	12	20	0	76	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	4	Управление финансовыми рисками
2	2	6	2	4	Организация менеджмента финансовых рисков компании
3	3	6	2	4	Основные организационные формы снижения финансового риска
Итого:		18	6	12	-

Практические занятия

Таблица 5.2.3

№ п/п	Номер раздела дисциплины	Объем, час.			Тема лекции
		ОФО	ЗФО	ОЗФО	
1	1	12	4	8	Управление финансовыми рисками
2	3	12	2	6	Организация менеджмента финансовых рисков компании
3	4	10	4	6	Основные организационные формы снижения финансового риска
Итого:		34	10	20	-

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	26	Управление финансовыми рисками	Решение кейса №1
3	2	18	30	26	Организация менеджмента финансовых рисков компании	Решение кейса №2
6	3	20	29	24	Основные организационные формы снижения финансового риска	Решение кейса №3
Итого:		56	88	76		

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
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
	ИТОГО за первую текущую аттестацию	0-30
2 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
	ИТОГО за вторую текущую аттестацию	0-30
3 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
2	Тестирование	0-10
	ИТОГО за третью текущую аттестацию	0-40
	ВСЕГО	**100**

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
	ВСЕГО	**100**

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

1. Электронный каталог/Электронная библиотека ТИУ http://webirbis.tsogu.ru/
2. Цифровой образовательный ресурс – библиотечная система IPR SMART — https://www.iprbookshop.ru/
3. Электронно-библиотечная система «Консультант студента» www.studentlibrary.ru
4. Электронно-библиотечная система «ЛАНЬ» https://e.lanbook.com
5. Образовательная платформа ЮРАЙТ www.urait.ru
6. Научная электронная библиотека ELIBRARY.RU http://www.elibrary.ru
7. Информационный портал Правительства Российской Федерации - Правительство.рф
8. Информационный портал Президента Российской Федерации - Президент.рф
9. Интернет портал для управленцев http://www.management.com.ua/?lang=rus
10. 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	625039, Тюменская область, г. Тюмень, ул. Мельникайте, д.70

		занятия); групповых и индивидуальных консультаций; текущего контроля и 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 обучающихся 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.

Приложение 1

Планируемые результаты обучения для формирования компетенции и критерии их оценивания

Дисциплина Финансовый риск-менеджмент

Код, направления подготовки/специальности 01.03.02 Прикладная математика и информатика, 08.03.01 Строительство, 12.03.01 Приборостроение, 12.03.04 Биотехнические системы и технологии, 13.03.02 Электроэнергетика и электротехника, 15.03.01 Машиностроение, 15.03.06 Мехатроника и робототехника, 19.03.04 Технология продукции и организация, общественного питания, 20.03.01 Техносферная безопасность, 21.03.01 Нефтегазовое дело, 21.03.02 Землеустройство и кадастры, 22.03.01 Материаловедение и технологии материалов, 23.03.01 Технология транспортных процессов, 27.03.01 Стандартизация и метрология, 27.03.05 Инноватика

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине (модулю)	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
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: З1 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	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	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	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	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

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине (модулю)	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
		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	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 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.	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 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,	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 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	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 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

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине (модулю)	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
		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;	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 финансовыми рисками; навыками определения качественных и количественных критериев эффективности системы управления	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 в соответствии с разработанной программой; навыки разработки прогнозов развития определенной области знаний (технологий) в условиях риска и неопределенности; способностью разрабатывать (формулировать)	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)	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

Приложение 2

КАРТА
обеспеченности дисциплины учебной и учебно-методической литературой

дисциплины: Финансовый риск-менеджмент
Код, направления подготовки/специальности 01.03.02 Прикладная математика и информатика, 08.03.01 Строительство, 12.03.01 Приборостроение, 12.03.04 Биотехнические системы и технологии, 13.03.02 Электроэнергетика и электротехника, 15.03.01 Машиностроение, 15.03.06 Мехатроника и робототехника, 19.03.04 Технология продукции и организация, общественного питания, 20.03.01 Техносферная безопасность, 21.03.01 Нефтегазовое дело, 21.03.02 Землеустройство и кадастры, 22.03.01 Материаловедение и технологии материалов, 23.03.01 Технология транспортных процессов, 27.03.01 Стандартизация и метрология, 27.03.05 Инноватика

№ 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. - URL: http://www.iprbookshop.ru/68289.html. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "IPR BOOKS". -	ЭР*	30	100	-
2	Управление финансовыми рисками. Практикум : учебное пособие для вузов / И. П. Хоминич, Н. Ф. Челухина, И. В. Пещанская, А. П. Архипов [и др.]. - Москва : Юрайт, 2023. - 129 с. - (Высшее образование). - **URL:** https://urait.ru/bcode/519556. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "Юрайт"	ЭР	30	100	-
3	**Белов, Петр Григорьевич**. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебник и практикум для вузов. Ч. 1 / П. Г. Белов. - М : Издательство Юрайт, 2023. - 211 с. - (Высшее образование). - **URL:** https://urait.ru/bcode/512634. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "Юрайт".	ЭР	30	100	-
4	**Белов, Петр Григорьевич**. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебник и практикум для вузов. Ч. 2 / П. Г. Белов. - М : Издательство Юрайт, 2023. - 250 с. - (Бакалавр и магистр. Академический курс). - **URL:** https://urait.ru/bcode/512635. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "Юрайт".	ЭР	30	100	-

5	Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 3 : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 272 с. — (Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-02609-2. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: https://biblio-online.ru/bcode/434332.	ЭР	30	100	-
6	Основы финансового риск-менеджмента: учебник и учебное пособие // Солодов А.К. – М.: Издание Александра К. Солодова // Технический редактор Солодова Е.А.; корректор Нейц Е.А .// 2017 – 24,0 п.л., 286 стр. Текст : электронный. – URL: http://elib.fa.ru/fbook/solodov_64842.pdf	ЭР	30	100	-
7	Латышева, Л. А. Финансовый риск-менеджмент : учебник для обучающихся специальности 38.05.01 – экономическая безопасность / Л. А. Латышева, Ю. М. Склярова, И. Ю. Скляров. - Ставрополь : СтГАУ, 2021. - 376 с. - ЭБС "Лань". - ISBN 976-5-9908446-1-2 : ~Б. ц. - Текст : непосредственный.	ЭР	30	100	-

*ЭР – электронный ресурс доступный 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

направления подготовки: **09.03.01 Информатика и вычислительная техника, 09.03.02 Информационные системы и технологии, 13.03.01 Теплоэнергетика и теплотехника, 18.03.01 Химическая технология, 27.03.04 Управление в технических системах, 28.03.03 Наноматериалы, 38.03.05 Бизнес-информатика, 38.03.06 Торговое дело, 38.03.10 Жилищное хозяйство и коммунальная инфраструктура, 41.03.06 Публичная политика и социальные науки, 43.03.01 Сервис, 45.03.04 Интеллектуальные системы в гуманитарной сфере**

Рабочая программа разработана в соответствии с ОПОП 09.03.01 Информатика и вычислительная техника, 09.03.02 Информационные системы и технологии, 13.03.01 Теплоэнергетика и теплотехника, 18.03.01 Химическая технология, 27.03.04 Управление в технических системах, 28.03.03 Наноматериалы, 38.03.05 Бизнес-информатика, 38.03.06 Торговое дело, 38.03.10 Жилищное хозяйство и коммунальная инфраструктура, 41.03.06 Публичная политика и социальные науки, 43.03.01 Сервис, 45.03.04 Интеллектуальные системы в гуманитарной сфере к результатам освоения дисциплины Финансовый риск-менеджмент

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 рисковых 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: З1 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	4/7	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	36	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
2	2	Организация менеджмента финансовых рисков компании	4	10	0	20	34	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
3	3	Основные организационные формы снижения финансового риска	6	12	0	20	38	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	ПКСд-6.1	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	6	2	-	Основные организационные формы снижения финансового риска
Итого:		16	6	-	-

Практические занятия

Таблица 5.2.3

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

2	3	10	2	-	Организация менеджмента финансовых рисков компании
3	4	12	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
	ИТОГО за первую текущую аттестацию	0-30
2 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
	ИТОГО за вторую текущую аттестацию	0-30
3 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
2	Тестирование	0-10
	ИТОГО за третью текущую аттестацию	0-40
	ВСЕГО	**100**

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
	ВСЕГО	**100**

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

1. Электронный каталог/Электронная библиотека ТИУ http://webirbis.tsogu.ru/
2. Цифровой образовательный ресурс – библиотечная система IPR SMART — https://www.iprbookshop.ru/
3. Электронно-библиотечная система «Консультант студента» www.studentlibrary.ru
4. Электронно-библиотечная система «ЛАНЬ» https://e.lanbook.com

5 Образовательная платформа ЮРАЙТ www.urait.ru
6 Научная электронная библиотека ELIBRARY.RU http://www.elibrary.ru
7. Информационный портал Правительства Российской Федерации - Правительство.рф
8. Информационный портал Правительства Российской Федерации - Правительство.рф
9. Информационный портал Президента Российской Федерации - Президент.рф
10. Интернет портал для управленцев http://www.management.com.ua/?lang=rus
11. 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	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 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.	625039, Тюменская область, г. Тюмень, ул. Мельникайте, д.70

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 обучающихся 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.

Приложение 1

Планируемые результаты обучения для формирования компетенции и критерии их оценивания

Дисциплина Финансовый риск-менеджмент

Код, направления подготовки 09.03.01 Информатика и вычислительная техника, 09.03.02 Информационные системы и технологии, 13.03.01 Теплоэнергетика и теплотехника, 18.03.01 Химическая технология, 27.03.04 Управление в технических системах, 28.03.03 Наноматериалы, 38.03.05 Бизнес-информатика, 38.03.06 Торговое дело, 38.03.10 Жилищное хозяйство и коммунальная инфраструктура, 41.03.06 Публичная политика и социальные науки, 43.03.01 Сервис, 45.03.04 Интеллектуальные системы в гуманитарной сфере

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине (модулю)	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
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: З1 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	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	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	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	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

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине (модулю)	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
		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	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 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.	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 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	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 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	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 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

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине (модулю)	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
		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;	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 финансовыми рисками; навыками определения качественных и количественных критериев эффективности системы управления	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 в соответствии с разработанной программой; навыки разработки прогнозов развития определенной области знаний (технологий) в условиях риска и неопределенности; способностью разрабатывать (формулировать)	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)	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

Приложение 2

КАРТА
обеспеченности дисциплины учебной и учебно-методической литературой

дисциплины: Финансовый риск-менеджмент
Код, направления подготовки 09.03.01 Информатика и вычислительная техника, 09.03.02 Информационные системы и технологии, 13.03.01 Теплоэнергетика и теплотехника, 18.03.01 Химическая технология, 27.03.04 Управление в технических системах, 28.03.03 Наноматериалы, 38.03.05 Бизнес-информатика, 38.03.06 Торговое дело, 38.03.10 Жилищное хозяйство и коммунальная инфраструктура, 41.03.06 Публичная политика и социальные науки, 43.03.01 Сервис, 45.03.04 Интеллектуальные системы в гуманитарной сфере

№ 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. - URL: http://www.iprbookshop.ru/68289.html. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "IPR BOOKS". -	ЭР*	30	100	+
2	Управление финансовыми рисками. Практикум : учебное пособие для вузов / И. П. Хоминич, Н. Ф. Челухина, И. В. Пещанская, А. П. Архипов [и др.]. - Москва : Юрайт, 2023. - 129 с. - (Высшее образование). - **URL:** https://urait.ru/bcode/519556. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "Юрайт"	ЭР	30	100	-+
3	**Белов, Петр Григорьевич**. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебник и практикум для вузов. Ч. 1 / П. Г. Белов. - М : Издательство Юрайт, 2023. - 211 с. - (Высшее образование). - **URL:** https://urait.ru/bcode/512634. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "Юрайт".	ЭР	30	100	+
4	**Белов, Петр Григорьевич**. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебник и практикум для вузов. Ч. 2 / П. Г. Белов. - М : Издательство Юрайт, 2023. - 250 с. - (Бакалавр и магистр. Академический курс). - **URL:** https://urait.ru/bcode/512635. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "Юрайт".	ЭР	30	100	+
5	**Белов, Петр Григорьевич**. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебник и практикум для вузов. Ч. 3 / П. Г. Белов. - М : Издательство Юрайт, 2023. - 272 с. - (Бакалавр и магистр. Академический курс). - **URL:** https://urait.ru/bcode/512636. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "Юрайт".	ЭР	30	100	+

6	Слепухина, Ю. Э. Риск-менеджмент на финансовых рынках : учебное пособие / Ю. Э. Слепухина. - Екатеринбург : Уральский федеральный университет, ЭБС АСВ, 2015. - 216 с. - URL: http://www.iprbookshop.ru/68289.html. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "IPR BOOKS". -	ЭР	30	100	+

*ЭР – электронный ресурс доступный 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

направление подготовки: **18.03.02 Энерго- и ресурсосберегающие процессы в химической технологии, нефтехимии и биотехнологии**

Рабочая программа разработана в соответствии с утвержденным учебным планом от 30. 08.2021г. и требованиями ОПОП 18.03.02 Энерго- и ресурсосберегающие процессы в химической технологии, нефтехимии и биотехнологии к результатам освоения дисциплины Финансовый риск-менеджмент

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 рисковых 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: З1 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	36	-	54	-	зачет
заочная	4/7	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	12	0	18	36	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
		Итого:	18	36	0	54	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	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	12	4	-	Основные организационные формы снижения финансового риска
Итого:		36	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	18	29	-	Основные организационные формы снижения финансового риска	Решение кейса №3
Итого:		54	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
	ИТОГО за первую текущую аттестацию	0-30
2 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
	ИТОГО за вторую текущую аттестацию	0-30
3 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
2	Тестирование	0-10
	ИТОГО за третью текущую аттестацию	0-40
	ВСЕГО	**100**

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
	ВСЕГО	**100**

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

1. ТИУ «Полнотекстовая БД» на платформе ЭБС ООО «Издательство ЛАНЬ»
2. Ресурсы научно-технической библиотеки ФГБОУ ВО РГУ Нефти и газа (НИУ) им. И.М. Губкина.
3. Ресурсы научно-технической библиотеки ФГБОУ ВО УГНТУ.
4. Ресурсы научно-технической библиотеки ФГБОУ ВО «Ухтинский государственный

технический университет».

5. Предоставление доступа к ЭБС от ООО «Электронное издательство ЮРАЙТ».
6. Предоставление доступа к ЭБС от ООО «ЭБС ЛАНЬ».
7. Электронно-библиотечная система IPRbooks с ООО «Ай Пи Эр Медиа».
8. Предоставление доступа к ЭБС от ООО «Политехресурс».
9. Предоставление доступа к ЭБС от ООО «ПРОСПЕКТ».
10. Предоставление доступа к ЭБС от ООО «РУНЭБ».
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 промежуточной аттестации, Учебная лаборатория. Оснащенность: Учебная мебель: столы, стулья. Моноблок - 1 шт., проектор - 1 шт., проекционный экран - 1 шт., акустическая система	625039, Тюменская область, г. Тюмень, ул. Мельникайте, д.70

		(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 обучающихся 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.

Приложение 1

Планируемые результаты обучения для формирования компетенции и критерии их оценивания

Дисциплина Финансовый риск-менеджмент

Код, направления подготовки 18.03.02 Энерго- и ресурсосберегающие процессы в химической технологии, нефтехимии и биотехнологии

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине (модулю)	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
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: З1 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	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	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	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	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

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине (модулю)	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
		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	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 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.	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 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	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 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	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 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

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине (модулю)	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
		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;	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 финансовыми рисками; навыками определения качественных и количественных критериев эффективности системы управления	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 в соответствии с разработанной программой; навыки разработки прогнозов развития определенной области знаний (технологий) в условиях риска и неопределенности; способностью разрабатывать (формулировать)	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)	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

Приложение 2

КАРТА
обеспеченности дисциплины учебной и учебно-методической литературой

дисциплины: Финансовый риск-менеджмент
Код, направления подготовки 18.03.02 Энерго- и ресурсосберегающие процессы в химической технологии, нефтехимии и биотехнологии

№ 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. - URL: http://www.iprbookshop.ru/68289.html. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "IPR BOOKS". -	ЭР*	30	100	+
2	Управление финансовыми рисками. Практикум : учебное пособие для вузов / И. П. Хоминич, Н. Ф. Челухина, И. В. Пещанская, А. П. Архипов [и др.]. - Москва : Юрайт, 2023. - 129 с. - (Высшее образование). - **URL:** https://urait.ru/bcode/519556. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "Юрайт".	ЭР	30	100	+
3	**Белов, Петр Григорьевич**. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебник и практикум для вузов. Ч. 1 / П. Г. Белов. - М : Издательство Юрайт, 2023. - 211 с. - (Высшее образование). - **URL:** https://urait.ru/bcode/512634. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "Юрайт".	ЭР	30	100	+
4	**Белов, Петр Григорьевич**. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебник и практикум для вузов. Ч. 2 / П. Г. Белов. - М : Издательство Юрайт, 2023. - 250 с. - (Бакалавр и магистр. Академический курс). - **URL:** https://urait.ru/bcode/512635. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "Юрайт".	ЭР	30	100	+
5	**Белов, Петр Григорьевич**. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебник и практикум для вузов. Ч. 3 / П. Г. Белов. - М : Издательство Юрайт, 2023. - 272 с. - (Бакалавр и магистр. Академический курс). - **URL:** https://urait.ru/bcode/512636. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "Юрайт".	ЭР	30	100	+
6	Латышева, Л. А. Финансовый риск-менеджмент : учебник для обучающихся специальности 38.05.01 – экономическая безопасность / Л. А. Латышева, Ю. М. Склярова, И. Ю. Скляров. - Ставрополь : СтГАУ, 2021. - 376 с. - URL: https://e.lanbook.com/book/245735. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "Лань".	ЭР	30	100	+

7	Латышева, Л. А. Финансовый риск-менеджмент : учебник для обучающихся специальности 38.05.01 – экономическая безопасность / Л. А. Латышева, Ю. М. Склярова, И. Ю. Скляров. - Ставрополь : СтГАУ, 2021. - 376 с. - URL: https://e.lanbook.com/book/245735. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "Лань".	ЭР	30	100	+

*ЭР – электронный ресурс доступный 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

направление подготовки: **27.03.03 Системный анализ и управление**

направленность (профиль): **Системный анализ и управление социальными и экономическими процессами**

направления подготовки: **05.03.01 Геология, 15.03.04 Автоматизация технологических процессов и производств**
форма обучения: **очная, заочная**

Рабочая программа разработана для направлений подготовки 27.03.03 Системный анализ и управление, направленность (профиль) «Системный анализ и управление социальными и экономическими процессами», 05.03.01 Геология, 15.03.04 Автоматизация технологических процессов и производств к результатам освоения дисциплины Финансовый риск-менеджмент

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 рисковых 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: З1 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	14	28	-	66	-	зачет
заочная	4/7	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	10	0	22	36	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
3	3	Основные организационные формы снижения финансового риска	4	8	0	22	34	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
		Итого:	14	28	0	66	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	ПКСд-6.1	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	10	2	-	Организация менеджмента финансовых рисков компании
3	4	8	4	-	Основные организационные формы снижения финансового риска
Итого:		28	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	22	29	-	Основные организационные формы снижения финансового риска	Решение кейса №3
Итого:		66	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
	ИТОГО за первую текущую аттестацию	0-30
2 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
	ИТОГО за вторую текущую аттестацию	0-30
3 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
2	Тестирование	0-10
	ИТОГО за третью текущую аттестацию	0-40
	ВСЕГО	**100**

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
	ВСЕГО	**100**

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

1. Электронный каталог/Электронная библиотека ТИУ http://webirbis.tsogu.ru/

2 Цифровой образовательный ресурс – библиотечная система IPR SMART — https://www.iprbookshop.ru/

3 Электронно-библиотечная система «Консультант студента» www.studentlibrary.ru
4 Электронно-библиотечная система «ЛАНЬ» https://e.lanbook.com
5 Образовательная платформа ЮРАЙТ www.urait.ru
6 Научная электронная библиотека ELIBRARY.RU http://www.elibrary.ru
7. Информационный портал Правительства Российской Федерации - Правительство.рф
8. Информационный портал Президента Российской Федерации - Президент.рф
9. Интернет портал для управленцев http://www.management.com.ua/?lang=rus
10. Информационный портал Президента Российской Федерации - Президент.рф
11. Интернет портал для управленцев http://www.management.com.ua/?lang=rus
12. 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 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	625039, Тюменская область, г. Тюмень, ул. Мельникайте, д.70

		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 обучающихся 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.

Приложение 1

Планируемые результаты обучения для формирования компетенции и критерии их оценивания

Дисциплина Финансовый риск-менеджмент
Код, направление подготовки 27.03.03 Системный анализ и управление
Направленность (профиль) Системный анализ и управление социальными и экономическими процессами
Код, направление подготовки 05.03.01 Геология, 15.03.04 Автоматизация технологических процессов и производств

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине (модулю)	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
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: З1 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	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	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	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	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

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине (модулю)	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
		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	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 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.	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 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	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 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	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 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

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине (модулю)	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
		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;	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 финансовыми рисками; навыками определения качественных и количественных критериев эффективности системы управления	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 в соответствии с разработанной программой; навыки разработки прогнозов развития определенной области знаний (технологий) в условиях риска и неопределенности; способностью разрабатывать (формулировать)	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)	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

Приложение 2

КАРТА
обеспеченности дисциплины учебной и учебно-методической литературой

дисциплины: Финансовый риск-менеджмент
Код, направление подготовки 27.03.03 Системный анализ и управление
Направленность (профиль) Системный анализ и управление социальными и экономическими процессами
Код, направление подготовки 05.03.01 Геология, 15.03.04 Автоматизация технологических процессов и производств

№ 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. - URL: http://www.iprbookshop.ru/68289.html. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "IPR BOOKS". -	ЭР*	30	100	-
2	Управление финансовыми рисками. Практикум : учебное пособие для вузов / И. П. Хоминич, Н. Ф. Челухина, И. В. Пещанская, А. П. Архипов [и др.]. - Москва : Юрайт, 2023. - 129 с. - (Высшее образование). - **URL:** https://urait.ru/bcode/519556. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "Юрайт"	ЭР	30	100	-
3	**Белов, Петр Григорьевич**. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебник и практикум для вузов. Ч. 1 / П. Г. Белов. - М : Издательство Юрайт, 2023. - 211 с. - (Высшее образование). - **URL:** https://urait.ru/bcode/512634. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "Юрайт".	ЭР	30	100	-
4	**Белов, Петр Григорьевич**. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебник и практикум для вузов. Ч. 2 / П. Г. Белов. - М : Издательство Юрайт, 2023. - 250 с. - (Бакалавр и магистр. Академический курс). - **URL:** https://urait.ru/bcode/512635. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "Юрайт".	ЭР	30	100	-
5	**Белов, Петр Григорьевич**. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебник и практикум для вузов. Ч. 3 / П. Г. Белов. - М : Издательство Юрайт, 2023. - 272 с. - (Бакалавр и магистр. Академический курс). - **URL:** https://urait.ru/bcode/512636. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "Юрайт".	ЭР	30	100	-

6	Слепухина, Ю. Э. Риск-менеджмент на финансовых рынках : учебное пособие / Ю. Э. Слепухина. - Екатеринбург : Уральский федеральный университет, ЭБС АСВ, 2015. - 216 с. - URL: http://www.iprbookshop.ru/68289.html. - Режим доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "IPR BOOKS". -	ЭР	30	100	-

*ЭР – электронный ресурс доступный 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

направление подготовки: **27.03.03 Системный анализ и управление**

направленность (профиль): **Управление экономикой предприятий топливно-энергетического комплекса**

направления подготовки: **42.03.01 Реклама и связи с общественностью, 43.03.03 Гостиничное дело**
форма обучения: **очная, заочная**

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 рисковых 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: З1 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	4/7	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	36	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
2	2	Организация менеджмента финансовых рисков компании	4	10	0	20	34	ПКСд-6.1	Решение кейс-задания
3	3	Основные организационные формы снижения финансового риска	6	10	0	22	38	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	4	2	-	Организация менеджмента финансовых рисков компании
3	3	6	2	-	Основные организационные формы снижения финансового риска
Итого:		16	6	-	-

Практические занятия

Таблица 5.2.3

№ п/п	Номер раздела дисциплины	Объем, час.			Тема занятия
		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
	ИТОГО за первую текущую аттестацию	0-30
2 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
	ИТОГО за вторую текущую аттестацию	0-30
3 текущая аттестация		
1	Выполнение практических кейс-заданий	0-30
2	Тестирование	0-10
	ИТОГО за третью текущую аттестацию	0-40
	ВСЕГО	**100**

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
	ВСЕГО	**100**

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

- Образовательная платформа ЮРАЙТ www.urait.ru
- Научная электронная библиотека ELIBRARY.RU http://www.elibrary.ru
- Национальная электронная библиотека (НЭБ)

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	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 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.	625039, Тюменская область, г. Тюмень, ул. Мельникайте, д.70

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 обучающихся 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.

Приложение 1

Планируемые результаты обучения для формирования компетенции и критерии их оценивания

Дисциплина Финансовый риск-менеджмент
Код, направление подготовки 27.03.03 Системный анализ и управление
Направленность (профиль) Управление экономикой предприятий топливно-энергетического комплекса
Код, направление подготовки 42.03.01 Реклама и связи с общественностью, 43.03.03 Гостиничное дело

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
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: З1 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	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	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	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	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

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
		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	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 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.	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 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	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 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	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 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

Код компетенции	Код, наименование ИДК	Код и наименование результата обучения по дисциплине	Критерии оценивания результатов обучения			
			1-2	3	4	5
		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;	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 финансовыми рисками; навыками определения качественных и количественных критериев эффективности системы управления	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 в соответствии с разработанной программой; навыки разработки прогнозов развития определенной области знаний (технологий) в условиях риска и неопределенности; способностью разрабатывать (формулировать)	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)	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

Приложение 2

КАРТА
обеспеченности дисциплины учебной и учебно-методической литературой

дисциплины: Финансовый риск-менеджмент
Код, направление подготовки 27.03.03 Системный анализ и управление
Направленность (профиль) Управление экономикой предприятий топливно-энергетического комплекса
Код, направление подготовки 42.03.01 Реклама и связи с общественностью, 43.03.03 Гостиничное дело

№ 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. - URL: http://www.iprbookshop.ru/68289.html . -	ЭР*	30	100	+
2	**Управление** финансовыми рисками : учебник и практикум для вузов / И. П. Хоминич, А. П. Архипов, Н. Ф. Челухина, О. В. Саввина [и др.] ; ред. И. В. Пещанская. - 2-е изд., испр. и доп. - Москва : Юрайт, 2023. - 569 с. - (Высшее образование). - URL: https://urait.ru/bcode/511958.	ЭР	30	100	+
3	**Белов,** Петр Григорьевич. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебник и практикум для вузов. Ч. 1 / П. Г. Белов. - М : Издательство Юрайт, 2023. - 211 с. - (Высшее образование). - URL: https://urait.ru/bcode/512634	ЭР	30	100	+
4	**Белов,** Петр Григорьевич. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебник и практикум для вузов. Ч. 2 / П. Г. Белов. - М : Издательство Юрайт, 2023. - 250 с. - (Бакалавр и магистр. Академический курс). - URL: https://urait.ru/bcode/512635	ЭР	30	100	+
5	**Белов,** Петр Григорьевич. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебник и практикум для вузов. Ч. 3 / П. Г. Белов. - М : Издательство Юрайт, 2023. - 272 с. - (Бакалавр и магистр. Академический курс). - URL: https://urait.ru/bcode/512636 .	ЭР	30	100	+
6	Солодов, А. К. Основы финансового риск-менеджмента : учебник / А. К. Солодов. - Москва : Финансовый университет, 2017. - 286 с. - URL: https://e.lanbook.com/book/345404 .	ЭР	30	100	+

7	**Латышева, Л. А.** Финансовый риск-менеджмент : учебник для обучающихся специальности 38.05.01 – экономическая безопасность / Л. А. Латышева, Ю. М. Склярова, И. Ю. Скляров. - Ставрополь : СтГАУ, 2021. - 376 с. - URL: https://e.lanbook.com/book/245735	ЭР	30	100	+

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