

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Клочков Юрий Сергеевич
Должность: Ректор
Дата подписания: 19.08.2026 10:55:10
Уникальный программный ключ:
3beb265d5d589e7ff4c954946f3ad99a1e76b10

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

УТВЕРЖДАЮ

«_____» _____ 20__ г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины: Финансовый риск-менеджмент

Направление подготовки: 38.03.01 Экономика

Направленность (профиль): Инженерная экономика

Форма обучения: очная

Рабочая программа рассмотрена на заседании кафедры МТЭК
Протокол № _____ от «_____» _____ 20__ г.

1. Цели и задачи освоения дисциплины

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

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

2. Место дисциплины в структуре ОПОП ВО

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

Необходимыми условиями для освоения дисциплины являются:

знание основ управления и логики,

умения искать, систематизировать информацию,

владение навыками обобщения и анализа информации.

3. Результаты обучения по дисциплине

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

Таблица 3.1

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции (ИДК)	Код и наименование результата обучения по дисциплине
ПКСд-6 Способен выявлять, идентифицировать и прогнозировать риски с учетом отраслевой специфики; оценивать и управлять различными видами рисков на основе выбора эффективных методов воздействия	ПКСд-6.1 Выявляет, идентифицирует и прогнозирует риски с учетом отраслевой специфики; управляет различными видами рисков на основе выбора эффективных методов воздействия	Знать: 31 методы воздействия на финансовые риски в разрезе отдельных их видов; критерии, применяемые при выработке мероприятий по воздействию на финансовые риски в разрезе отдельных видов; методы, техники, технологии управления финансовыми рисками; возможности инструментов риск-менеджмента для анализа финансовых рисков организации
		Уметь: У1 определять эффективные методы воздействия на финансовый риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на финансовые риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственным за риск сотрудникам в правильной оценке финансового риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления финансовыми рисками с учетом отраслевой специфики; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды финансовых рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности; формировать формы отчетности, дорожные карты для целей реализации и мониторинга мероприятий по воздействию на финансовые риски.
		Владеть: В1 навыками осуществления качественной и количественной оценки финансовых рисков; навыками разработки стратегии элиминирования финансовых рисков (хеджирование, диверсификация, страхование); навыками использования современных методов управления финансовыми рисками нефинансовых компаний для обеспечения динамического развития их

		бизнеса, проведения самостоятельных исследований в области управления финансовыми рисками нефинансовых компаний в соответствии с разработанной программой; навыками разработки прогнозов развития определенной области знаний (технологий) в условиях риска и неопределенности; способностью разрабатывать (формулировать) основные стратегии управления финансовыми рисками; навыками определения качественных и количественных критериев эффективности системы управления финансовыми рисками.
--	--	--

4. Объем дисциплин

Общий объем дисциплины составляет 3 зачетных единиц, 108 часов.

Таблица 4.1.

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

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
4	Зачет	-	-	-	-	-	-	ПКСд-6.1	
Итого:			16	32	0	60	108		

Заочная форма обучения (ЗФО)

Не реализуется

Очно-заочная форма обучения (ОЗФО)

Не реализуется

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.

5.3. 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	-	-	Управление финансовыми рисками
2	2	4	-	-	Организация менеджмента финансовых рисков компании
3	3	6	-	-	Основные организационные формы снижения финансового риска
Итого:		16	-	-	-

Практические занятия

Таблица 5.2.2

№ п/п	Номер раздела дисциплины	Объем, час.			Тема занятия
		ОФО	ЗФО	ОЗФО	
1	1	10	-	-	Управление финансовыми рисками
2	2	10	-	-	Организация менеджмента финансовых рисков компании
3	3	12	-	-	Основные организационные формы снижения финансового риска
Итого:		32	-	-	-

Лабораторные работы учебным планом не предусмотрены.

Самостоятельная работа студента

Таблица 5.2.3

№ п/п	Номер раздела дисциплины	Объем, час.			Тема	Вид СРС
		ОФО	ЗФО	ОЗФО		
1	1	20	-	-	Управление финансовыми рисками	Решение кейса №1
3	2	20	-	-	Организация менеджмента финансовых рисков компании	Решение кейса №2
3	3	20	-	-	Основные организационные формы снижения финансового риска	Решение кейса №3
4	Зачет	-	-	-		Подготовка к зачету
Итого:		60	-	-		

5.3.1. 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

Контрольные работы не предусмотрены учебным планом

8. Оценка результатов освоения дисциплины

8.1. 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

9. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

9.1. Перечень рекомендуемой литературы представлен в Приложении 1.

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 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	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 обучающимся по правильной организации работы.

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

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

КАРТА обеспеченности дисциплины учебной и учебно-методической литературой

дисциплины: Финансовый риск-менеджмент

Направление подготовки: 38.03.01 Экономика

Направленность (профиль): Инженерная экономика

Форма обучения: очная

№ 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	ЭР	30	100	+

	доступа: для автор. пользователей. - ЭБС "Юрайт".				
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/>