

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации  
Федеральное государственное бюджетное образовательное  
учреждение высшего образования  
«Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова»  
Ереванский филиал**



**Кафедра «Экономические науки»**

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ  
Б1.В.ДВ.04.02.02 Финансовый риск – менеджмент  
(для набора на 2020 г)**

*Направление подготовки*

*38.03.01*

*Экономика*

**Направленность (профиль) программы**

*«Финансы и банковское дело»*

**Уровень высшего образования – Бакалавриат**

**Программа подготовки – Академический бакалавриат**

Ереван 2019 г.

Рецензенты:

1. Марухян В.Д. канд. экон. наук, доцент – (кафедра Экономики, организации, планирования промышленных предприятий и энергетики Государственного Инженерного Университета Армении (Политехник)
2. Сагателян Э.П. канд. тех. наук – Зам. Генерального директора ООО “Фирма Альфа”.

Аннотация рабочей программы дисциплины:

Целью изучения дисциплины «Финансовый риск-менеджмент» является овладение передовыми формами, методами и инструментами исследования, умениями выявлять и анализировать финансовые риски, осуществлять соответствующие расчеты; выбирать подходящий математический инструментарий для решения задач.

Учебные задачи дисциплины

- обеспечить понимание роли риск-менеджмента как экономического инструмента управления предприятием;
- уяснить содержание и основные элементы системы управления финансовыми рисками организации;
- сформировать практические навыки решения типовых задач по управлению финансовыми рисками организации;
- показать основные возможности применения современных подходов, методов и моделей управления финансовыми рисками, а также особенности их применения;
- овладеть технологией оценки финансовых рисков организации;
- овладеть инструментарием хеджирования, страхования и диверсификацией финансовых рисков

Рабочая программа составлена на основании Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика» (уровень бакалавриата), утвержденного приказом Министерства образования и науки России от 12.11.2015 №1327

Составитель(и): Пеплозян Б.А., к.э.н., доцент, академик АТА.

Рабочая программа утверждена на заседании кафедры «Экономические науки» протокол № 10 от 23 мая 2019 г.

Заведующий кафедрой

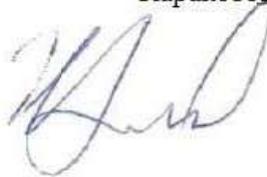


С.О.Искаджян

Рабочая программа утверждена на заседании кафедры «Экономические науки» протокол № 10 от 23 мая 2017 г.

Заведующий кафедрой

Каракозов Г.С.



Дополнения и изменения, внесенные в рабочую программу «Финансовый риск-менеджмент», рассмотрены на заседании кафедры экономических наук, протокол № 10 от 24 мая 2018 г.

Заведующий кафедрой



(подпись)

С.О.Искаджян

\_\_\_\_\_  
(Ф.И.О.)

Дополнения и изменения, внесенные в рабочую программу «Финансовый риск-менеджмент», утверждены на заседании кафедры экономических наук, протокол № 10 от 23 мая 2019г.

Заведующий кафедрой



(подпись)

С.О.Искаджян

\_\_\_\_\_  
(Ф.И.О.)

Дополнения и изменения, внесенные в рабочую программу «Финансовый риск-менеджмент», утверждены на заседании кафедры экономических наук, протокол № 10 от 25 мая 2020 г.

Заведующий кафедрой



(подпись)

А.К.  
Саакян

\_\_\_\_\_  
(Ф.И.О.)

Дополнения и изменения, внесенные в рабочую программу «Финансовый риск-менеджмент», утверждены на заседании кафедры экономических наук, протокол № 1 от 26 августа 2021 г.

Заведующий кафедрой



(подпись)

Б. В. Габриелян  
(Ф.И.О.)

## Содержание

### I. ОРГАНИЗАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКИЙ РАЗДЕЛ

Цели дисциплины

**Место дисциплины в структуре ОПОП ВО (основной профессиональной образовательной программы высшего образования)**

ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ СОДЕРЖАНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

ФОРМЫ КОНТРОЛЯ

### II. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

### III. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

### IV. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ, ИНФОРМАЦИОННОЕ И МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА

Перечень РЕСУРСОВ информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", необходимых для освоения дисциплины (модуля)

Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем

Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

### V. ТЕМАТИЧЕСКИЙ ПЛАН ИЗУЧЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

**(СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ, СТРУКТУРИРОВАННОЕ ПО ТЕМАМ (РАЗДЕЛАМ) С УКАЗАНИЕМ ЧАСОВ И ВИДОВ ЗАНЯТИЙ)**

### VI. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

6.1 Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы (см. таблицу раздела II)

6.2 Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания (см. таблицу раздела II и раздел VIII)

6.3. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы

### VII. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

**VIII. МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИЕ ПРОЦЕДУРЫ ОЦЕНИВАНИЯ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ, НАВЫКОВ И (ИЛИ) ОПЫТА ДЕЯТЕЛЬНОСТИ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ**

Приложение 1.

# І. ОРГАНИЗАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКИЙ

## РАЗДЕЛ Цели дисциплины

Целью изучения дисциплины «Финансовый риск-менеджмент» является овладение передовыми формами, методами и инструментами исследования, умениями выявлять и анализировать финансовые риски, осуществлять соответствующие расчеты; выбирать подходящий математический инструментарий для решения задач.

### Учебные задачи дисциплины

- обеспечить понимание роли риск-менеджмента как экономического инструмента управления предприятием;
- уяснить содержание и основные элементы системы управления финансовыми рисками организации;
- сформировать практические навыки решения типовых задач по управлению финансовыми рисками организации;
- показать основные возможности применения современных подходов, методов и моделей управления финансовыми рисками, а также особенности их применения;
- овладеть технологией оценки финансовых рисков организации;
- овладеть инструментарием хеджирования, страхования и диверсификацией финансовых рисков

### Место дисциплины в структуре ОПОП ВО (основной профессиональной образовательной программы высшего образования)

Дисциплина «Финансовый риск-менеджмент» входит в вариативную часть профессионального цикла

### Объем дисциплины и виды учебной работы

Показатель объема дисциплины	Всего часов		
	Очная ф.о.	Заочная ф.о.	Очно-заочная ф.о.
Объем дисциплины в зачетных единицах	3 ЗЕТ		
Объем дисциплины в часах	108		
Контактная работа обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) (всего)	56	18	
Объем аудиторной работы (всего)	54	16	
в том числе:			
• лекции	14	6	
• лабораторные занятия	-		
• практические занятия	40	10	
Объем электронного обучения			
в том числе:			
• лекции			
• практические занятия	-		
Самостоятельная работа (всего)	52	88	

### Требования к результатам освоения содержания дисциплины

В результате освоения дисциплины должны быть сформированы следующие компетенции:

ОПК – 2 способность осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач;

В результате освоения компетенции ОПК – 2 студент должен:

### 1. Знать:

- технологию сбора и обработки данных о финансовой деятельности компании; основы финансового анализа деятельности и эффективности использования капитала компании. процесс сбора финансово-экономической, статистической и бухгалтерской информации; возможность обработки собранной информации при помощи информационных технологий и различных финансово-бухгалтерских программ; варианты финансово-экономического анализа при решении вопросов профессиональной деятельности

### 2. Уметь:

- осуществлять поиск и сбор финансовой информации по полученному заданию; анализировать данные, необходимые для проведения конкретных финансовых расчетов. определять ценность сбора, анализа и обработки собранной финансово-экономической информации; соотносить собираемость информации на определенную дату и проводя анализ данных использовать различные методы статистической обработки; определять ценность сбора, анализа и обработки собранной финансово-экономической информации; соотносить собираемость информации на определенную дату и проводя анализ данных использовать различные методы статистической обработки; анализировать многообразие собранных данных и приводить их к определенному результату для обоснования экономического роста; оценивать роль собранных данных для расчета каждого экономического показателя; анализировать многообразие собранных данных и приводить их к определенному результату для обоснования экономического роста; оценивать роль собранных данных для расчета каждого экономического показателя

### 3. Владеть:

- современными техническими средствами обработки данных для анализа финансового состояния компании; современными методиками расчета и анализа финансовых показателей деятельности компании; навыками статистического, сравнительно-финансового анализа для определения места профессиональной деятельности в экономической парадигме; приемами анализа сложных социально-экономических показателей; навыками составления пояснения и объяснения изменения показателей, после проведенного сбора и анализа данных

ОПК – 3 способность выбрать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, проанализировать результаты расчетов и обосновать полученные выводы;

В результате освоения компетенции ОПК-3 студент должен:

#### 1. Знать:

- инструментальные средства для разработки долгосрочной и краткосрочной финансовой политики компании;

#### 2. Уметь:

- оценить эффективность инвестиционных проектов;
- определить оптимальную структуру источников финансирования инвестиционных проектов и текущих активов;
- избрать рациональный тип дивидендной политики;
- определить ценовую политику компании;
- управлять кредиторской задолженностью

#### 3. Владеть:

- практическими навыками разработки долгосрочной и краткосрочной финансовой политики;
- расчетами базового инструментария финансового менеджмента.

ОПК – 4 способность находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовность нести за них ответственность;

В результате освоения компетенции ОПК-4 студент должен:

#### 1. Знать:

- основные этапы разработки, принятия и реализации организационно-управленческих решений;

- требования экономической эффективности принимаемых организационно-управленческих решений.
2. Уметь:
- выбирать и применять, в зависимости от целей, задач и ситуации, методы и средства разработки и принятия коллективных и индивидуальных организационно-управленческих решений
  - определять ответственность за реализацию организационно-управленческих решений с позиций их экономической эффективности.
3. Владеть:
- навыками аргументации предлагаемых управленческих решений в области управления финансами компании;
  - методами и приемами реализации управленческих решений в финансовой сфере.

ПК-1 Способностью собирать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов

В результате освоения компетенции ПК-1 студент должен:

1. Знать:
- основные экономические и социально-экономические показатели, применяемые для характеристики компании;
  - основные варианты расчетов экономических показателей;
  - показатели, характеризующие рост производительности труда и рост заработной платы компаний в рыночной экономике.
2. Уметь:
- проводить обоснование правильности выбора сбора экономических и социально-экономических показателей;
  - анализировать экономические и социально-экономические показатели;
  - делать выводы и обосновывать полученные конечные результаты;
3. Владеть:
- навыками работы с аналитическими данными, полученными при обосновании деятельности компании;
  - экономическими основами профессиональной деятельности.

ПК – 3 способность выполнять необходимые для составления экономических разделов планов расчеты, обосновывать их и представлять результаты работы в соответствии с принятыми в организации стандартами

В результате освоения компетенции ПК-3 студент должен:

1. Знать:
- стандарты, используемые в мировом пространстве;
  - основные стандарты, действующие в России для предприятий и организаций;
  - базовые экономические понятия и стандарты, применяемые в организации;
  - объективные основы составления экономических планов;
  - основы планирования, бизнес-планирования и бюджетирования.
2. Уметь:
- анализировать экономические разделы планов;
  - использовать информацию, необходимую для составления различных разделов планов;
  - обосновывать расчеты, представленные в отдельных разделах плана;
  - принимать обоснованные решения и применять стандарты в профессиональной сфере;
  - решать типичные задачи, связанные с составлением планов и применять их при решении созданные в организации стандарты;
  - собирать экономическую информацию используя ее при составлении экономических разделов планов.
3. Владеть:

- методами экономических расчетов для составления планов, согласно стандартам компании.

### **Формы контроля**

*Текущий и рубежный контроль* осуществляется лектором и преподавателем, ведущим практические занятия, в соответствии с тематическим планом.

*Промежуточная аттестация в 7 семестре – зачет*

Результаты текущего контроля и промежуточной аттестации формируют рейтинговую оценку работы студента. Распределение баллов при формировании рейтинговой оценки работы студента осуществляется в соответствии с «Положением о рейтинговой системе оценки успеваемости и качества знаний студентов в федеральном государственном бюджетном образовательном учреждении высшего образования «Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова». Распределение баллов по отдельным видам работ в процессе освоения дисциплины «Финансовый риск-менеджмент» осуществляется в соответствии с разделом VIII.

## II. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

**и описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования в процессе освоения образовательной программы**

№ п/п	Наименование раздела дисциплины (темы)	Содержание	Формируемые компетенции	Результаты освоения (знать, уметь, владеть,	Образовательные технологии
<b>Семестр 7</b>					
1.	Тема 1. Понятие риска. Сущность и классификация рисков. Характеристика финансовых рисков.	<p>Основы теории предпринимательских рисков. Содержание концепции финансового менеджмента «Риск - доходность». Понятие рисков и их классификация. Сущность макроэкономического, производственного (делового) и финансового рисков.</p> <p>Классификация финансовых рисков по видам, уровню потерь и источникам возникновения. Этапы проведения анализа предпринимательского риска. Методы проведения анализа предпринимательского риска. Построение риск-профиля (карты рисков).</p>	ОПК – 2	<p><b>Знать:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• концептуальные основы, сущность, определение и классификацию финансовых рисков.</li> </ul> <p><b>Уметь:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• концептуальные основы, сущность, определение и классификацию финансовых рисков.</li> </ul> <p><b>Владеть:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• экономической и финансовой терминологией, используемой в современной финансовой науке и практике.</li> </ul>	лекции; практические занятия; консультации преподавателей; самостоятельная работа; интерактивные лекции; деловые и ролевые игры; круглые столы.
2.	Тема 2. Методы анализа и оценки финансовых рисков.	<p>Количественная оценка риска. Показатели оценки риска: вероятность, математическое ожидание, дисперсия, стандартное отклонение, коэффициент вариации. Качественная оценка риска. Методы экспертных оценок (метод «Дельфи» и др.).</p>	ОПК-2; ОПК-3; ОПК-4; ПК-3; ПК-1	<p><b>Знать:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• источники информации, методы сбора и анализа информации, необходимой для анализа финансовых рисков.</li> <li>• базовые инструментальные средства необходимые для</li> </ul>	лекции; практические занятия; расчетно-аналитические задания; консультации преподавателей;

		<p>Принятие решения в условиях неопределенности. Критерии принятия решения в условиях неопределенности: Вальда (макси-мин), макси-макс, Альфа-критерий Гурвица. Сэвиджа (критерий отказа от мини-макса).</p>		<p>обработки экономических и финансовых данных;</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• основные экономические показатели необходимые для выявления и анализа финансовых рисков.</li> <li>• количественные методы вычисления параметров финансовых рисков коммерческой организации;</li> </ul> <p><b>Уметь:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• выявлять финансовые риски и оценивать последствия реализации различных финансовых рисков.</li> <li>• осуществлять отбор и анализировать финансовую, производственную и экономическую информацию, необходимую для оценки финансовых рисков;</li> <li>• обосновывать все виды экономических рисков и анализировать проведенные расчеты.</li> <li>• грамотно использовать методы оценки финансовых рисков;</li> </ul> <p><b>Владеть:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• навыками применения расчетно-аналитического аппарата для решения практических задач финансового риск-менеджмента.</li> <li>• методами выбора инструментальных средств для обработки экономических данных;</li> </ul>	<p>самостоятельная работа; интерактивные лекции; деловые и ролевые игры; круглые столы.</p>
--	--	--	--	---	---

				<ul style="list-style-type: none"> <li>• системой выводов для обоснования полученных результатов при расчетах экономических данных.</li> <li>• навыками интерпретации результатов оценки финансовых рисков</li> </ul>	
3.	Тема 3. Содержание и анализ финансовых рисков.	<p>Понятие риска утраты ликвидности (платежеспособности). Инструментарий оценки и анализа риска утраты ликвидности и платежеспособности. Действующее законодательство о несостоятельности (банкротстве). Система фундаментальной диагностики банкротства (модели Э.Альтмана, У.Бивера, Дж.Аргенти и др.).</p> <p>Инвестиционные риски и их классификация. Методы анализа рисков инвестиционных проектов.</p> <p>Валютные риски. Факторы, влияющие на курсы валют. Классификация валютных рисков: операционный, трансляционный и экономический валютные риски.</p> <p>Процентные риски. Факторы, влияющие на уровень процентных ставок. Классификация процентных рисков: позиционный, портфельный и экономический (структурный) процентные риски.</p>	ОПК-2; ОПК-3; ОПК-4; ПК-3; ПК-1	<p><b>Знать:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• основные экономические показатели необходимые для выявления и анализа финансовых рисков.</li> <li>• объекты, субъекты, цель, задачи и источники информации для анализа финансовых рисков;</li> <li>• количественные методы вычисления параметров финансовых рисков коммерческой организации;</li> <li>• инструментальные средства обработки информации, применяемые в финансовом риск-менеджменте.</li> </ul> <p><b>Уметь:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• анализировать финансовую, производственную и экономическую информацию, необходимую для оценки финансовых рисков;</li> <li>• выявлять финансовые риски;</li> <li>• грамотно использовать методы оценки финансовых рисков;</li> <li>• осуществлять отбор и обработку финансовой информации для решения поставленной задачи.</li> </ul> <p><b>Владеть:</b></p>	лекции; практические занятия; расчетно-аналитические задания; консультации преподавателей; самостоятельная работа; интерактивные лекции; деловые и ролевые игры; круглые столы.

				<ul style="list-style-type: none"> <li>• методами выбора инструментальных средств для обработки экономических данных;</li> <li>• системой выводов для обоснования полученных результатов при расчетах экономических данных.</li> <li>• инструментами и методами анализа финансовой состоятельности коммерческой организации и оценки вероятности банкротства в условиях рискованной среды;</li> <li>• навыками интерпретации результатов оценки финансовых рисков.</li> </ul>	
4.	Тема 4. Управление финансовыми рисками	<p>Цель, содержание и значение риск-менеджмента. Условия формирования эффективной системы риск-менеджмента. Этапы формирования системы управления рисками в организации. Принципы и правила управления финансовыми рисками. Этапы процесса управления финансовыми рисками: выявление (идентификация) риска, оценка риска, управление риском, контроль риска.</p> <p>Схемы переноса финансовых рисков: диверсификация, страхование, хеджирование.</p> <p>Организация риск-менеджмента коммерческой организации.</p>	ОПК-2; ОПК-3; ОПК-4; ПК-3; ПК-1	<p><b>Знать:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• нормативно-правовую базу, регулируемую экономические аспекты деятельности коммерческой организации;</li> <li>• взаимосвязь между финансовыми рисками и результатами финансово-хозяйственной деятельности коммерческой организации;</li> <li>• направления использования результатов финансового риск-анализа в финансовом планировании и управлении коммерческой организации.</li> </ul> <p><b>Уметь:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• прогнозировать развитие рискованных ситуаций;</li> </ul>	лекции; практические занятия; расчетно-аналитические задания; консультации преподавателей; самостоятельная работа; интерактивные лекции; деловые и ролевые игры; круглые столы.

				<ul style="list-style-type: none"><li>• обобщать результаты проведенных расчетов, формулировать грамотные выводы и представлять результаты аналитической работы.</li></ul> <b>Владеть:</b> <ul style="list-style-type: none"><li>• навыками принятия решений в условиях неопределенности;</li><li>• навыками самостоятельной аналитической работы.</li></ul>	
--	--	--	--	--	--

### III. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

В процессе освоения дисциплины «Финансовый риск-менеджмент» используются следующие образовательные технологии:

#### 1. Стандартные методы обучения:

- лекции;
- практические занятия, на которых обсуждаются основные проблемы, освещенные в лекциях и сформулированные в домашних заданиях;
- письменные домашние задания;
- консультации преподавателей;
- самостоятельная работа студентов, в которую входит освоение теоретического материала, подготовка к практическим/лабораторным занятиям, выполнение указанных выше письменных/устных заданий, работа с литературой.

#### 2. Методы обучения с применением интерактивных форм образовательных технологий:

- интерактивные лекции;
- обсуждение подготовленных студентами эссе;
- деловые и ролевые игры.
- групповые дискуссии.

### IV. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ, ИНФОРМАЦИОННОЕ И МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

#### *Рекомендуемая литература*

##### **Основная литература:**

- Б-1 Финансовый менеджмент: учебник / Шохин Е.И. под ред. и др. — Москва: КноРус, 2017. — 474 с. — (для бакалавров). — ISBN 978-5-406-05520-5. — URL: <https://book.ru/book/920293>
- О-1 Капустина, Н. В. Развитие организации на основе риск-менеджмента: теория, методология и практика: Монография / Н.В. Капустина. - Москва: НИЦ ИНФРА-М, 2014. - 178 с. + (Доп. мат. znanium.com). - (Научная мысль). ISBN 978-5-16-010571-0. - Текст: электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/494325>
- О-2 Домашенко, Д. В. Современные подходы к корпоративному риск-менеджменту: методы и инструменты / Домашенко Д.В., Финогенова Ю.Ю. - Москва: Магистр, НИЦ ИНФРА-М, 2016. - 304 с. ISBN 978-5-9776-0427-7. - Текст: электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/550188>

##### **Дополнительная литература:**

- Д-1 Савицкая, Г. В. Анализ эффективности и рисков предпринимательской деятельности: методологические аспекты: монография / Г.В. Савицкая. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва: ИНФРА-М, 2017. — 291 с. — (Научная мысль). — [www.dx.doi.org/10.12737/23374](http://www.dx.doi.org/10.12737/23374). - ISBN 978-5-16-105335-5. - Текст: электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/701842>
- Д-2 Макарова, С. Н. Управление финансовыми рисками: монография / С. Н. Макарова, И. С. Ферова, И. А. Янкина. - Красноярск: СФУ, 2014. - 230 с. - ISBN 978-5-7638-3139-9. - Текст: электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/549466>.
- Д-3 Локтионова, Ю.Н. Основы финансового менеджмента: учебное пособие / Локтионова Ю.Н., и др. — Москва : Русайнс, 2017. — 141 с. — ISBN 978-5-4365-1614-1. — URL: <https://book.ru/book/922647>

**Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", необходимых для освоения дисциплины (модуля)**

1. Электронно-библиотечная система «Znaniium»: <http://znaniium.com>.
2. Электронно-библиотечная система «Юрайт»: <http://www.biblio-online.ru>.
3. Электронно-библиотечная система «BOOK.ru»: <http://book.ru>.
4. Электронная библиотека Издательского дома «Гребенников»: <http://grebennikon.ru/>.
5. Научная электронная библиотека «КИБЕРЛЕНИНКА»: <http://cyberleninka.ru/>.
6. Федеральный портал «Российское образование»: <http://www.edu.ru/>.
7. Информационная система «Единое окно доступа к образовательным ресурсам»: <http://window.edu.ru/>.
8. Федеральный центр информационно-образовательных ресурсов: <http://fcior.edu.ru/>.

**Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем**

№ п/п	Перечень информационных технологий, программного обеспечения, информационных справочных систем	Номера тем
1	Система тестирования АСТ тест.	1 - 4
2	Операционная система Microsoft Windows 2007	1 - 4
3	Microsoft Office Prof Plus 2007	1 - 4
4	Справочно-правовая система «Гарант»	1 - 4
5	Справочно-правовая система «Консультант Плюс»	1 - 4

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

**Тема 1. Понятие риска. Сущность и классификация рисков. Характеристика финансовых рисков**

**Литература: Б-1, О-1, О-2; Д-1 - Д-4**

**Вопросы для самопроверки:**

1. Сущность, факторы и виды неопределенности.
2. Сущность и причины риска.
3. Классификация рисков по различным признакам.
4. Характеристика финансовых рисков, их видов и факторов, оказывающих влияние на риски
5. Характеристика инвестиционных рисков, их видов и факторов, оказывающих на них влияние.

**Вопросы для обсуждения:**

1. Риск как историческая категория.
2. Функции риска в экономике
3. Взаимосвязь неопределенности и риска.
4. Взаимосвязь риска и прибыли.
5. Принципы построения риск-профиля (карты рисков).

**Тема 2. Методы анализа и оценки финансовых рисков.**

**Литература: Б-1, О-1, О-2; Д-1 - Д-5**

**Вопросы для самопроверки:**

1. Количественная оценка риска
2. Качественный анализ рисков.
3. Вероятностная оценка степени финансового риска.
4. Критерии Лапласа, Вальда, Сэвиджа, Гурвица.
5. Расчет вероятности убытков.

**Вопросы для обсуждения:**

1. Необходимость оценки риска.
2. Роль информации в анализе рисков.
3. Проблемы идентификации финансовых рисков на предприятии.
4. Роль количественного и качественного анализа рисков в системе управления ими.
5. Выявление практических выгод и возможных негативных последствий рискованных решений.

**Тема 3. Содержание и анализ финансовых рисков.**

**Литература: Б-1, О-1, О-2; Д-1 - Д-5**

**Вопросы для самопроверки:**

1. Риск утраты ликвидности (платежеспособности).
2. Основные модели диагностики банкротства.
3. Инвестиционные риски.
4. Валютные риски.
5. Процентные риски.

**Вопросы для обсуждения:**

1. Инструментарий оценки и анализа риска
2. Классификация процентных рисков.
3. Факторы, влияющие на курсы валют.
4. Инструменты и методы анализа финансовой состоятельности коммерческой организации
5. Оценки вероятности банкротства в условиях рискованной среды

**Тема 4. Управление финансовыми рисками**

**Литература: Б-1, О-1, О-2; Д-1 - Д-5**

**Вопросы для самопроверки:**

1. Объект, субъект, цели и задачи управления рисками.
2. Основные этапы управления рисками.
3. Суть диверсификации риска.
4. Сущность, преимущества и недостатки страхования.
5. Сущность, преимущества и недостатки лимитирования.

### Вопросы для обсуждения:

1. Отличие методов диверсификации и разделения финансовых рисков.
2. Современные приемы управления финансовым риском.
3. Деятельность финансового риск-менеджера в условиях неопределенности.
4. Преимущества и недостатки хеджирования
5. Процесс оценки эффективности управления риском.

### Материально-техническое обеспечение дисциплины

1. Операционная система Microsoft Windows: 7, 8, 10 Pro;
2. Антивирусное ПО Microsoft Security Essentials для ПК;
3. Пакет прикладных программ Microsoft Office: 2007, 2010, 2013, 2016 (MS Word, MS Excel, MS Power Point, MS Access), Office 365 Business;
4. Google Chrome
5. Adobe Flash Player/ Adobe Reader DC
6. Архиватор WinRAR
7. Архиватор 7zip

### V. ТЕМАТИЧЕСКИЙ ПЛАН ИЗУЧЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

*(Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием часов и видов занятий)*

№ п/п	Наименование разделов и Тем	Контактные часы							Самостоят. работа		Формы текущего контроля	
		Аудиторные часы					Часы в электронной форме обучения		формы	часы		
		Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	Всего ауд.	В том числе интерактивные	формы	часы				
					формы	часы	лекции	практические занятия	формы	часы		
<b>7 семестр</b>												
1.	Тема 1. Понятие риска. . Сущность и классификация рисков. Характеристика финансовых рисков	2	8	-	10	И.л.				Лит. инд. з.	13	Опрос, тест
2.	Тема 2. Методы анализа и оценки финансовых рисков.	4	12	-	16	И.л.				Лит., инд. з.	13	Опрос, тест
3.	Тема 3. Содержание и анализ финансовых рисков	4	10	-	16	И.л.				Лит., инд. з.	13	Опрос, тест
4.	Тема 4. Управление финансовыми рисками	4	10	-	14	И.л.				Лит., инд. з.	13	Опрос, тест
<b>ИТОГО</b>		<b>14</b>	<b>40</b>		<b>56</b>			-			<b>52</b>	

											зачет
Всего по дисциплине	14	40		56			-			52	

Сокращения, используемые в Тематическом плане изучения дисциплины:

№ п/п	Сокращение	Вид работы
1.	Лит	Работа с литературой
2.	П.д.з.	Выполнение письменной домашней работы
3.	Р.а.з	Расчетно-аналитические задания
4.	И.л.	Интерактивные лекции
5.	А.д.с.	Анализ деловых ситуаций

## VI. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ <sup>1</sup>

Оценочные средства по дисциплине разработаны в соответствии с Положением о фонде оценочных средств в ФГБОУ ВО «РЭУ им. Г.В. Плеханова».

*(Фонд оценочных средств хранится на кафедре, обеспечивающей преподавание данной дисциплины)*

**6.1 Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы (см. таблицу раздела II)**

**6.2 Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания (см. таблицу раздела II и раздел VIII)**

**6.3. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы**

- Тематика курсовых работ

Курсовая работа по дисциплине «Финансовый риск-менеджмент» не предусмотрена.

<sup>1</sup> Приведены примеры из ФОС

### Вопросы к зачету

1. Понятие риска как экономической категории.
2. Сущность риска и основные причины его возникновения.
3. Сущность и функции финансового риска.
4. Характеристика основных теорий финансовых рисков.
5. Место финансовых рисков в общей классификации рисков.
6. Современные классификации финансовых рисков и их основные проявления.
7. Риски утраты ликвидности (платежеспособности).
8. Виды инвестиционных рисков и рисков, связанных с покупательной способностью денег.
9. Общая характеристика основных факторов и их влияния на изменение уровня финансового риска.
10. Концепция взаимосвязи доходности и риска.
11. Финансовое состояние коммерческой организации и риск банкротства
12. Основные подходы к выявлению риска.

13. Система фундаментальной диагностики банкротства (модели Э.Альтмана, У.Бивера, Дж.Аргенти и др.).
14. Методы анализа рисков инвестиционных проектов.
15. Анализ валютных рисков.
16. Последствия и методы контроля валютного риска.
17. Анализ процентных рисков.
18. Анализ финансовой и управленческой отчетности как методы выявления рисков.
19. Построение риск-профиля (карты рисков).
20. Качественные методы оценки финансовых рисков.
21. Критерии и методы количественной оценки финансовых рисков.
22. Методы оценки риска: экономико-статистические, математические.
23. Интегральная оценка и характеристики риска.
24. Специфические показатели, используемые для количественной оценки риска:  $\beta$  коэффициент, точка безубыточности, операционный левверидж, финансовый левверидж, коэффициенты ликвидности и пр.
25. Взаимодействие финансового и операционного рычагов и оценка совокупного риска, связанного с коммерческой организацией.
26. Система управления финансовыми рисками.
27. Принципы и ключевые правила управления финансовыми рисками.
28. Общая схема процесса управления риском. Условия формирования эффективной системы риск-менеджмента.
29. Способы управления финансовыми рисками.
30. Анализ эффективности методов управления финансовыми рисками.
31. Критерии принятия решения в условиях неопределенности.
32. Риск-менеджмент: цель, содержание, значение, условия формирования системы риск-менеджмента, этапы формирования.
33. Схемы переноса финансовых рисков: диверсификация, страхование, хеджирование.
34. Организация риск-менеджмента коммерческой организации.

#### **Тематика рефератов, докладов:**

1. Финансовая среда предпринимательства и её рисковые составляющие.
2. История развития теории рисков.
3. Характеристика финансовых рисков (по видам).
4. Чистые и спекулятивные предпринимательские риски.
5. Риск банкротства как основное проявление предпринимательских рисков.
6. Методы качественного анализа рисков.
7. Методы выявления рисков.
8. Количественные методы оценки и анализа финансовых рисков.
9. Практические аспекты оценки финансового риска.
10. Страхование как способ управления финансовыми рисками.
11. Способы снижения финансовых рисков.
12. Внутренние механизмы нейтрализации рисков.
13. Финансовое состояние предприятия и риск банкротства.
14. Риск и доходность финансовых активов.
15. Инвестиционные риски: виды, управление и оценка.
16. Риск несбалансированной ликвидности, его проявление и признаки.

#### **Примеры тестов для контроля знаний**

**1. Риск, обусловленный отраслевыми особенностями бизнеса**

- A. актуарный риск
- B. проектный риск
- C. производственный риск
- D. финансовый риск

**2. Способы управления риском:**

- A. избежание риска, т.е. сознательное решение не подвергаться определенному виду риска
- B. предотвращение ущерба с целью снижения вероятности потерь и минимизации негативных последствий
- C. принятие риска через покрытие убытков за счет собственных средств
- D. перенос риска на других лиц

**3. Какой статистический показатель колеблемости показывает среднее отклонение значений варьирующего признака относительно центра распределения:**

- A. среднее ожидаемое значение
- B. дисперсия
- C. среднеквадратическое отклонение
- D. коэффициент вариации

**4. Какая функция риска стимулирует поиск нетрадиционных решений проблем:**

- A. регулятивная
- B. защитная
- C. инновационная
- D. аналитическая

**5. Субъект риска – это:**

- A. юридическое или физическое лицо, находящееся в ситуации риска и осознающее это
- B. коммерческая организация-производитель
- C. физическое лицо (отдельные индивидуумы, получатели дохода)
- D. организации непромышленной сферы деятельности

**VII. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

Положение об интерактивных формах обучения (<http://www.rea.ru>)

Положение об организации самостоятельной работы студентов (<http://www.rea.ru>)

Положение о курсовых работах (<http://www.rea.ru>)

Положение о рейтинговой системе оценки успеваемости и качества знаний студентов (<http://www.rea.ru>)

Положение об учебно-исследовательской работе студентов в ФГБОУ ВО "РЭУ им. Г.В. Плеханова" (<http://www.rea.ru>)

вид учебных занятий	Организация деятельности студента
Лекция	Написание конспекта лекций: кратко, схематично, последовательно фиксировать основные положения, выводы, формулировки, обобщения; пометить важные мысли, выделять ключевые слова, термины. Проверка терминов, понятий с помощью энциклопедий, словарей, справочников с выписыванием толкований в тетрадь. Обозначить вопросы, термины, материал, который вызывает трудности, пометить и попытаться найти ответ в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удастся разобраться в

	материале, необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на консультации, на практическом занятии. Уделить внимание следующим понятиям (перечисление понятий) и др.
Практические занятия	Проработка рабочей программы, уделяя особое внимание целям и задачам, структуре и содержанию дисциплины. Конспектирование источников. Работа с конспектом лекций, подготовка ответов к контрольным вопросам, просмотр рекомендуемой литературы, работа с текстом (указать текст из источника и др.). Прослушивание аудио- и видеозаписей по заданной теме, решение расчетно-графических заданий, решение задач по алгоритму и др.
Контрольная работа / индивидуальные задания	Знакомство с основной и дополнительной литературой, включая справочные издания, зарубежные источники, конспект основных положений, терминов, сведений, требующихся для запоминания и являющихся основополагающими в этой теме. Составление аннотаций к прочитанным литературным источникам и др.

**VIII. МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИЕ ПРОЦЕДУРЫ ОЦЕНИВАНИЯ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ, НАВЫКОВ И (ИЛИ) ОПЫТА ДЕЯТЕЛЬНОСТИ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ**

***Формирование балльной оценки по дисциплине «Финансовый риск-менеджмент»***

В соответствии с «Положением о рейтинговой системе оценки успеваемости и качества знаний студентов в федеральном государственном бюджетном образовательном учреждении высшего образования «Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова» распределение баллов, формирующих рейтинговую оценку работы студента, осуществляется следующим образом:

Виды работ	Максимальное количество баллов
Выполнение учебных заданий на аудиторных занятиях	20
Текущий и рубежный контроль	20
Творческий рейтинг	20
Промежуточная аттестация (экзамен/ зачет)	40
<b>ИТОГО</b>	<b>100</b>

**Текущий и рубежный контроль**

Расчет баллов по результатам текущего и рубежного контроля в 7 семестре

Форма контроля	Наименование раздела/ темы, выносимых на контроль	Форма проведения контроля (тест, контр. работа и др. виды контроля в соответствии с Положением)	Количество баллов
1. Текущий и рубежный контроль	Темы 1-4	Тест	20
<b>ИТОГО</b>			<b>20</b>

**Творческий рейтинг**

Распределение баллов осуществляется по решению методической комиссии кафедры и результат распределения баллов за соответствующие виды работ представляются в виде следующей таблицы:

<b>Наименование раздела/ темы дисциплины</b>	<b>Вид работы</b>	<b>Количество баллов</b>
Темы 1-4	Итоговое тестирование	20
		20

#### **Промежуточная аттестация**

**Зачет** по результатам изучения учебной дисциплины «Финансовый риск-менеджмент» в 7-ом семестре проводится в устной форме.

**Итоговый балл** формируется суммированием баллов за промежуточную аттестацию и баллов, набранных перед аттестацией. Приведение суммарной балльной оценки к четырехбалльной шкале производится следующим образом:

**Показатели и критерии оценивания планируемых результатов освоения компетенций и результатов обучения, шкала оценивания**

100-балльная система оценки	Традиционная четырехбалльная система оценки	Формируемые компетенции (индикаторы компетенций)	Критерии оценивания
85 – 100 баллов	«отлично»	ОПК – 2	<p><b>Знает верно и в полном объеме:</b>  технологию сбора и обработки данных о финансовой деятельности компании; основы финансового анализа деятельности и эффективности использования капитала компании. процесс сбора финансово-экономической, статистической и бухгалтерской информации; возможность обработки собранной информации при помощи информационных технологий и различных финансово-бухгалтерских программ; варианты финансово-экономического анализа при решении вопросов профессиональной деятельности</p> <p><b>Умеет верно и в полном объеме:</b>  осуществлять поиск и сбор финансовой информации по полученному заданию; анализировать данные, необходимые для проведения конкретных финансовых расчетов. определять ценность сбора, анализа и обработки собранной финансово-экономической информации; соотносить собираемость информации на определенную дату и проводя анализ данных использовать различные методы статистической обработки; определять ценность сбора, анализа и обработки собранной финансово-экономической информации; соотносить собираемость информации на определенную дату и проводя анализ данных использовать различные методы статистической обработки; анализировать многообразие собранных данных и приводить их к определенному результату для обоснования экономического роста; оценивать роль собранных данных для расчета каждого экономического показателя; анализировать многообразие собранных данных и приводить их к определенному результату для обоснования экономического роста; оценивать роль собранных данных для расчета каждого экономического показателя</p> <p><b>Владет навыками верно и в полном объеме:</b>  современными техническими средствами обработки данных для анализа финансового состояния компании; современными методиками расчета и анализа финансовых показателей деятельности компании; навыками</p>

		<p>статистического, сравнительно-финансового анализа для определения места профессиональной деятельности в экономической парадигме; приемами анализа сложных социально-экономических показателей; навыками составления пояснения и объяснения изменения показателей, после проведенного сбора и анализа данных</p>
	ОПК-3	<p><b>Знает верно и в полном объеме:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• инструментальные средства для разработки долгосрочной и краткосрочной финансовой политики компании;</li> </ul> <p><b>Умеет верно и в полном объеме:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• оценить эффективность инвестиционных проектов;</li> <li>• определить оптимальную структуру источников финансирования инвестиционных проектов и текущих активов;</li> <li>• избрать рациональный тип дивидендной политики;</li> <li>• определить ценовую политику компании;</li> <li>• управлять кредиторской задолженностью</li> </ul>

			<p><b>Владеет навыками верно и в полном объеме:</b>  практическими навыками разработки долгосрочной и краткосрочной финансовой политики;</p>
		ОПК – 4	<p><b>Знает верно и в полном объеме:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• основные этапы разработки, принятия и реализации организационно-управленческих решений;</li> <li>• требования экономической эффективности принимаемых организационно-управленческих решений.</li> </ul> <p><b>Умеет верно и в полном объеме:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• выбирать и применять, в зависимости от целей, задач и ситуации, методы и средства разработки и принятия коллективных и индивидуальных организационно-управленческих решений</li> <li>• определять ответственность за реализацию организационно-управленческих решений с позиций их экономической эффективности.</li> </ul> <p><b>Владеет навыками верно и в полном объеме:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• навыками аргументации предлагаемых управленческих решений в области управления финансами компании;</li> <li>• методами и приемами реализации управленческих решений в финансовой сфере.</li> </ul>
		ПК-1	<p><b>Знает верно и в полном объеме:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• основные экономические и социально-экономические показатели, применяемые для характеристики компании;</li> <li>• основные варианты расчетов экономических показателей;</li> <li>• показатели, характеризующие рост производительности труда и рост заработной платы компаний в рыночной экономике.</li> </ul> <p><b>Умеет верно и в полном объеме:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• проводить обоснование правильности выбора сбора экономических и социально-экономических показателей;</li> <li>• анализировать экономические и социально-экономические показатели;</li> </ul>

			<ul style="list-style-type: none"> <li>• делать выводы и обосновывать полученные конечные результаты;</li> </ul> <p><b>Владеет навыками верно и в полном объеме:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• навыками работы с аналитическими данными, полученными при обосновании деятельности компании;</li> <li>• экономическими основами профессиональной деятельности.</li> </ul>
		ПК – 3	<p><b>Знает верно и в полном объеме:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• стандарты, используемые в мировом пространстве;</li> <li>• основные стандарты, действующие в России для предприятий и организаций;</li> <li>• базовые экономические понятия и стандарты, применяемые в организации;</li> <li>• объективные основы составления экономических планов;</li> <li>• основы планирования, бизнес-планирования и бюджетирования.</li> </ul> <p><b>Умеет верно и в полном объеме:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• анализировать экономические разделы планов;</li> <li>• использовать информацию, необходимую для составления различных разделов планов;</li> <li>• обосновывать расчеты, представленные в отдельных разделах плана;</li> <li>• принимать обоснованные решения и применять стандарты в профессиональной сфере;</li> <li>• решать типичные задачи, связанные с составлением планов и применять их при решении созданные в организации стандарты;</li> <li>• собирать экономическую информацию используя ее при составлении экономических разделов планов.</li> </ul> <p><b>Владеет навыками верно и в полном объеме:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• методами экономических расчетов для составления планов, согласно стандартам компании.</li> </ul>
70 – 84 баллов	«хорошо»	ОПК-2	<p><b>Знает с незначительными замечаниями:</b></p> <p>технологии сбора и обработки данных о финансовой деятельности компании; основы финансового анализа деятельности и эффективности использования капитала компании. процесс сбора финансово-</p>

			<p>экономической, статистической и бухгалтерской информации; возможность обработки собранной информации при помощи информационных технологий и различных финансово-бухгалтерских программ; варианты финансово-экономического анализа при решении вопросов профессиональной деятельности</p> <p><b>Умеет с незначительными замечаниями:</b>  осуществлять поиск и сбор финансовой информации по полученному заданию; анализировать данные, необходимые для проведения конкретных финансовых расчетов. определять ценность сбора, анализа и обработки собранной финансово-экономической информации; соотносить собираемость информации на определенную дату и проводя анализ данных использовать различные методы статистической обработки; определять ценность сбора, анализа и обработки собранной финансово-экономической информации; соотносить собираемость информации на определенную дату и проводя анализ данных использовать различные методы статистической обработки; анализировать многообразие собранных данных и приводить их к определенному результату для обоснования экономического роста; оценивать роль собранных данных для расчета каждого экономического показателя; анализировать многообразие собранных данных и приводить их к определенному результату для обоснования экономического роста; оценивать роль собранных данных для расчета каждого экономического показателя</p> <p><b>Владеет навыками с незначительными замечаниями:</b>  современными техническими средствами обработки данных для анализа финансового состояния компании; современными методиками расчета и анализа финансовых показателей деятельности компании; навыками статистического, сравнительно-финансового анализа для определения места профессиональной деятельности в экономической парадигме; приемами анализа сложных социально-экономических показателей; навыками составления пояснения и объяснения изменения показателей, после проведенного сбора и анализа данных</p>
		ОПК-3	<p><b>Знает с незначительными замечаниями:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• инструментальные средства для разработки долгосрочной и краткосрочной финансовой политики компании;</li> </ul> <p><b>Умеет с незначительными замечаниями:</b></p>

			<ul style="list-style-type: none"> <li>оценить эффективность инвестиционных проектов;</li> <li>определить оптимальную структуру источников финансирования инвестиционных проектов и текущих активов;</li> <li>избрать рациональный тип дивидендной политики;</li> <li>определить ценовую политику компании;</li> <li>управлять кредиторской задолженностью</li> </ul> <p><b>Владеет навыками с незначительными замечаниями:</b> практическими навыками разработки долгосрочной и краткосрочной финансовой политики;</p>
		ОПК-4	<p><b>Знает с незначительными замечаниями:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>основные этапы разработки, принятия и реализации организационно-управленческих решений;</li> <li>требования экономической эффективности принимаемых организационно-управленческих решений</li> </ul> <p><b>Умеет с незначительными замечаниями:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>выбирать и применять, в зависимости от целей, задач и ситуации, методы и средства разработки и принятия коллективных и индивидуальных организационно-управленческих решений</li> <li>определять ответственность за реализацию организационно-управленческих решений с позиций их экономической эффективности.</li> </ul> <p><b>Владеет навыками с незначительными замечаниями:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>навыками аргументации предлагаемых управленческих решений в области управления финансами компании;</li> <li>методами и приемами реализации управленческих решений в финансовой сфере.</li> </ul>
		ПК-1	<p><b>Знает с незначительными замечаниями:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>основные экономические и социально-экономические показатели, применяемые для характеристики компании;</li> <li>основные варианты расчетов экономических показателей;</li> <li>показатели, характеризующие рост производительности труда и рост</li> </ul>

			<p>заработной платы компаний в рыночной экономике.</p> <p><b>Умеет с незначительными замечаниями:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• проводить обоснование правильности выбора сбора экономических и социально-экономических показателей;</li> <li>• анализировать экономические и социально-экономические показатели;</li> <li>• делать выводы и обосновывать полученные конечные результаты;</li> </ul> <p><b>Владеет навыками с незначительными замечаниями:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• навыками работы с аналитическими данными, полученными при обосновании деятельности компании;</li> <li>• экономическими основами</li> <li>• профессиональной деятельности.</li> </ul>
		ПК-3	<p><b>Знает с незначительными замечаниями:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• стандарты, используемые в мировом пространстве;</li> <li>• основные стандарты, действующие в России для предприятий и организаций;</li> <li>• базовые экономические понятия и стандарты, применяемые в организации;</li> <li>• объективные основы составления экономических планов;</li> <li>• основы планирования, бизнес-планирования и бюджетирования.</li> </ul> <p><b>Умеет с незначительными замечаниями:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• анализировать экономические разделы планов;</li> <li>• использовать информацию, необходимую для составления различных разделов планов;</li> <li>• обосновывать расчеты, представленные в отдельных разделах плана;</li> <li>• принимать обоснованные решения и применять стандарты в профессиональной сфере;</li> <li>• решать типичные задачи, связанные с составлением планов и применять их при решении созданные в организации стандарты;</li> <li>• собирать экономическую информацию используя ее при составлении экономических разделов планов.</li> </ul> <p><b>Владеет навыками с незначительными замечаниями:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• методами экономических расчетов для составления планов, согласно стандартам компании.</li> </ul>

50 – 69 баллов	«удовлетвори- тельно»	ОПК-2	<p><b>Знает на базовом уровне, с ошибками:</b> технологии сбора и обработки данных о финансовой деятельности компании; основы финансового анализа деятельности и эффективности использования капитала компании. процесс сбора финансово-экономической, статистической и бухгалтерской информации; возможность обработки собранной информации при помощи информационных технологий и различных финансово-бухгалтерских программ; варианты финансово-экономического анализа при решении вопросов профессиональной деятельности</p> <p><b>Умеет на базовом уровне, с ошибками:</b> осуществлять поиск и сбор финансовой информации по полученному заданию; анализировать данные, необходимые для проведения конкретных финансовых расчетов. определять ценность сбора, анализа и обработки собранной финансово-экономической информации; соотносить собираемость информации на определенную дату и проводя анализ данных использовать различные методы статистической обработки; определять ценность сбора, анализа и обработки собранной финансово-экономической информации; соотносить собираемость информации на определенную дату и проводя анализ данных использовать различные методы статистической обработки; анализировать многообразие собранных данных и приводить их к определенному результату для обоснования экономического роста; оценивать роль собранных данных для расчета каждого экономического показателя; анализировать многообразие собранных данных и приводить их к определенному результату для обоснования экономического роста; оценивать роль собранных данных для расчета каждого экономического показателя</p> <p><b>Владеет на базовом уровне, с ошибками:</b> современными техническими средствами обработки данных для анализа финансового состояния компании; современными методиками расчета и анализа финансовых показателей деятельности компании; навыками статистического, сравнительно-финансового анализа для определения места профессиональной деятельности в экономической парадигме; приемами анализа сложных социально-экономических показателей; навыками</p>

			составления пояснения и объяснения изменения показателей, после проведенного сбора и анализа данных
		ОПК-3	<p><b>Знает на базовом уровне, с ошибками:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>инструментальные средства для разработки долгосрочной и краткосрочной финансовой политики компании;</li> </ul> <p><b>Умеет на базовом уровне, с ошибками:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>оценить эффективность инвестиционных проектов;</li> <li>определить оптимальную структуру источников финансирования инвестиционных проектов и текущих активов;</li> <li>избрать рациональный тип дивидендной политики;</li> <li>определить ценовую политику компании;</li> <li>управлять кредиторской задолженностью</li> </ul> <p><b>Владет на базовом уровне, с ошибками:</b> практическими навыками разработки долгосрочной и краткосрочной финансовой поли-тики;</p>
		ОПК-4	<p><b>Знает на базовом уровне, с ошибками:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>основные этапы разработки, принятия и реализации организационно-управленческих решений;</li> <li>требования экономической эффективности принимаемых организационно-управленческих решений</li> </ul> <p><b>Умеет на базовом уровне, с ошибками:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>выбирать и применять, в зависимости от целей, задач и ситуации, методы и средства разработки и принятия коллективных и индивидуальных организационно-управленческих решений</li> <li>определять ответственность за реализацию организационно-управленческих решений с позиций их экономической эффективности.</li> </ul> <p><b>Владет на базовом уровне, с ошибками:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>навыками аргументации предлагаемых управленческих решений в области управления финансами компании;</li> <li>методами и приемами реализации управленческих решений в финансовой сфере.</li> </ul>

		ПК-1	<p><b>Знает на базовом уровне, с ошибками:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• основные экономические и социально-экономические показатели, применяемые для характеристики компании;</li> <li>• основные варианты расчетов экономических показателей;</li> <li>• показатели, характеризующие рост производительности труда и рост заработной платы компаний в рыночной экономике.</li> </ul> <p><b>Умеет на базовом уровне, с ошибками:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• проводить обоснование правильности выбора сбора экономических и социально-экономических показателей;</li> <li>• анализировать экономические и социально-экономические показатели;</li> <li>• делать выводы и обосновывать полученные конечные результаты;</li> </ul> <p><b>Владет на базовом уровне, с ошибками:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• навыками работы с аналитическими данными, полученными при обосновании деятельности компании;</li> <li>• экономическими основами</li> <li>• профессиональной деятельности.</li> </ul>
		ПК-3	<p><b>Знает на базовом уровне, с ошибками:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• стандарты, используемые в мировом пространстве;</li> <li>• основные стандарты, действующие в России для предприятий и организаций;</li> <li>• базовые экономические понятия и стандарты, применяемые в организации;</li> <li>• объективные основы составления экономических планов;</li> <li>• основы планирования, бизнес-планирования и бюджетирования.</li> </ul> <p><b>Умеет на базовом уровне, с ошибками:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• анализировать экономические разделы планов;</li> <li>• использовать информацию, необходимую для составления различных разделов планов;</li> <li>• обосновывать расчеты, представленные в отдельных разделах плана;</li> <li>• принимать обоснованные решения и применять стандарты в профессиональной сфере;</li> <li>• решать типичные задачи, связанные с составлением планов и применять их при решении созданные в организации стандарты;</li> </ul>

			<ul style="list-style-type: none"> <li>• собирать экономическую информацию используя ее при составлении экономических разделов планов.</li> </ul> <p><b>Владеет на базовом уровне, с ошибками:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• методами экономических расчетов для составления планов, согласно стандартам компании.</li> </ul>
менее 50 баллов	«неудовлетворительно»	ОПК-2	<p><b>Не знает на базовом уровне:</b> технологии сбора и обработки данных о финансовой деятельности компании; основы финансового анализа деятельности и эффективности использования капитала компании. процесс сбора финансово-экономической, статистической и бухгалтерской информации; возможность обработки собранной информации при помощи информационных технологий и различных финансово-бухгалтерских программ; варианты финансово-экономического анализа при решении вопросов профессиональной деятельности</p> <p><b>Не умеет на базовом уровне:</b> осуществлять поиск и сбор финансовой информации по полученному заданию; анализировать данные, необходимые для проведения конкретных финансовых расчетов. определять ценность сбора, анализа и обработки собранной финансово-экономической информации; соотносить собираемость информации на определенную дату и проводя анализ данных использовать различные методы статистической обработки; определять ценность сбора, анализа и обработки собранной финансово-экономической информации; соотносить собираемость информации на определенную дату и проводя анализ данных использовать различные методы статистической обработки; анализировать многообразие собранных данных и приводить их к определенному результату для обоснования экономического роста; оценивать роль собранных данных для расчета каждого экономического показателя; анализировать многообразие собранных данных и приводить их к определенному результату для обоснования экономического роста; оценивать роль собранных данных для расчета каждого экономического показателя</p> <p><b>Не владеет на базовом уровне:</b> современными техническими средствами обработки данных для анализа финансового состояния компании; современными методиками расчета и анализа финансовых показателей деятельности компании; навыками статистического, сравнительно-финансового анализа для определения места профессиональной</p>

			<p>деятельности в экономической парадигме; приемами анализа сложных социально-экономических показателей; навыками составления пояснения и объяснения изменения показателей, после проведенного сбора и анализа данных</p>
		ОПК-3	<p><b>Не знает на базовом уровне:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>инструментальные средства для разработки долгосрочной и краткосрочной финансовой политики компании;</li> </ul> <p><b>Не умеет на базовом уровне:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>оценить эффективность инвестиционных проектов;</li> <li>определить оптимальную структуру источников финансирования инвестиционных проектов и текущих активов;</li> <li>избрать рациональный тип дивидендной политики;</li> <li>определить ценовую политику компании;</li> <li>управлять кредиторской задолженностью</li> </ul> <p><b>Не владеет на базовом уровне:</b> практическими навыками разработки долгосрочной и краткосрочной финансовой политики;</p>
		ОПК-4	<p><b>Не знает на базовом уровне:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>основные этапы разработки, принятия и реализации организационно-управленческих решений;</li> <li>требования экономической эффективности принимаемых организационно-управленческих решений</li> </ul> <p><b>Не умеет на базовом уровне:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>выбирать и применять, в зависимости от целей, задач и ситуации, методы и средства разработки и принятия коллективных и индивидуальных организационно-управленческих решений</li> <li>определять ответственность за реализацию организационно-управленческих решений с позиций их экономической эффективности.</li> </ul> <p><b>Не владеет на базовом уровне:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>навыками аргументации предлагаемых управленческих решений в области управления финансами компании;</li> </ul>

			<ul style="list-style-type: none"> <li>• методами и приемами реализации управленческих решений в финансовой сфере.</li> </ul>
		ПК-1	<p><b>Не знает на базовом уровне:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• основные экономические и социально-экономические показатели, применяемые для характеристики компании;</li> <li>• основные варианты расчетов экономических показателей;</li> <li>• показатели, характеризующие рост производительности труда и рост заработной платы компаний в рыночной экономике.</li> </ul> <p><b>Не умеет на базовом уровне:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• проводить обоснование правильности выбора сбора экономических и социально-экономических показателей;</li> <li>• анализировать экономические и социально-экономические показатели;</li> <li>• делать выводы и обосновывать полученные конечные результаты;</li> </ul> <p><b>Не владеет на базовом уровне:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• навыками работы с аналитическими данными, полученными при обосновании деятельности компании;</li> <li>• экономическими основами</li> <li>• профессиональной деятельности.</li> </ul>
		ПК-3	<p><b>Не знает на базовом уровне:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• стандарты, используемые в мировом пространстве;</li> <li>• основные стандарты, действующие в России для предприятий и организаций;</li> <li>• базовые экономические понятия и стандарты, применяемые в организации;</li> <li>• объективные основы составления экономических планов;</li> <li>• основы планирования, бизнес-планирования и бюджетирования.</li> </ul> <p><b>Не умеет на базовом уровне:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• анализировать экономические разделы планов;</li> <li>• использовать информацию, необходимую для составления различных разделов планов;</li> <li>• обосновывать расчеты, представленные в отдельных разделах плана;</li> <li>• принимать обоснованные решения и применять стандарты в профессиональной сфере;</li> </ul>

			<ul style="list-style-type: none"> <li>• решать типичные задачи, связанные с составлением планов и применять их при решении созданные в организации стандарты;</li> <li>• собирать экономическую информацию используя ее при составлении экономических разделов планов.</li> </ul> <p><b>Не владеет на базовом уровне:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• методами экономических расчетов для составления планов, согласно стандартам компании.</li> </ul>
--	--	--	--

**Карта обеспеченности дисциплины «Финансовый риск-менеджмент»  
учебными изданиями и иными информационно-библиотечными ресурсами**

Кафедра Экономических наук

ОПОП ВО по направлению подготовки 38.03.01 Экономика

Уровень подготовки бакалавриат

(бакалавриат, специалитет, магистратура)

Направленность (профиль) образовательной программы «Финансы и банковское дело»

№п/п	Наименование, автор	Выходные данные	Информация по НИБЦ им. академика Л.И. Абалкина		Количество экземпляров на кафедре (в лаборатории) (шт.)	Числен- ность студентов (чел.) <sup>1</sup>	Показатель обеспеченности студентов литературой: = 1 (при наличии в ЭБС); или =(колонка 4/ колонка 7) (при отсутствии в ЭБС)
			количество печатных экземпляров (шт.) <sup>2</sup>	наличие в ЭБС (да/нет), название ЭБС <sup>3</sup>			
1	2	3	4	5	6	7	8
1	Финансовый менеджмент: учебник / Шохин Е.И. под ред. и др.	Москва: КноРус, 2017. — 474 с. — (для бакалавров). — ISBN 978-5-406-05520-5. — ULR: <a href="https://book.ru/book/920293">https://book.ru/book/920293</a>	x	да, ЭБС « book.ru»	x	x	1
2	Капустина, Н. В. Развитие организации на основе риск-менеджмента: теория, методология и практика: Монография / Н.В. Капустина.	Москва: НИЦ ИНФРА-М, 2014. - 178 с. + (Доп. мат. znanium.com). - (Научная мысль). ISBN 978-5-16-010571-0. – ULR: <a href="https://znanium.com/catalog/product/494325">https://znanium.com/catalog/product/494325</a>	x	да, ЭБС «Znanium»	x	x	1

<sup>1</sup> Контингент студентов приводится при наличии издания в печатном виде; если издание только в ЭБС – контингент студентов не указывается;

<sup>2</sup> При указании печатных экземпляров издания необходимо учитывать требования ФГОС ВО (основная литература – 0,5 экз. на 1 студента, дополнительная литература – 0,25 экз. на 1 студента);

<sup>3</sup> Все перечисленные издания необходимо в первую очередь выбирать из ЭБС;

3	Домащенко, Д. В. Современные подходы к корпоративному риск-менеджменту: методы и инструменты / Домащенко Д.В., Финогенова Ю.Ю.	Москва: Магистр, НИЦ ИНФРА-М, 2016. - 304 с. ISBN 978-5-9776-0427-7. - ULR: <a href="https://znanium.com/catalog/product/550188">https://znanium.com/catalog/product/550188</a>	x	да, ЭБС Znanium	x	x	1
	Всего						
<b>Дополнительная литература:</b>							
1	Савицкая, Г. В. Анализ эффективности и рисков предпринимательской деятельности: методологические аспекты: монография / Г.В. Савицкая. — <a href="http://www.dx.doi.org/10.12737/23374">www.dx.doi.org/10.12737/23374</a> . -	2-е изд., перераб. и доп. — Москва: ИНФРА-М, 2017. — 291 с. — (Научная мысль). — ISBN 978-5-16-105335-5. - ULR: <a href="https://znanium.com/catalog/product/701842">https://znanium.com/catalog/product/701842</a>	x	да, ЭБС Znanium	x	x	1
2	Макарова, С. Н. Управление финансовыми рисками: монография / С. Н. Макарова, И. С. Ферова, И. А. Янкина.	Красноярск: СФУ, 2014. - 230 с. - ISBN 978-5-7638-3139-9. - ULR: <a href="https://znanium.com/catalog/product/549466">https://znanium.com/catalog/product/549466</a>	x	да, ЭБС Znanium	x	x	1
3	Локтионова, Ю.Н. Основы финансового менеджмента: учебное пособие / Локтионова Ю.Н., и др..	— Москва: Русайнс, 2017. — 141 с. — ISBN 978-5-4365-1614-1. - ULR: <a href="https://book.ru/book/922647">https://book.ru/book/922647</a>	x	да, ЭБС «book.ru»	x	x	1
	Всего						

№п/п	Наименование, автор	Выходные данные	Информация по НИБЦ им. академика Л.И. Абалкина		Количество экземпляров на кафедре (шт.)	Численность студентов (чел.)	Показатель обеспеченности студентов литературой: = 1 (при наличии в ЭБС); или =(колонка 4/ колонка 7) (при отсутствии в ЭБС)
			количество печатных экземпляров (шт.)	наличие в ЭБС (да/нет), название ЭБС			
1	2	3	4	5	6	7	8
<b>Основная литература</b>							
1	Финансовый менеджмент: учебник для академического бакалавриата / Г. Б. Поляк [и др.]; ответственный редактор Г. Б. Поляк. — 4-е изд., перераб. и доп.	Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 456 с. — (Авторский учебник). — ISBN 978-5-9916-4395-5.- ULR: <a href="https://urait.ru/bcode/444149">https://urait.ru/bcode/444149</a>	х	Да, ЭБС « urait.ru »	х	×	1
2	Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент : учебник для бакалавров / А. Н. Фомичев. - 7-е изд.	Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2020. - 372 с. - ISBN 978-5-394-03820-4. - ULR: <a href="https://znanium.com/catalog/product/1091116">https://znanium.com/catalog/product/1091116</a>	х	Да, ЭБС «znanium.com»	х	×	1
<b>Всего</b>							

Заведующий кафедрой



(подпись)

Искаджян С.О

(Ф.И.О.)

