

Министерство науки и высшего образования РФ
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«СИБИРСКИЙ ФЕДЕРАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»
РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Б1.В.ДВ.12.03 Цифровые технологии управления
финансовыми рисками

наименование дисциплины (модуля) в соответствии с учебным планом

Направление подготовки / специальность

38.03.02 Менеджмент

Направленность (профиль)

38.03.02 Менеджмент

Форма обучения

очная

Год набора

2022

Красноярск 2023

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Программу составили _____

канд.экон.наук, Доцент, Зубова Марина Витальевна

должность, инициалы, фамилия

1 Цели и задачи изучения дисциплины

1.1 Цель преподавания дисциплины

Целью изучения дисциплины «Цифровые технологии управления финансовыми рисками», является приобретение студентами знаний, умений и навыков для качественной и количественной оценки финансовых рисков и управления ими в процессе осуществления финансово-хозяйственной деятельности экономических субъектов с использованием программных пакетов «Альт-Инвест», «Альт-Финансы», «Project Expert».

1.2 Задачи изучения дисциплины

Задачи изучения дисциплины «Цифровые технологии управления финансовыми рисками» включают:

ознакомление с основными понятиями управления финансовыми рисками;

изучение методов анализа финансовых рисков;

овладение теоретическими и практическими навыками организации работ по управлению финансовыми рисками;

формирование навыков управления финансовыми рисками с использованием цифровых технологий.

формирование навыков самостоятельного и творческого использования полученных знаний в практической деятельности.

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

Код и наименование индикатора достижения компетенции	Запланированные результаты обучения по дисциплине
ПК-2: Способность осуществлять планирование деятельности организации на основе выявления возможностей повышения эффективности управления с использованием современных информационных технологий	
ПК-2.1: Знать методы ведения плановой работы, подготовки комплексных планов деятельности организации и структурных подразделений, технико-экономический анализ, алгоритм постановки задач, решаемых с помощью вычислительной техники	

<p>ПК-2.2: Уметь: организовывать работу по тактическому планированию деятельности исходя из конкретных условий и потребностей рынка, выявлять, анализировать и использовать резервы</p>	
<p>производства с помощью современных информационных технологий</p>	
<p>ПК-2.3: Владеть инструментами планирования деятельности организации, методами управления и выявления возможностей повышения эффективности управления, разработки рекомендаций по использованию научно- обоснованных методов комплексного решения задач планирования с применением современных информационных технологий</p>	

1.4 Особенности реализации дисциплины

Язык реализации дисциплины: Русский.

Дисциплина (модуль) реализуется с применением ЭО и ДОТ

URL-адрес и название электронного обучающего курса: .

2. Объем дисциплины (модуля)

Вид учебной работы	Всего, зачетных единиц (акад. час)	е
		1
Контактная работа с преподавателем:	1,5 (54)	
практические занятия	1,5 (54)	
Самостоятельная работа обучающихся:	1,5 (54)	
курсовое проектирование (КП)	Нет	
курсовая работа (КР)	Нет	
Промежуточная аттестация (Экзамен)	1 (36)	

3 Содержание дисциплины (модуля)

3.1 Разделы дисциплины и виды занятий (тематический план занятий)

		Контактная работа, ак. час.							
№ п/п	Модули, темы (разделы) дисциплины	Занятия лекционного типа		Занятия семинарского типа				Самостоятельная работа, ак. час.	
				Семинары и/или Практические занятия		Лабораторные работы и/или Практикумы			
		Всего	В том числе в ЭИОС	Всего	В том числе в ЭИОС	Всего	В том числе в ЭИОС	Всего	В том числе в ЭИОС
1. Неопределенность и риск: общие понятия, принципы и базовые концепции риск-менеджмента в современных рыночных									
	1. Тема 1.1 Общие понятия и определения Тема 1.2 Классификация рисков. Критерии классификации по характеристике опасности. Критерии классификации по характеристике подверженности риску. Критерии классификации по характеристике уязвимости, по характеристике взаимодействия с другими рисками, имеющейся информации о риске, по величине риска, по характеристике расходов, связанных с риском. Специфические классификации рисков Тема 1.3 Система управления риском. Определение управления риском. Общая характеристика системы управления риском. Управление риском, как часть общего менеджмента фирмы. Цели и задачи системы управления риском. Ограничения системы управления риском. Прочие принципы управления риском. Этапы управления риском.			4					

2. Идентификация рисков. Тестирование по теме			4					
3. Система управления риском.							10	
2. Методы анализа финансовых рисков предприятия								
1. Тема 2.1 Сущность анализа финансовых рисков предприятия. Премия за риск. Куммулятивный метод оценки премии за риск. Модель оценки капитальных активов. Расчет нормы дисконта как средневзвешенной цены капитала. Метод скорректированной текущей стоимости. Тема 2.1 Качественный анализ рисков Тема 2.3 Количественный анализ рисков.			6					
2. Методы анализа финансовых рисков			12					
3. 1. Общая характеристика информации по управлению риском. 2. Основные принципы оценки риска							20	
3. Организация работ по управлению финансовыми рисками								
1. Тема 3.1 Методы управления риском. Методы трансформации рисков. Методы финансирования рисков 3.2 Программа управления риском. Процедуры разработки, контроля и пересмотра программы управления риском			4					
2. Методы трансформации рисков. Методы финансирования рисков			8					
3. Организация работ по управлению финансовыми рисками							25	
4. Компьютерные технологии в анализе рисков (программные пакеты «Альт-Инвест», «Альт-Финансы», «Project Expert»)								

1. Программный пакет «Альт-Инвест». Анализ рисков проекта: выявление рисков и их описание. Моделирование рисков: определение ключевых факторов, анализ чувствительности, сценарный анализ, стресс-тесты.			4					
2. Разбор реального проекта: анализ рисков проекта: выявление ключевых рисков, анализ чувствительности, сценарный анализ проекта			12					
3. Программные пакеты «Альт-Финансы», «Project Expert»							35	
Всего			54				90	

4 Учебно-методическое обеспечение дисциплины

4.1 Печатные и электронные издания:

1. Рыхтикова Н. А. Анализ и управление рисками организации: Учебное пособие(Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М").
2. Уродовских В.Н. Управление рисками предприятия: Учебное пособие (Москва: Вузовский учебник).
3. Каранина Е. В. Управление финансовыми рисками. Стратегические модели и профессиональные стандарты: Учебное пособие(Санкт-Петербург: Интермедия).
4. Антонов Г. Д., Иванова О. П. Управление рисками организации: Учебник(Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М").
5. Чернова Г. В., Кудрявцев А. А. Управление рисками: учебное пособие для вузов по специальностям "Финансы и кредит", "Бухгалтерский учет, анализ и аудит", "Мировая экономика"(Москва: Проспект).
6. Рогов В. А., Чудаков А. Д. Управление рисками: учебное пособие; рекомендовано УМО АМ(Старый Оскол: ТНТ).
7. Чернова Г. В. Страхование и управление рисками: учебник для бакалавров(М.: Юрайт).
8. Кузьминова Н. В. Управление рисками на промышленных предприятиях (Владимир: Владимирское книжное издательство "Собор").
9. Москвин В.А. Управление рисками при реализации инвестиционных проектов: Рекомендации для предприятий и коммерческих банков(М.: Финансы и статистика).
10. Серебрякова Т.Ю. Риски организации и внутренний экономический контроль: Монография(Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М").
11. Бородавко Л. С. Управление финансовыми рисками организации: монография(Иркутск: ИрГУПС).
12. Макарова С. Н., Ферова И. С., Янкина И. А. Управление финансовыми рисками: монография(Красноярск: СФУ).
13. Конищева М.А. Управление финансовыми рисками: [учеб-метод. материалы к изучению дисциплины для ...38.03.01.04.07 Финансы и кредит (финансы организаций)](Красноярск: СФУ).
14. Управление финансовыми рисками и страхование: методические указания(Иркутск: ИрГУПС).

4.2 Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в том числе отечественного производства (программное обеспечение, на которое университет имеет лицензию, а также свободно распространяемое программное обеспечение):

1. Microsoft Word;
2. Microsoft Excel;
3. Microsoft Power Point

4.3 Интернет-ресурсы, включая профессиональные базы данных и информационные справочные системы:

1. Консультант+

5 Фонд оценочных средств

Оценочные средства находятся в приложении к рабочим программам дисциплин.

6 Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)

Аудитория для проведения лекционных и семинарских занятий, оборудованная классной доской и розетками для подключения электрооборудования и / или мультимедийным проектором с настенной доской; для практических занятий компьютеры с доступом в Интернет; библиотечный фонд университета на бумажных и электронных носителях.