

Министерство науки и высшего образования РФ  
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение  
высшего образования  
«СИБИРСКИЙ ФЕДЕРАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

**СОГЛАСОВАНО**

Заведующий кафедрой

Кафедра экономики и  
управления бизнес-процессами

наименование кафедры

подпись, инициалы, фамилия

«\_\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

институт, реализующий ОП ВО

**УТВЕРЖДАЮ**

Заведующий кафедрой

Кафедра экономики и управления  
бизнес-процессами

наименование кафедры

**З.А. Васильева**

подпись, инициалы, фамилия

«\_\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

институт, реализующий дисциплину

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ  
ФИНАНСОВЫЕ РИСКИ**

Дисциплина Б1.В.01 Финансовые риски

Направление подготовки / 38.04.01 Экономика программа  
специальность магистерской подготовки 38.04.01.01

Направленность Управление финансами производственных  
(профиль)

Форма обучения очная

Год набора 2020

Красноярск 2021

## **РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

составлена в соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по укрупненной группе

380000 «ЭКОНОМИКА И УПРАВЛЕНИЕ»

---

Направление подготовки /специальность (профиль/специализация)

Направление 38.04.01 Экономика программа магистерской подготовки

38.04.01.01 Управление финансами производственных комплексов

---

Программу  
составили \_\_\_\_\_

## 1 Цели и задачи изучения дисциплины

### 1.1 Цель преподавания дисциплины

Целью изучения дисциплины является формирование у магистров системы специальных знаний в области теории и практики по экономической оценке рисков, в т.ч. проведении профилактики, контроля и управления рисками, возникающими в деятельности предприятия в рыночных условиях хозяйствования..

### 1.2 Задачи изучения дисциплины

Задачами изучения дисциплины является:

- формирование у студентов представления о сущности и видах рисков, с которыми сталкивается бизнес;
- формирование у студентов навыков оценки и анализа рисков;
- формирование у студентов знаний о методах управления рисками.
- сформировать представление о механизмах и институтах регулирования финансовых рисков,
- получить представление о методах снижения финансовых рисков.

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

<b>ПК-6: способностью оценивать эффективность проектов с учетом фактора неопределенности</b>	
Уровень 1	теоретические и методологические основы анализа финансовых рисков
Уровень 2	содержание, стратегии и приемы управления рисками в предпринимательской деятельности
Уровень 3	схему и методы анализа и оценки рисков
Уровень 1	формулировать цели и разработать стратегии управления финансовыми рисками в предпринимательской деятельности
Уровень 2	идентифицировать, анализировать и оценивать риск и степень его влияния на эффективность реализации управленческих решений
Уровень 3	управлять риском, используя различные методики и приемы, определять привлекательность инвестиционного портфеля
Уровень 1	методами и приемами анализа и оценки финансовых рисков
Уровень 2	навыками выбора и применения инструментальных средств для

	обработки экономических данных
Уровень 3	навыками анализа финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий (организаций) и использования полученных сведений для принятия рискованных управленческих решений

#### 1.4 Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Дисциплина «Финансовые риски» относится к обязательным дисциплинам базовой части ОП магистратуры направления «Экономика» и изучается магистрантами в соответствии с учебным планом образовательной программы магистратуры во втором семестре.

Для успешного формирования и развития системы профессиональных компетенций по магистерской программе изучение дисциплины «Финансовые риски» основывается на компетенциях, сформированных в дисциплинах «Финансовое законодательство», «Инвестиционная стратегия предприятия», «Современные методы учета и налогообложения», «Финансовое планирование и прогнозирование», «Международные стандарты финансовой отчетности», «Современные технологии финансового менеджмента».

Усвоенные знания и умения по дисциплине «Финансовые риски» являются важным условием для успешного изучения дисциплин «Современные эконометрические методы», «Антикризисные стратегии», «Устойчивое развитие предприятия», «Финансовый анализ», «Финансовый контроль и аудит», «Страхование», выполнения научно-исследовательской работы и защиты магистерской диссертации.

#### 1.5 Особенности реализации дисциплины

Язык реализации дисциплины Русский.

Дисциплина (модуль) реализуется без применения ЭО и ДОТ.

## 2. Объем дисциплины (модуля)

Вид учебной работы	Всего, зачетных единиц (акад.час)	Семестр
		2
<b>Общая трудоемкость дисциплины</b>	<b>2 (72)</b>	<b>2 (72)</b>
<b>Контактная работа с преподавателем:</b>	<b>1 (36)</b>	<b>1 (36)</b>
занятия лекционного типа	0,33 (12)	0,33 (12)
занятия семинарского типа		
в том числе: семинары		
практические занятия	0,67 (24)	0,67 (24)
практикумы		
лабораторные работы		
другие виды контактной работы		
в том числе: групповые консультации		
индивидуальные консультации		
иная внеаудиторная контактная работа:		
групповые занятия		
индивидуальные занятия		
<b>Самостоятельная работа обучающихся:</b>	<b>1 (36)</b>	<b>1 (36)</b>
изучение теоретического курса (ТО)		
расчетно-графические задания, задачи (РГЗ)		
реферат, эссе (Р)		
курсовое проектирование (КП)	Нет	Нет
курсовая работа (КР)	Нет	Нет
<b>Промежуточная аттестация (Зачёт)</b>		

### 3 Содержание дисциплины (модуля)

#### 3.1 Разделы дисциплины и виды занятий (тематический план занятий)

№ п/п	Модули, темы (разделы) дисциплины	Занятия лекционного типа (акад. час)	Занятия семинарского типа		Самостоятельная работа, (акад. час)	Формируемые компетенции
			Семинары и/или Практические занятия (акад. час)	Лабораторные работы и/или Практикумы (акад. час)		
1	2	3	4	5	6	7
1	Финансовые риски и методы их оценки	4	8	0	12	ПК-6
2	Оценка активов и стили инвестиций в них	4	8	0	12	ПК-6
3	Управление финансовыми рисками	4	8	0	12	ПК-6
Всего		12	24	0	36	

#### 3.2 Занятия лекционного типа

№ п/п	№ раздела дисциплины	Наименование занятий	Объем в акад. часах		
			Всего	в том числе, в инновационной форме	в том числе, в электронной форме
1	1		4	0	0
2	2		4	0	0
3	3		4	0	0
Всего			12	0	0

#### 3.3 Занятия семинарского типа

№ п/п	№ раздела дисциплины	Наименование занятий	Объем в акад. часах		
			Всего	в том числе, в инновационной форме	в том числе, в электронной форме
1	1		8	0	0

2	2		8	0	0
3	3		8	0	0
Всего			24	0	0

### 3.4 Лабораторные занятия

№ п/п	№ раздела дисциплины	Наименование занятий	Объем в акад. часах		
			Всего	в том числе, в инновационной форме	в том числе, в электронной форме
Всего					

## 5 Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации

Оценочные средства находятся в приложении к рабочим программам дисциплин.

## 6 Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

6.1. Основная литература			
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л1.1	Уколов А. И., Гупалова Т. Н.	Управление корпоративными рисками: инструменты хеджирования: учебное пособие	Москва: Директ-Медиа, 2014
6.2. Дополнительная литература			
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Макарова С. Н., Ферова И. С., Янкина И. А.	Управление финансовыми рисками: монография	Красноярск: СФУ, 2014

## 8 Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

Целесообразен следующий механизм самостоятельной работы:

1. Прежде чем приступить к освоению курса, внимательно изучите содержание и структуру рабочей программы по данной дисциплине.

2. Имея рабочую программу по дисциплине, перед лекцией прочтите и уясните ее название и содержание.

3. Прочтите конспект прослушанной лекции, а также основную и дополнительную литературу по теме.

4. Изложите свое понимание темы.

5. Выявите дискуссионные вопросы и сформулируйте свою точку

зрения на них, аргументируя ее.

6. После ознакомления с теоретическим материалом ответьте на вопросы для самопроверки.

7. Закрепление материала проводится на семинарских занятиях или в результате самостоятельной работы. Каждая тема курса должна быть проработана студентом в той или иной форме.

Самостоятельная работа предполагает ориентацию на активные методы владения знаниями, развитие творческих способностей студентов, переход от поточного к индивидуализированному обучению с учетом потребностей и возможностей личности. Усиление роли самостоятельной работы означает развитие умения учиться, формирование у обучаемых способности к саморазвитию, творческому применению полученных знаний, способам адаптации к профессиональной деятельности в современном мире.

Самостоятельная работа реализуется:

1. Непосредственно в процессе аудиторных занятий: на лекциях, практических и семинарских занятиях.

2. В контакте с преподавателем вне рамок расписания – на консультациях по учебным вопросам, в ходе творческих контактов, при ликвидации задолженностей, при выполнении индивидуальных заданий и т. д.

3. В библиотеке, дома, в общежитии, на кафедре при выполнении студентом учебных и творческих задач.

Активная самостоятельная работа возможна только при наличии серьезной и устойчивой мотивации. Самый сильный мотивирующий фактор – подготовка к дальнейшей эффективной профессиональной деятельности.

Факторы, способствующие активизации самостоятельной работы, следующие:

1. Полезность выполняемой работы означает возможность ее использования в лекционном курсе, методическом пособии, лабораторном практикуме, при подготовке публикации или иным образом. Другим вариантом использования фактора полезности является активное применение результатов работы в профессиональной подготовке.

2. Участие студентов в творческой деятельности. Это может быть участие в научно-исследовательской, опытно-конструкторской или методической работе, проводимой на кафедре.

3. Важным мотивационным фактором является введение в учебный процесс активных методов, прежде всего игрового тренинга, в основе которого лежат инновационные и организационно-деятельностные игры.

4. Участие в конференциях, диспутах по учебным дисциплинам,



конкурсах научно-исследовательских или прикладных работ и т.д.

5. Использование мотивирующих факторов контроля знаний (накопительные оценки, рейтинг, тесты, нестандартные экзаменационные процедуры).

Эти факторы при определенных условиях могут вызвать стремление к состязательности, что само по себе является сильным мотивационным фактором самосовершенствования студента.

6. Поощрение студентов за успехи в учебе и творческой деятельности (стипендии, премирование, поощрительные баллы) и санкции за плохую учебу. Например, за работу, сданную раньше срока, можно проставлять повышенную оценку, а в противном случае ее снижать.

7. Индивидуализация заданий, выполняемых как в аудитории, так и вне ее стен, постоянное их обновление.

При изучении дисциплины организация СРС представляет собой единство трех взаимосвязанных форм:

1. Внеаудиторная самостоятельная работа.
2. Аудиторная самостоятельная работа, которая осуществляется под непосредственным руководством преподавателя.
3. Творческая, в том числе научно-исследовательская работа.

Студенту предоставляется право выбора темы и выполнение домашних заданий разнообразного характера. Это – подбор и изучение литературных источников; разработка и составление различных схем; проведение расчетов и прогнозов; выполнение индивидуальных заданий, направленных на развитие у студентов самостоятельности и инициативы. Такие задания может выполнять один студент или группа обучаемых; подготовка к участию в научно-теоретических конференциях, смотрах, олимпиадах.

При подготовке к семинарским занятиям необходимо:

- внимательно ознакомиться с тематикой семинара;
- прочесть конспект лекции по теме, изучить рекомендованную литературу;
- составить краткий план ответа на каждый вопрос семинарского занятия;
- проверить свои знания, отвечая на вопросы для самопроверки;
- выполнить задания (письменно) теории;
- незнакомые термины или имена найти в словаре и записать в тетрадь;
- выполнить задание по теме семинарского занятия.

Письменные задания выполняют в тетради для семинарских занятий.

## 9 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю) (при необходимости)

### 9.1 Перечень необходимого программного обеспечения

9.1.1	
9.1.2	Использование информационно – коммуникационных технологий и программного обеспечения по дисциплине осуществляется на аудиторных занятиях и при самостоятельной работе студентов.
9.1.3	Для проведения практических занятий и самостоятельной подготовки докладов студенты используют программное обеспечение WINDOWS, Microsoft Office WORD, Microsoft Office EXCEL, презентация Microsoft Office Power Point для графического построения схем, графиков, таблиц; деловые игры, ситуации.
9.1.4	В качестве наглядного материала на лекциях разработана презентация дисциплины в Microsoft Office Power Point.
9.1.5	

### 9.2 Перечень необходимых информационных справочных систем

9.2.1	1. <a href="http://www/gks.ru">www/gks.ru</a> – Россия в цифрах / официальный сайт Федеральной службы статистики
9.2.2	2. Консультант+ <a href="http://www.consultant.ru">http://www.consultant.ru</a> - Справочно-правовая система. Содержит законодательную базу, нормативно-правовое обеспечение, статьи.
9.2.3	3. <a href="http://www.ecsocman.ru/">http://www.ecsocman.ru/</a> – Федеральный образовательный портал «Экономика. Социология. Менеджмент».
9.2.4	4. <a href="http://www.biblioclub.ru">http://www.biblioclub.ru</a> – Электронная библиотечная система «Университетская библиотека онлайн» - обеспечивает доступ к наиболее востребованным материалам - первоисточникам, учебной, научной и художественной литературе ведущих издательств, содержит справочники, словари, энциклопедии.
9.2.5	5. <a href="http://www.grebennikon.ru/">http://www.grebennikon.ru/</a> – Электронная библиотека Издательского дома «Гребенников» – содержит полные тексты статей по основным вопросам экономики, менеджмента, маркетинга, финансов и другим дисциплинам.
9.2.6	6. <a href="http://www.krugosvet.ru/">http://www.krugosvet.ru/</a> – Онлайн Энциклопедия «Кругосвет» – 215 000 статей по темам: Экономика и право, Психология и педагогика, Социология, Философия, Религия, Государство и политика и др.
9.2.7	7. <a href="http://www.elibrary.ru/">http://www.elibrary.ru/</a> – Научная электронная библиотека – содержит более 12 миллионов научных публикаций, представлено 1594 российских журналов, из них в открытом доступе – 744.
9.2.8	8. <a href="http://www.ebiblioteka.ru/">http://www.ebiblioteka.ru/</a> – Универсальные базы данных изданий России и стран СНГ – содержат полные тексты статей из журналов по вопросам экономики и финансов, издания по общественным и гуманитарным наукам, официальные издания органов государственной власти РФ, Вестники Московского государственного университета и т.д..
9.2.9	9. <a href="http://www.aup.ru/">http://www.aup.ru/</a> – Административно-управленческий портал.
9.2.10	10. <a href="http://eup.ru/">http://eup.ru/</a> – Библиотека экономической и управленческой литературы.

9.2.1 1	11. <a href="http://sci-lib.com/">http://sci-lib.com/</a> - Большая научная библиотека.
9.2.1 2	12. <a href="http://www.rusrev.org/">http://www.rusrev.org/</a> - " Российское экспертное обозрение"
9.2.1 3	13. <a href="http://stat.hse.ru/">http://stat.hse.ru/</a> - База данных статистики по экономике и демографии РФ - Центр анализа данных Высшей школы экономики.
9.2.1 4	14. <a href="http://www.ptpu.ru">http://www.ptpu.ru</a> - " Проблемы теории и практики управления", электронный журнал.
9.2.1 5	15. <a href="http://www.ecsoc.msses.ru">http://www.ecsoc.msses.ru</a> - " Экономическая социология", электронный журнал. Архив отечественных и зарубежных журналов по экономике, социологии и менеджменту.
9.2.1 6	16. <a href="http://www.dis.ru">www.dis.ru</a> – сайт издательства «Дело и сервис», содержит полнотекстовые версии статей по менеджменту, маркетингу, экономике, туризму.
9.2.1 7	17. <a href="http://www.rjm.ru">www.rjm.ru</a> – сайт журнала «Российский журнал менеджмента», ведущего рецензируемого российского издания. Имеется доступ к полнотекстовым статьям.
9.2.1 8	18. <a href="http://www.rsl.ru">www.rsl.ru</a> – сайт Российской государственной библиотеки. Через сайт можно получить соответствующие ссылки на требуемые учебники, монографии, диссертации и статьи.

## **10 Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)**

Для обучения магистрантов используются необходимые для занятий лекционные аудитории, помещения для проведения семинарских и практических занятий (оборудованные учебной мебелью), ноутбук и проектор для проведения занятий, компьютеры с доступом в Интернет, доступ к справочным системам (СПС «Гарант», СПС «Консультант Плюс»); учебники, учебно-методические издания, научные труды и периодические издания; нормативно-правовые акты; локальные нормативные акты организации.

Для обучения студент магистратуры обеспечивается доступом к электронным базам данных (ресурсы удаленного доступа библиотеки).