

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

Б1.В.ДВ.07.02 Управление финансовыми рисками

наименование дисциплины (модуля) в соответствии с учебным планом

Направление подготовки / специальность

38.05.01 Экономическая безопасность

Направленность (профиль)

38.05.01.32 Финансовые и институциональные механизмы обеспечения
экономической безопасности и управления рисками

Форма обучения

очная

Год набора

2022

Красноярск 2022

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Программу составили _____

_____ канд. экон. наук, Доцент, Козлова Светлана Александровна

_____ должность, инициалы, фамилия

1 Цели и задачи изучения дисциплины

1.1 Цель преподавания дисциплины

Цели изучения дисциплины: подготовка студента к решению профессиональных задач: принятие управленческих решений, направленных на снижение рисков и потерь, повышение уровня экономической безопасности на основе оценки фактического и потенциального риска хозяйствующих субъектов.

1.2 Задачи изучения дисциплины

Задачи изучения дисциплины:

- изучить существующие методики оценки рисков;
- получить навыки проведения оценки рисков с учетом специфики деятельности экономического субъекта;
- проанализировать резервы экономического субъекта для снижения влияния рисков на его деятельность;
- проанализировать экономический эффект от мероприятий по снижению рисков и их влияние на уровень экономической безопасности;
- проанализировать подходы к риск-ориентированному контролю в деятельности органов контроля и надзора.

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-3: Способен рассчитать фактический и потенциальный риск, оценить возможные потери, определять необходимые компенсационные резервы и разрабатывать и реализовывать планы воздействия на риск, оценивать эффективность этих решений	
ПК-3.1: Оценивает фактический и потенциальный риск хозяйствующих субъектов по современным методикам	<ul style="list-style-type: none">- методики оценки рисков;- применять методики оценки фактических и потенциальных рисков в зависимости от специфики деятельности экономического субъекта, в т.ч. с применением программных продуктов;- навыками оценки потенциальных рисков хозяйствующего субъекта в зависимости от целей анализа
ПК-3.2: Определяет резервы и направления снижения риска и потерь, разрабатывает планы их реализации	<ul style="list-style-type: none">- источники резервов и направления снижения риска и потерь в зависимости от специфики деятельности организации;- определять резервы и направления снижения риска и потерь хозяйствующего субъекта количественными и качественными методами;- разрабатывать планы по снижению рисков и потерь с учетом эффективности специфики деятельности организации

ПК-3.3: Рассчитывает экономический эффект от	- методики расчета экономического эффекта от мероприятий по снижению рисков;
мероприятий по снижению риска	- применять методики расчета экономического эффекта от мероприятий по снижению рисков; - навыками представления результатов экономических расчетов заинтересованным пользователям и принятия управленческих решений по управлению рисками

1.4 Особенности реализации дисциплины

Язык реализации дисциплины: Русский.

Дисциплина (модуль) реализуется с применением ЭО и ДОТ

URL-адрес и название электронного обучающего курса: <https://e.sfu-kras.ru/course/view.php?id=22891>.

2. Объем дисциплины (модуля)

Вид учебной работы	Всего, зачетных единиц (акад. час)	е
		1
Контактная работа с преподавателем:	1 (36)	
занятия лекционного типа	0,5 (18)	
практические занятия	0,5 (18)	
Самостоятельная работа обучающихся:	1 (36)	
курсовое проектирование (КП)	Нет	
курсовая работа (КР)	Нет	

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. Понятие финансового риска: определение, виды финансовых рисков									
	1. Понятие финансового риска: определение, виды финансовых рисков	2							
	2. Понятие финансового риска: определение, виды финансовых рисков			2					
	3. Понятие финансового риска: определение, виды финансовых рисков							2	2
2. Методы исследования финансовых рисков; информационное обеспечение исследования финансовых рисков									
	1. Методы исследования финансовых рисков; информационное обеспечение исследования финансовых рисков	4							
	2. Методы исследования финансовых рисков; информационное обеспечение исследования финансовых рисков			4					

3. Методы исследования финансовых рисков; информационное обеспечение исследования финансовых рисков							4	4
3. Инструменты управления финансовыми рисками: базовые методы формирования инвестиционного портфеля; управление								
1. Инструменты управления финансовыми рисками: базовые методы формирования инвестиционного портфеля; управление кредитным риском и формирование портфеля срочных финансовых активов; базовые модели управления финансовыми активами и обязательствами; комплексные модели управления финансовыми рисками экономического субъекта	8							
2. Инструменты управления финансовыми рисками: базовые методы формирования инвестиционного портфеля; управление кредитным риском и формирование портфеля срочных финансовых активов; базовые модели управления финансовыми активами и обязательствами; комплексные модели управления финансовыми рисками экономического субъекта			8					
3. Инструменты управления финансовыми рисками: базовые методы формирования инвестиционного портфеля; управление кредитным риском и формирование портфеля срочных финансовых активов; базовые модели управления финансовыми активами и обязательствами; комплексные модели управления финансовыми рисками экономического субъекта							18	6
4. Интегрированный риск-менеджмент на уровне предприятия								
1. Интегрированный риск-менеджмент на уровне предприятия	4							
2. Интегрированный риск-менеджмент на уровне предприятия			4					

3. Интегрированный риск-менеджмент на уровне предприятия							12	6
Всего	18		18				36	18

4 Учебно-методическое обеспечение дисциплины

4.1 Печатные и электронные издания:

1. Казакова Н.А. Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски: Учебное пособие(Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М").
2. Митрофанова А.Е., Захаров Д.К. Кадровые риски и их оценка: Учебное пособие(Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М").
3. Синявский Н. Г., Дадалко В. А. Предпринимательские риски: Монография(Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М").
4. Серебрякова Т.Ю., Гордеева О.Г. Риски организации: их учет, анализ и контроль: Монография(Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М").
5. Кучеров И.И., Поветкина Н.А. Риски финансовой безопасности: Правовой формат(Москва: ООО "Юридическое издательство Норма").
6. Поветкиной Н.А. Риски финансовой безопасности: правовой формат (Москва: Проспект).
7. Самыгин Д.Ю., Барышников Н.Г. Стратегическая модель устойчивости аграрного бизнеса: параметры, риски, решения: Монография(Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М").

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. Программное обеспечение: MS Word, MS Excel, PowerPoint, Acrobat Reader.

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

1. Базы данных: База Всемирного банка (<https://data.worldbank.org/>), Единая межведомственная информационная система (ЕМИСС), «Статистика» (Росстат, <https://gks.ru/statistic>).
2. Информационно-справочные системы: КонсультантПлюс, ГАРАНТ.

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)

Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса:

Учебный процесс предполагает использование мультимедийного оборудования для проведения презентаций, лекций, групповых практических заданий студентов (ТСО: компьютер, проектор и экран либо компьютер и плазменная панель):

- Оборудование для компьютерной презентации;
- Компьютер с подключением к сети Интернет;
- Программное обеспечение: MS Word, MS Excel, PowerPoint, Acrobat Reader.