

Министерство науки и высшего образования РФ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Национальный исследовательский университет «МЭИ»

Направление подготовки/специальность: 38.03.02 Менеджмент

Наименование образовательной программы: Менеджмент предприятий и организаций

Уровень образования: высшее образование - бакалавриат

Форма обучения: Очная

Рабочая программа дисциплины
ОСНОВЫ ФИНАНСОВОГО РИСК-МЕНЕДЖМЕНТА

Блок:	Блок 1 «Дисциплины (модули)»
Часть образовательной программы:	Вариативная
№ дисциплины по учебному плану:	Б1.В.11.11.01
Трудоемкость в зачетных единицах:	8 семестр - 3;
Часов (всего) по учебному плану:	108 часов
Лекции	8 семестр - 14 часов;
Практические занятия	8 семестр - 28 часа;
Лабораторные работы	не предусмотрено учебным планом
Консультации	проводится в рамках часов аудиторных занятий
Самостоятельная работа	8 семестр - 65,7 часа;
в том числе на КП/КР	не предусмотрено учебным планом
Иная контактная работа	проводится в рамках часов аудиторных занятий
включая: Тестирование Контрольная работа	
Промежуточная аттестация:	
Зачет с оценкой	8 семестр - 0,3 часа;

Москва 2018

ПРОГРАММУ СОСТАВИЛ:

Преподаватель

(должность)

	Подписано электронной подписью ФГБОУ ВО «НИУ «МЭИ»	
	Сведения о владельце ЦЭП МЭИ	
	Владелец	Бадалова А.Г.
	Идентификатор	R590a803a-BadalovaAG-a6343ac5

(подпись)

А.Г. Бадалова

(расшифровка подписи)

СОГЛАСОВАНО:

Руководитель образовательной программы

(должность, ученая степень, ученое звание)

	Подписано электронной подписью ФГБОУ ВО «НИУ «МЭИ»	
	Сведения о владельце ЦЭП МЭИ	
	Владелец	Коробко М.О.
	Идентификатор	R22a1a9d4-KorobkoMO-fab3716e

(подпись)

М.О. Коробко

(расшифровка подписи)

Заведующий выпускающей кафедры

(должность, ученая степень, ученое звание)

	Подписано электронной подписью ФГБОУ ВО «НИУ «МЭИ»	
	Сведения о владельце ЦЭП МЭИ	
	Владелец	Кетоева Н.Л.
	Идентификатор	R56dba1ba-KetoyevaNL-5403d8c5

(подпись)

Н.Л. Кетоева

(расшифровка подписи)

1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель освоения дисциплины: формирование теоретических основ и прикладных аспектов управления финансовой деятельностью хозяйствующих субъектов в условиях рынка с учетом особенностей экономики России

Задачи дисциплины

- изучить понятийный и категориальный аппарат, принципы и основы финансового риск-менеджмента;
- раскрыть содержание и специфику финансового риск-менеджмента предприятий, функционирующих в энергетике и промышленности;
- определить инновационные подходы финансового риск-менеджмента с применением информационных технологий;
- сформировать навыки поиска и анализа информации финансового риск-менеджмента, оценки эффективности проведенных мероприятий, выработки предложений по их совершенствованию.

Формируемые у обучающегося **компетенции** и запланированные **результаты обучения** по дисциплине, соотнесенные с **индикаторами достижения компетенций**:

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Запланированные результаты обучения
ПК-4 умением применять основные методы финансового менеджмента для оценки активов, управления оборотным капиталом, принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала, в том числе, при принятии решений, связанных с операциями на мировых рынках в условиях глобализации		знать: - методы оценки финансовых рисков и способы управления ими. уметь: - организовывать работу по управлению финансовыми рисками.
ПК-5 способностью анализировать взаимосвязи между функциональными стратегиями компаний с целью подготовки сбалансированных управленческих решений		знать: - современные инструменты риск-менеджмента и подходы к его организации на предприятии;. уметь: - осуществлять разработку финансовых стратегий и финансовой политики организаций, различных организационно-правовых форм собственности с учетом рисков их хозяйственной деятельности.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ ВО

Дисциплина относится к части, формируемой участниками образовательных отношений блока дисциплин основной профессиональной образовательной программе Менеджмент предприятий и организаций (далее – ОПОП), направления подготовки 38.03.02 Менеджмент, уровень образования: высшее образование - бакалавриат.

Базируется на уровне среднего общего образования.

Результаты обучения, полученные при освоении дисциплины, необходимы при выполнении выпускной квалификационной работы.

3. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

3.1 Структура дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетных единицы, 108 часов.

№ п/п	Разделы/темы дисциплины/формы промежуточной аттестации	Всего часов на раздел	Семестр	Распределение трудоемкости раздела (в часах) по видам учебной работы										Содержание самостоятельной работы/ методические указания	
				Контактная работа							СР				
				Лек	Лаб	Пр	Консультация		ИКР		ПА	Работа в семестре	Подготовка к аттестации /контроль		
КПР	ГК	ИККП	ТК												
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	
1	Содержание и классификация рисков	28	8	4	-	8	-	-	-	-	-	16	-	<u>Самостоятельное изучение теоретического материала:</u> Изучение дополнительного материала по разделу "Содержание и классификация рисков" <u>Изучение материалов литературных источников:</u> [1], 12-35	
1.1	Понятие риска	14		2	-	4	-	-	-	-	-	8	-		
1.2	Сущность и классификация рисков	14		2	-	4	-	-	-	-	-	8	-		
2	Методы оценки уровня финансовых рисков	31		5	-	10	-	-	-	-	-	-	16	-	<u>Подготовка к контрольной работе:</u> Изучение материалов по разделу Методы оценки уровня финансовых рисков и подготовка к контрольной работе <u>Изучение материалов литературных источников:</u> [2], 114-136
2.1	Качественные методы оценки финансовых рисков	14		2	-	4	-	-	-	-	-	8	-		
2.2	Количественные методы оценки финансовых рисков	17		3	-	6	-	-	-	-	-	8	-		
3	Методы управления финансовыми рисками	31		5	-	10	-	-	-	-	-	-	16	-	<u>Подготовка к текущему контролю:</u> Повторение материала по разделу "Методы управления финансовыми рисками" <u>Изучение материалов литературных источников:</u> [3], 212-143
3.1	Активное и пассивное управление финансовыми рисками	17		3	-	6	-	-	-	-	-	8	-		
3.2	Основные положения организации финансового риск-менеджмента	14		2	-	4	-	-	-	-	-	8	-		

	Зачет с оценкой	18.0	-	-	-	-	-	-	-	0.3	-	17.7	
	Всего за семестр	108.0	14	-	28	-	-	-	-	0.3	48	17.7	
	Итого за семестр	108.0	14	-	28	-	-	-	-	0.3	65.7		

Примечание: Лек – лекции; Лаб – лабораторные работы; Пр – практические занятия; КПр – аудиторные консультации по курсовым проектам/работам; ИККП – индивидуальные консультации по курсовым проектам/работам; ГК- групповые консультации по разделам дисциплины; СР – самостоятельная работа студента; ИКР – иная контактная работа; ТК – текущий контроль; ПА – промежуточная аттестация

3.2 Краткое содержание разделов

1. Содержание и классификация рисков

1.1. Понятие риска

Риск и неопределенность.

1.2. Сущность и классификация рисков

Риски чистые и спекулятивные. Финансовые риски: сущность и классификация. Формы и последствия проявления финансовых рисков. Факторы финансовых рисков.

2. Методы оценки уровня финансовых рисков

2.1. Качественные методы оценки финансовых рисков

Качественные методы оценки финансовых рисков :экспертный, комиссии, суда, Дельфи.

2.2. Количественные методы оценки финансовых рисков

Количественные методы оценки финансовых рисков: финансовых коэффициентов, сравнительный, сценарный, анализа чувствительности, Монте-Карло, САРМ, дерева решений.

3. Методы управления финансовыми рисками

3.1. Активное и пассивное управление финансовыми рисками

Методы, снижающие вероятность проявления рисков. Методы, снижающие последствия ущерба от реализации риска.

3.2. Основные положения организации финансового риск-менеджмента

Принципы и функции финансового риск-менеджмента. Ключевые направления рискового вложения капитала крупнейших российских компаний. Особенности организации финансового риск-менеджмента в банках. Особенности организации финансового риск-менеджмента в венчурных компаниях (фондах).

3.3. Темы практических занятий

1. Содержание и классификация рисков;
2. Методы оценки уровня финансовых рисков;
3. Методы управления финансовыми рисками;
4. Основные положения организации финансового риск-менеджмента.

3.4. Темы лабораторных работ

не предусмотрено

3.5 Консультации

3.6 Тематика курсовых проектов/курсовых работ

Курсовой проект/ работа не предусмотрены

3.7. Соответствие разделов дисциплины и формируемых в них компетенций

Запланированные результаты обучения по дисциплине (в соответствии с разделом 1)	Коды индикаторов	Номер раздела дисциплины (в соответствии с п.3.1)			Оценочное средство (тип и наименование)
		1	2	3	
Знать:					
методы оценки финансовых рисков и способы управления ими	ПК-4(Компетенция)	+			Тестирование/Сущность и классификация рисков
современные инструменты риск-менеджмента и подходы к его организации на предприятии;	ПК-5(Компетенция)		+		Тестирование/Методы оценки уровня финансовых рисков
Уметь:					
организовывать работу по управлению финансовыми рисками	ПК-4(Компетенция)			+	Контрольная работа/Методы управления финансовыми рисками
осуществлять разработку финансовых стратегий и финансовой политики организаций, различных организационно-правовых форм собственности с учетом рисков их хозяйственной деятельности	ПК-5(Компетенция)			+	Контрольная работа/Основные положения организации финансового риск-менеджмента

4. КОМПЕТЕНТНОСТНО-ОРИЕНТИРОВАННЫЕ ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ КОНТРОЛЯ ОСВОЕНИЯ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (ТЕКУЩИЙ КОНТРОЛЬ УСПЕВАЕМОСТИ, ПРОМЕЖУТОЧНАЯ АТТЕСТАЦИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ)

4.1. Текущий контроль успеваемости

8 семестр

Форма реализации: Письменная работа

1. Методы оценки уровня финансовых рисков (Тестирование)
2. Методы управления финансовыми рисками (Контрольная работа)
3. Основные положения организации финансового риск-менеджмента (Контрольная работа)
4. Сущность и классификация рисков (Тестирование)

Балльно-рейтинговая структура дисциплины является приложением А.

4.2 Промежуточная аттестация по дисциплине

Зачет с оценкой (Семестр №8)

Оценка за освоение дисциплины определяется как $0,4 \times$ оценка за тесты + $0,4 \times$ оценка за контрольное задание + $0,2$ оценка за зачет

Примечание: Оценочные материалы по дисциплине приведены в фонде оценочных материалов ОПОП.

5. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

5.1 Печатные и электронные издания:

1. Антонов, Г. Д. Управление рисками организации : учебник для вузов по направлению 38.03.02 "Менеджмент" (профиль "Производственный менеджмент"), по магистерской программе "Производственный менеджмент", а также для технологических направлений и специальностей в части экономико-организационной и управленческой подготовки / Г. Д. Антонов, О. П. Иванова, В. М. Тумин . – М. : ИНФРА-М, 2018 . – 152 с. – (Высшее образование . Бакалавриат) . - ISBN 978-5-16-013060-6 .;
2. Воронцовский, А. В. Оценка рисков : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры вузов по экономическим направлениям / А. В. Воронцовский . – М. : Юрайт, 2017 . – 179 с. – (Бакалавр и магистр. Академический курс) . - ISBN 978-5-534-02411-1 .;
3. А.И. Новиков, Т.И. Солодка- "Теория принятия решений и управление рисками в финансовой и налоговой сферах", Издательство: "Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°»", Москва, 2017 - (285 с.)
<http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=454091>.

5.2 Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение:

1. Office;
2. Windows.

5.3 Интернет-ресурсы, включая профессиональные базы данных и информационно-справочные системы:

1. ЭБС Лань - <https://e.lanbook.com/>
2. ЭБС "Университетская библиотека онлайн" - http://biblioclub.ru/index.php?page=main_ub_red

6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Тип помещения	Номер аудитории, наименование	Оснащение
Учебные аудитории для проведения лекционных занятий и текущего контроля	К-511, Аудитория для проведения интерактивных занятий кафедры МЭП	парта со скамьей, стул, трибуна, вешалка для одежды, доска меловая, компьютерная сеть с выходом в Интернет, мультимедийный проектор, экран, кондиционер, мел, маркер, стилус
	К-520, Аудитория для проведения интерактивных занятий кафедры МЭП	кресло рабочее, парта со скамьей, стол преподавателя, стул, трибуна, вешалка для одежды, доска меловая, компьютерная сеть с выходом в Интернет, мультимедийный проектор, экран, кондиционер, мел, маркер, стилус
Учебные аудитории для проведения практических занятий, КР и КП	К-504, Учебная аудитория	парта со скамьей, стол преподавателя, стул, трибуна, доска меловая, мультимедийный проектор, экран, кондиционер
	К-509, Аудитория для проведения интерактивных занятий кафедры МЭП	кресло рабочее, парта со скамьей, стол преподавателя, стул, трибуна, вешалка для одежды, доска меловая, компьютерная сеть с выходом в Интернет, мультимедийный проектор, экран, кондиционер, мел, маркер, стилус
Учебные аудитории для проведения промежуточной аттестации	К-504, Учебная аудитория	парта со скамьей, стол преподавателя, стул, трибуна, доска меловая, мультимедийный проектор, экран, кондиционер
	К-509, Аудитория для проведения интерактивных занятий кафедры МЭП	кресло рабочее, парта со скамьей, стол преподавателя, стул, трибуна, вешалка для одежды, доска меловая, компьютерная сеть с выходом в Интернет, мультимедийный проектор, экран, кондиционер, мел, маркер, стилус
	К-511, Аудитория для проведения интерактивных занятий кафедры МЭП	парта со скамьей, стул, трибуна, вешалка для одежды, доска меловая, компьютерная сеть с выходом в Интернет, мультимедийный проектор, экран, кондиционер, мел, маркер, стилус
	К-520, Аудитория для проведения интерактивных занятий кафедры МЭП	кресло рабочее, парта со скамьей, стол преподавателя, стул, трибуна, вешалка для одежды, доска меловая, компьютерная сеть с выходом в Интернет, мультимедийный проектор, экран, кондиционер, мел, маркер, стилус
Помещения для самостоятельной работы	НТБ-302, Читальный зал отдела обслуживания учебной литературой	стул, стол письменный, компьютерная сеть с выходом в Интернет, компьютер персональный
	НТБ-303,	стол компьютерный, стул, стол письменный,

	Компьютерный читальный зал	вешалка для одежды, компьютерная сеть с выходом в Интернет, компьютер персональный, принтер, кондиционер
	НТБ-304, Читальный зал отдела обслуживания учебной литературой	стул, трибуна, стол письменный, компьютерная сеть с выходом в Интернет, компьютер персональный
Помещения для консультирования	К-516, Кабинет сотрудников кафедры МЭП	кресло рабочее, рабочее место сотрудника, стол, стул, шкаф для документов, шкаф для одежды, тумба, компьютерная сеть с выходом в Интернет, многофункциональный центр, ноутбук, компьютер персональный, принтер, холодильник, кондиционер
	К-514, Кабинет сотрудников кафедры МЭП	кресло рабочее, рабочее место сотрудника, стол, стул, шкаф для документов, шкаф для одежды, тумба, компьютерная сеть с выходом в Интернет, колонки звуковые, многофункциональный центр, компьютер персональный, принтер, кондиционер
	К-513, Кабинет сотрудников кафедры МЭП	кресло рабочее, рабочее место сотрудника, стол, стул, шкаф для документов, шкаф для одежды, тумба, компьютерная сеть с выходом в Интернет, экран интерактивный, колонки звуковые, мультимедийный проектор, доска маркерная, многофункциональный центр, ноутбук, компьютер персональный, принтер, холодильник, кондиционер
	К-518, Кабинет сотрудников кафедры МЭП	кресло рабочее, рабочее место сотрудника, стол, стул, шкаф для документов, шкаф для одежды, тумба, компьютерная сеть с выходом в Интернет, колонки звуковые, доска маркерная, многофункциональный центр, ноутбук, компьютер персональный, принтер, кондиционер
Помещения для хранения оборудования и учебного инвентаря	Ж-203, Кабинет сотрудников "МЭП"	кресло рабочее, рабочее место сотрудника, стол, стул, шкаф для документов, вешалка для одежды, тумба, компьютерная сеть с выходом в Интернет, компьютер персональный, принтер, холодильник, кондиционер

БАЛЛЬНО-РЕЙТИНГОВАЯ СТРУКТУРА ДИСЦИПЛИНЫ**Основы финансового риск-менеджмента**

(название дисциплины)

8 семестр**Перечень контрольных мероприятий текущего контроля успеваемости по дисциплине:**

КМ-1 Сущность и классификация рисков (Тестирование)

КМ-2 Методы оценки уровня финансовых рисков (Тестирование)

КМ-3 Методы управления финансовыми рисками (Контрольная работа)

КМ-4 Основные положения организации финансового риск-менеджмента (Контрольная работа)

Вид промежуточной аттестации – Зачет с оценкой.

Номер раздела	Раздел дисциплины	Индекс КМ:	КМ-1	КМ-2	КМ-3	КМ-4
		Неделя КМ:	3	6	9	12
1	Содержание и классификация рисков					
1.1	Понятие риска		+			
1.2	Сущность и классификация рисков		+			
2	Методы оценки уровня финансовых рисков					
2.1	Качественные методы оценки финансовых рисков			+		
2.2	Количественные методы оценки финансовых рисков			+		
3	Методы управления финансовыми рисками					
3.1	Активное и пассивное управление финансовыми рисками				+	
3.2	Основные положения организации финансового риск-менеджмента				+	+
Вес КМ, %:			25	25	25	25