

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
ФГБОУ ВО «Дагестанский государственный технический университет»

РЕКОМЕНДОВАНО
К УТВЕРЖДЕНИЮ:


Декан факультета
магистерской подготовки,

 Ашуралиева Р.К.

Подпись _____ ФИО _____
« 13 » 0.9 2018г.

УТВЕРЖДАЮ:

Проректор по учебной работе

 Суракатов Н.С.

Подпись _____ ФИО _____
« 17 » 0.9 2018г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина М1.В.ДВ2.1 Управление рисками в сфере финансов и кредита,

наименование дисциплины по ООП и код по ФГОС

для направления 38.04.08 - «Финансы и кредит»

шифр и полное наименование направления

магистерской программы «Финансовый контроль и аудит»,

факультет магистерской подготовки,

наименование факультета, где ведется дисциплина

кафедра финансов и бухгалтерского учета.

наименование кафедры, за которой закреплена дисциплина

Квалификация и выпускника (степень) магистр.

магистр

Форма обучения заочная, курс 2 семестр (ы) 3

очная, заочная, др.

Всего трудоемкость в зачетных единицах (часах) 33ЕТ (108ч.) :

лекции 3 (час); экзамен 3 (9 часа – контроль) ;

(семестр)

практические (семинарские) занятия 6 (час); зачет -

(семестр)

лабораторные занятия - (час); самостоятельная работа 90 (час);

курсовой проект (работа, РГР) - (семестр), контр. работа -.

Зав. кафедрой _____ М.Н.Исалова

подпись

ИОФ

Начальник УО _____ Э.В.Магомаева

подпись

ИОФ

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО с учетом рекомендаций примерной ООП ВО по направлению подготовки 38.04.08 – «Финансы и кредит» магистерской программе «Финансовый контроль и аудит».

Программа одобрена на заседании выпускающей кафедры финансов и бухгалтерского учета от 11.09.2018 года, протокол № 1.

Зав. выпускающей кафедрой по данному направлению (профилю)

 Исалова М.Н.

подпись

ФИО

ОДОБРЕНО
Методической комиссией
направления 38.04.08 –
«Финансы и кредит»

Председатель МК


Подпись, ИОФ

АВТОР ПРОГРАММЫ

Э.А. Герейханова, к.э.н., ст. преподаватель
ФИО уч. степень, ученое звание, подпись



«11» 09 2018.

1. Цели освоения дисциплины «Управление рисками в сфере финансов и кредита» является углубление знаний студентов по вопросам методики и практики антикризисного менеджмента применительно к различным организационно – управленческим структурам бизнеса.

Дисциплина «Управление рисками в сфере финансов и кредита» имеет особую актуальность при подготовке специалистов в данной области. В условиях мирового финансового и экономического кризиса она призвана расширить его экономическую и социальную сущность, показать взаимосвязь и взаимообусловленность с рисками при принятии антикризисных управленческих решений.

2. Задачи дисциплины:

Раскрытие экономической и социальной сущности рисков и кризисов, изучение принципов и методов анализа взаимосвязи и взаимообусловленности кризисов, рисков, условий и факторов их минимизации;

освоение особенностей методических подходов к управлению основным и оборотным капиталом кризисного предприятия;

рассмотрение основных стратегий и направлений антикризисного управления предприятия, реструктуризации его активов и пассивов для снижения кризисной ситуации и рисков предприятия;

приобретение практических навыков в использовании методов, показателей и критериев анализа и оценки кризисов и рисков, в выработке стратегических и тактических мероприятий по их снижению.

Место дисциплины в структуре ООП магистратуры: дисциплина «Управление рисками в сфере финансов и кредита» относится к дисциплинам вариативной части блока М1.В.ДВ2. Для освоения дисциплины «Управление финансами в сфере финансов и кредита» обучающиеся используют знания, умения, навыки, способы деятельности и установки, сформированные в ходе изучения предметов «Финансовый анализ (продвинутый уровень)», «Методология научного исследования», «Актуальные проблемы финансов», «Корпоративные финансы».

Минимум требований к входным знаниям необходим для удовлетворительного усвоения данной дисциплины: успешное усвоение программ по указанным данным дисциплины и владение персональным компьютером на уровне уверенного пользователя.

3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины:

В результате освоения дисциплины должны быть сформированы следующие компетенции:

ОК-6 - способность самостоятельно овладевать новыми навыками и умениями при смене профиля профессиональной деятельности в финансово-кредитной сфере;

ПК-1 - способность владеть методами аналитической работы, связанными с финансовыми аспектами деятельности коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно-правовых форм, в том числе финансово-кредитных;

ПК-7 - способность осуществлять самостоятельно или руководить подготовкой заданий и разработкой финансовых аспектов проектных решений и соответствующих нормативных и методических документов для реализации подготовленных проектов;

ПК-8 - способность предложить конкретные мероприятия по реализации разработанных проектов и программ;

ПК-15 - способность оказывать консалтинговые услуги коммерческим и некоммерческим организациям различных организационно-правовых форм, включая финансово-кредитные, по вопросам совершенствования их финансовой деятельности;

В результате освоения дисциплины обучающийся должен:

знать:

особенности и механизм управления финансовыми рисками в различных областях и сферах предпринимательской деятельности;

методы сбора и обработки информации о факторах внешней и внутренней среды, влияющих на деятельность предприятий и организаций;

инструментальные средства для обработки экономических данных;

виды, состав и структуру отчетных документов предприятия (организации);

критерии выбора эффективных управленческих решений, в том числе с учетом уровня рисков.

уметь:

анализировать и оценивать влияние финансовых рисков на эффективность деятельности предприятия (организации);

работать с финансовыми документами, в том числе с бухгалтерской отчетностью, использовать ее в аналитических целях и диагностировать с ее помощью финансовые риски деятельности предприятия;

осуществлять выбор управленческих решений на основе критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий.

владеть:

методами и приемами анализа и оценки финансовых рисков;

навыками выбора и применения инструментальных средств для обработки экономических данных;

навыками анализа финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий (организаций) и использования полученных сведений для принятия рискованных управленческих решений;

навыками критической оценки вариантов управленческих решений; расчета критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий.

**4. Структура и содержание дисциплины
«Управление рисками в сфере финансов и кредита»
4.1.Содержание дисциплины.**

№ п/п	Раздел дисциплины Тема лекции и вопросы	Семестр	Неделя семестра	Формы текущего контроля успеваемости (по срокам текущих аттестаций в семестре) Форма промежуточной аттестации (по семестрам)			
				ЛК	ПЗ	СР	
1.	<p>Лекция 1 Тема 1: Сущность и классификация рисков</p> <p>1. Основы теории предпринимательских рисков. Содержание концепции финансового менеджмента «Риск - доходность». Понятие рисков и их классификация. Сущность макроэкономического, производственного (делового) и финансового рисков.</p> <p>2. Классификация финансовых рисков по видам, уровню потерь и источникам возникновения.</p> <p>3. Этапы проведения анализа предпринимательского риска.</p> <p>4. Методы проведения анализа предпринимательского риска</p>	3	1	1	2	20	Входная контрольная работа
2.	<p>Лекция 2.</p> <p>Тема 2. Методы анализа финансовых рисков и неопределенности</p> <p>1. Количественная оценка риска.</p> <p>2. Расчет вероятности убытков. Качественная оценка риска. Методы</p>		2	1	2	20	

	экспертных оценок (метод «Дельфи» и др.). 3. Принятие решения в условиях неопределенности. Критерии принятия решения в условиях неопределенности						
3.	Лекция 3 Тема 3. Содержание и анализ финансовых рисков 1. Понятие риска утраты ликвидности (платежеспособности). 2. Инвестиционные риски и их классификация. 3. Валютные риски. 4. Процентные риски.	3		1		30	
4.	Лекция 4 Тема 4. Управление финансовыми рисками 1. Цель, содержание и значение риск-менеджмента. 2. Схемы переноса финансовых рисков: диверсификация, страхование, хеджирование. 3. Организация риск-менеджмента на предприятии.	4	1	1		20	
	Итого:	1	4	3	6	90	Экзамен (1зет-36 часов)

4.2. Содержание практических семинарских занятий

№	№ лекции из рабочей программы	Наименование практического, семинарского занятия	Количество часов	Рекомендуемая литература и методические разработки (№ источника из списка литературы)
1	2	3	4	5
1.	№1	Сущность и классификация рисков	2	№№ 1, 2, 3, 4, 5, 7
2.	№2	Методы анализа финансовых рисков и неопределенности	2	№№ 2, 3, 4, 5, 7
3.	№3	Управление финансовыми рисками	2	№№ 1, 2, 3, 4, 5, 8, 7
Итого:			6	

4.3 Тематика для самостоятельной работы студента

№ п/п	Тематика по содержанию дисциплины, выделенная для самостоятельного изучения	Кол-во часов из содержания дисциплины	Рекомендуемая литература и источники информации	Формы контроля СРС
1	2	4	4	5
1.	Сущность и классификация рисков	20	1,2,3,5,7	Реферат
2.	Методы анализа финансовых рисков и неопределенности	20	4,6	Доклад
3.	Содержание и анализ финансовых рисков	30	6,7	Реферат
4.	Управление финансовыми рисками	20	1,2,3,5	Доклад
ИТОГО		90		

6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины.

ПЕРЕЧЕНЬ

вопросов контрольной работы по проверке входных знаний студентов

1. Основы теории предпринимательских рисков.
2. Содержание концепции финансового менеджмента «Риск - доходность».
3. Понятие рисков и их классификация.
4. Сущность макроэкономического, производственного (делового) и финансового рисков.
5. Классификация финансовых рисков по видам, уровню потерь и источникам возникновения.
6. Этапы проведения анализа предпринимательского риска.
7. Методы проведения анализа предпринимательского риска

Контрольная работа №1

1. Количественная оценка риска.
2. Расчет вероятности убытков. Качественная оценка риска. Методы экспертных оценок (метод «Дельфи» и др.).
3. Принятие решения в условиях неопределенности.
4. Критерии принятия решения в условиях неопределенности
5. Понятие риска утраты ликвидности (платежеспособности).
6. Инвестиционные риски и их классификация.
7. Валютные риски.
8. Процентные риски.
9. Цель, содержание и значение риск-менеджмента.
10. Схемы переноса финансовых рисков: диверсификация, страхование, хеджирование.
11. Организация риск-менеджмента на предприятии

ПЕРЕЧЕНЬ

вопросов на экзамен по дисциплине “Управление рисками в сфере финансов и кредита”

1. Основы теории предпринимательских рисков.
2. Содержание концепции финансового менеджмента «Риск - доходность».
3. Понятие рисков и их классификация.

4. Сущность макроэкономического, производственного (делового) и финансового рисков.
5. Классификация финансовых рисков по видам, уровню потерь и источникам возникновения.
6. Этапы проведения анализа предпринимательского риска.
7. Методы проведения анализа предпринимательского риска
8. Количественная оценка риска.
9. Расчет вероятности убытков.
10. Качественная оценка риска. Методы экспертных оценок (метод «Дельфи» и др.).
11. Принятие решения в условиях неопределенности.
12. Критерии принятия решения в условиях неопределенности
13. Понятие риска утраты ликвидности (платежеспособности).
14. Инвестиционные риски и их классификация.
15. Валютные риски.
16. Процентные риски.
17. Цель, содержание и значение риск-менеджмента.
18. Схемы переноса финансовых рисков: диверсификация, страхование, хеджирование.
19. Организация риск-менеджмента на предприятии.

ПЕРЕЧЕНЬ

вопросов контрольной работы по проверке остаточных знаний студентов

1. Классификация финансовых рисков по видам, уровню потерь и источникам возникновения.
2. Методы проведения анализа предпринимательского риска
3. Качественная оценка риска. Методы экспертных оценок (метод «Дельфи» и др.).
4. Инвестиционные риски и их классификация.
5. Схемы переноса финансовых рисков: диверсификация, страхование, хеджирование.
6. Организация риск-менеджмента на предприятии.
7. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

Рекомендуемая литература и источники информации

№	Виды занятия	Необходимая учебная, учебно-методическая	Автор(ы)	Издательс	Количество изданий

№ п/п		(основная и дополнительная) литература, программное обеспечение и Интернет ресурсы		тво, год издания	в библиотеке	на кафедре
1	2	3	4	5	6	7
ОСНОВНАЯ						
1.	Лк, пз	Управление финансовыми рисками в экономической системе безопасности	Пименов Н. А.	Москва : Юрайт, 2014. – 412 с	-	1
2.	Лк	Управление рисками организаций	Фирсова О. А.	[Электронный ресурс]: учеб.-метод. пособие	-	1
3.	Лк	Управление рисками [Электронный ресурс] : учеб. пособие для вузов	К. В. Балдин, С. Н. Воробьев.	Электрон. текстовые дан. – М. : ЮНИТИ-ДАНА, 2015. – 512 с.	-	1
4.	Лк	Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций	А. С. Шапкин, В. А. Шапкин.	М. : Дашков и К, 2016. – 544 с.	-	1
5.	Лк	Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски : учеб. пособие для вузов /– 2-е изд., перераб. и доп.	Г. А. Тактаров, Е. М. Григорьева.	Москва : КноРус, 2015. – 255 с.	-	1
6.	Лк, пз	Теория риска и моделирование рискованных ситуаций [Электронный ресурс] : учебник для вузов / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. – Электрон. текстовые дан. – 6-е изд.	Шапкин, А. С.	М. : Дашков и К, 2015. – 880 с.		-
7.	Лк, пз	Финансовый менеджмент : учеб. пособие для вузов / ред. – 3-е изд., перераб. и доп.	Н. А. Адамов	М. : Эконом. газ, 2016. – 790 с.		1

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины

На факультете «Информационных систем, финансов и аудита» ФГБОУ ВО «Дагестанского государственного технического университета» имеется аудитория, оборудованная интерактивной доской, проектором, что позволяет читать лекции в формате презентаций, разработанных с помощью пакета прикладных программ MS Power Point, использовать наглядные, иллюстрированные материалы, обширную информацию в табличной и графической формах, а также электронные ресурсы сети Интернет.

На факультете функционирует 5 компьютерных классов: 200, 225, 254, 238, 223 класса.

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО с учетом рекомендаций ООП ВО по направлению подготовки магистров 38.04.08 – «Финансы и кредит», магистерская программа «Финансовый контроль и аудит»

Рецензент от выпускающей кафедры финансов и бухгалтерского учета по направлению подготовки магистров 38.04.08 – «Финансы и кредит», магистерская программа «Финансовый контроль и аудит»



Подпись



ФИО

