|  |
| --- |
| шапка новаяЛицензия: регистрационный № 1478 от 28 мая 2015 года, на бланке серии 90Л01 №0008476Свидетельство о государственной аккредитации: регистрационный № 2783 от 07 марта 2018 года, на бланке серии 90А01 №0002920 |
| 115191, г. Москва, 4-й Рощинский проезд, 9А / Тел: + 7 (495) 796-92-62 / E-mail: mpsu@mpsu.ru |

Принято:

Решение Ученого совета

От «13» мая 2020 г.

Протокол №7

### Рабочая программа учебной дисциплины

**Управление финансовыми рисками**

Направление подготовки

38.03.02 Менеджмент

Направленность (профиль) подготовки

Финансовый менеджмент

Квалификация (степень) выпускника

Бакалавр

Форма обучения

Заочная

Москва, 2020

СОДЕРЖАНИЕ

|  |  |
| --- | --- |
| 1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения основной профессиональной образовательной программы
 | 3 |
| 1. Место дисциплины в структуре основной профессиональной образовательной программы бакалавриата
 | 4 |
| 1. Объем дисциплины в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам занятий) и на самостоятельную работу обучающихся
 | 4 |
| 1. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий
 | 4 |
| * 1. Разделы дисциплины и трудоемкость по видам учебных занятий
 | 5 |
| * 1. Содержание дисциплины, структурированное по разделам (темам)
 | 6 |
| 1. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине
 | 9 |
| 1. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине
 | 10 |
| 1. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины
 | 10 |
| 1. Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы
 | 11 |
| 1. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины
 | 11 |
| 1. Лицензионное программное обеспечение
 | 16 |
| 1. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине
 | 16 |
| 1. Особенности реализации дисциплины для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья
2. Иные сведения и (или) материалы
 | 1717 |
| 1. Лист регистрации изменений
 | 18 |

**1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модуля), соотнесенных с планируемыми результатами освоения** **основной профессиональной образовательной программы**

В результате освоения ОПОП бакалавриата обучающийся должен овладеть следующими результатами обучения по дисциплине:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Кодыкомпетенции по ФГОС | Результаты освоения ОПОП (содержание компетенций) | Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине |
| **ПК-15** | умение проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании |  ***Знать:**** понятийный и терминологический аппарат курса;
* сущность и классификацию финансовых рисков;
* сущность, функции и основные принципы организации риск-менеджмента;
* пути снижения финансовых рисков;

 ***Уметь:*** * проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений;
* ориентироваться в причинах и степени финансовых рисков;
* использовать методы управления рисками;
* анализировать информационные и статистические материалы по оценке влияния на финансовые результаты предприятия финансовых рисков, используя современные методы и показатели такой оценки;
* подготавливать и принимать решения в условиях неопределенности и риска;

 ***Владеть:**** навыками принятия решений об инвестировании и финансировании.
 |
| **ПК-16** | владение навыками оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов |  ***Знать:**** основные риски инвестиционных проектов, финансовых планов и прогнозов, методы их количественной и качественной оценки и пути их снижения;

 ***Уметь:*** * оценивать качественными и количественными методами общие и специфические риски инвестиционных рисков, финансовых планов и прогнозов;

 ***Владеть***:* навыками оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов.
 |

**2. Место дисциплины в структуре основной профессиональной образовательной программы бакалавриата**

Дисциплина реализуется в рамках дисциплин по выбору вариативной части (дисциплины по выбору) ОПОП.

Для освоения дисциплины необходимы компетенции, предшествующие входные знания и умения, сформированные в рамках изучения следующих дисциплин: «Бизнес-планирование», «Инвестиционный анализ», «Инновационный менеджмент», «Методы принятия управленческих решений», «Статистика», «Стратегический менеджмент», «Теория вероятностей и математическая статистика», «Управление операциями», «Управление проектами», «Управленческие решения», «Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски», «Финансовый менеджмент».

Дисциплина «Управление финансовыми рисками» является основой для освоения таких предметов, как «Страхование», «Управление инвестициями», «Управление инновациями». Дисциплина изучается на 4-м курсе, в 7-8 семестрах для заочной формы обучения.

**3. Объем дисциплины в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам занятий) и на самостоятельную работу обучающихся**

Общая трудоемкость дисциплины составляет 6 зачетных единиц.

|  |  |
| --- | --- |
| **Объём дисциплины** | **Всего часов** |
| заочная форма обучения |
| Общая трудоемкость дисциплины | 216 |
| Контактнаяработа обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) (всего) | 18 |
| Аудиторная работа (всего): | 18 |
| в том числе: |  |
| лекции | 10 |
| семинары, практические занятия | 8 |
| Внеаудиторная работа (всего): |  |
| Самостоятельная работа обучающихся(всего) | 185 |
| Вид промежуточной аттестации обучающегося (зачёт, экзамен) | 13 |

**4. Содержание дисциплины, структурированное по темам с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий**

**4.1 Разделы дисциплины и трудоемкость по видам учебных занятий (в академических часах)**

**Для заочной формы обучения**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **№п/п** | **Разделы и темы дисциплины** | **Семестр** | **Виды учебной работы, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах)** | **Вид оценочного средства текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации** ***(по семестрам)*** |
| **ВСЕГО** | **Из них аудиторные занятия** | **Самостоятельная работа** | **Контрольная работа** | **Курсовая работа** |
| **Лекции**  | **.Практикум. Лаборатор** | **Практическ.занятия /семинары**  |  |  |  |  |  |
| 1 | Сущность и классификация рисков. Место финансовых рисков | 7 | 13 | 1 |  | - |  | 12 |  |  | Опрос |
| 2 | Виды финансовых рисков | 7 | 13 | 1 |  | - |  | 12 |  |  | Коллоквиум  |
| 3 | Факторы, влияющие на финансовые риски | 7 | 13 | 1 |  | - |  | 12 |  |  | Опрос |
| 4 | Риск-менеджмент как система управления финансовыми рисками | 7 | 13 | 1 |  | - |  | 12 |  |  | Коллоквиум  |
| 5 | Этапы формирования риск-менеджмента | 7 | 13 | - |  | 1 |  | 12 |  |  | Опрос |
| 6 | Принципы и правила управления финансовыми рисками | 7 | 13 | - |  | 1 |  | 12 |  |  | Коллоквиум  |
| 7 | Методы выявления финансовых рисков | 7 | 13 | - |  | 1 |  | 12 |  |  | Опрос |
| 8 | Качественные и количественные методы оценки финансовых рисков | 7 | 13 | - |  | 1 |  | 12 |  |  | Коллоквиум , тестирование |
|  | **Итого по 7 семестру** |  | **108** | **4** |  | **4** |  | **96** |  |  | **4 (зачёт)** |
| 9 | Контроль в системе риск-менеджмента | 8 | 11 | 1 |  | - |  | 10 |  |  | Опрос |
| 10 | Инструменты снижения финансовых рисков | 8 | 11 | 1 |  | 1 |  | 9 |  |  | Коллоквиум , тестирование |
| 11 | Организация риск-менеджмента | 8 | 11 | 1 |  | - |  | 10 |  |  | Опрос |
| 12 | Анализ эффективности методов управления финансовыми рисками | 8 | 11 | 1 |  | - |  | 10 |  |  | Коллоквиум , тестирование |
| 13 | Информационное обеспечение системы управления финансовыми рисками | 8 | 11 | 1 |  | - |  | 10 |  |  | Опрос, тестирование |
| 14 | Риск и доходность финансовых активов | 8 | 11 | 1 |  | - |  | 10 |  |  | Коллоквиум  |
| 15 | Анализ инвестиционных возможностей в условиях неопределенности | 8 | 11 | - |  | 1 |  | 10 |  |  | Опрос |
| 16 | Риск и структура капитала. Эффект финансового рычага | 8 | 11 | - |  | 1 |  | 10 |  |  | Коллоквиум  |
| 17 | Риск и производные финансовые инструменты | 8 | 11 | - |  | 1 |  | 10 |  |  | Опрос |
|  | **Итого по 8 семестру** |  | **108** | **6** |  | **4** |  | **89** |  |  | **9 (экзамен)** |
|  | **ИТОГО** |  | **216** | **10** |  | **12** |  | **181** |  |  | **13 (контроль)** |

**4.2 Содержание дисциплины, структурированное по разделам**

***Тема 1. Сущность и классификация рисков. Место финансовых рисков***

*Содержание лекционного курса*

Понятие риска как экономической категории. Характеристика основных теорий финансовых рисков. Основы теории предпринимательских рисков. Классификация рисков. Сущность макроэкономического, производственного (делового) и финансового рисков. Место финансовых рисков в общей классификации рисков.

*Содержание практических занятий*

1. Основы теории предпринимательских рисков.

***Тема 2. Виды финансовых рисков***

*Содержание лекционного курса*

Сущность и функции финансового риска. Характеристика основных теорий финансовых рисков. Современные классификации финансовых рисков и их основные проявления. Классификация финансовых рисков по видам, уровню потерь и источникам возникновения. Риски утраты ликвидности (платежеспособности). Виды инвестиционных рисков и рисков, связанных с покупательной способностью денег. Валютные риски. Классификация валютных рисков: операционный, трансляционный и экономический валютные риски. Последствия и методы контроля валютного риска. Процентные риски. Факторы, влияющие на уровень процентных ставок. Классификация процентных рисков: позиционный, портфельный и экономический (структурный) процентные риски. Понятие дюрации и чувствительности.

*Содержание практических занятий*

1. Характеристика основных теорий финансовых рисков.
2. Виды инвестиционных рисков и рисков, связанных с покупательной способностью денег.

***Тема 3. Факторы, влияющие на финансовые риски***

*Содержание лекционного курса*

Общая характеристика основных факторов и их влияния на изменение уровня финансового риска. Влияние факторов рыночного равновесия. Виды и роль факторов, ограничивающих уровень риска.

*Содержание практических занятий*

1. Виды и роль факторов, ограничивающих уровень риска.

***Тема 4. Риск-менеджмент как система управления финансовыми рисками***

*Содержание лекционного курса*

Риск-менеджмент как система управления финансовыми рисками. Общая схема процесса управления риском. Стратегия риск-менеджмента. Характеристика отдельных составляющих системы риск-менеджмента.

*Содержание практических занятий*

1. Характеристика отдельных составляющих системы риск-менеджмента.

***Тема 5. Этапы формирования риск-менеджмента***

*Содержание лекционного курса*

Этапы формирования риск-менеджмента. Условия формирования эффективной системы риск-менеджмента. Этапы процесса управления финансовыми рисками: выявление (идентификация) риска, оценка риска, управление риском, контроль риска.

*Содержание практических занятий*

1. Условия формирования эффективной системы риск-менеджмента.

***Тема 6. Принципы и правила управления финансовыми рисками***

*Содержание лекционного курса*

Принципы риск-менеджмента. Ключевые правила управления финансовыми рисками.

*Содержание практических занятий*

1. Ключевые правила управления финансовыми рисками.

***Тема 7. Методы выявления финансовых рисков***

*Содержание лекционного курса*

Основные подходы к выявлению риска. Структурные диаграммы и карты потоков как методы выявления финансовых рисков. Анализ финансовой и управленческой отчетности как методы выявления рисков. Построение риск-профиля (карты рисков).

*Содержание практических занятий*

1. Построение риск-профиля (карты рисков).

***Тема 8. Качественные и количественные методы оценки финансовых рисков***

*Содержание лекционного курса*

Качественные методы оценки финансовых рисков. Методы использования аналогов и экспертных оценок (метод «Дельфи» и др.). Критерии и методы количественной оценки финансовых рисков. Статистические показатели, используемые для количественной оценки риска: вероятность, математическое ожидание, дисперсия, стандартное отклонение, коэффициент вариации. Показатели оценки риска: закон нормального распределения вероятностей, правило «трех сигм». Расчет вероятности убытков. Интегральные оценка и характеристики риска.

*Содержание практических занятий*

1. Статистические показатели, используемые для количественной оценки риска: вероятность, математическое ожидание, дисперсия, стандартное отклонение, коэффициент вариации.

***Тема 9. Контроль в системе риск-менеджмента***

*Содержание лекционного курса*

Функции контроля в системе риск-менеджмента. Понятие уровня толерантности к риску и его границ. Контроль за исполнением риск-решений.

*Содержание практических занятий*

1. Контроль за исполнением риск-решений.

***Тема 10. Инструменты снижения финансовых рисков***

*Содержание лекционного курса*

Трансфер как способ управления финансовыми рисками. Хеджирование финансовых рисков. Диверсификация рисков как метод снижения их уровня. Лимитирование концентрации финансовых рисков. Страхование и самострахование как методы снижения рисков. Объединение рисков. Принципы избегания возможных рисков.

*Содержание практических занятий*

1. Хеджирование финансовых рисков.

***Тема 11. Организация риск-менеджмента***

*Содержание лекционного курса*

Критерии принятия решения в условиях неопределенности. Концепция приемлемого риска. Распределение функций и обязанностей в системе управления финансовыми рисками на предприятии.

*Содержание практических занятий*

1. Распределение функций и обязанностей в системе управления финансовыми рисками на предприятии.

***Тема 12. Анализ эффективности методов управления финансовыми рисками***

*Содержание лекционного курса*

Анализ эффективности методов управления финансовыми рисками. Средства предупреждения рисков. Финансирование рисков.

*Содержание практических занятий*

1. Анализ эффективности методов управления финансовыми рисками.

***Тема 13. Информационное обеспечение системы управления финансовыми рисками***

*Содержание лекционного курса*

Повышение уровня информационного обеспечения хозяйственной деятельности как метод снижения финансовых рисков. Принципы информационного обеспечения системы управления риском. Внешние и внутренние источники информации. Визуализация рисков.

*Содержание практических занятий*

1. Принципы информационного обеспечения системы управления риском.

***Тема 14. Риск и доходность финансовых активов***

*Содержание лекционного курса*

Содержание концепции финансового менеджмента «Риск-доходность». Соотношение доходности и риска финансовых активов. Концепция оценки риска финансовых активов. Модель оценки доходности финансовых активов. Индикаторы на рынке ценных бумаг.

*Содержание практических занятий*

1. Модель оценки доходности финансовых активов.

***Тема 15. Анализ инвестиционных возможностей в условиях неопределенности***

*Содержание лекционного курса*

Функции рисковых предпочтений инвесторов. Этапы анализа инвестиционных возможностей в условиях неопределенности и их влияние на инвестиционную деятельность предприятия. Понятие и роль инвестиционной стратегии в эффективном управлении «портфелем» рисков предприятия. Рисковое инвестирование в инновационное предпринимательство: суть и модель организации. Субсидирование рискового инвестирования по государственным программам.

*Содержание практических занятий*

1. Рисковое инвестирование в инновационное предпринимательство: суть и модель организации.

***Тема 16. Риск и структура капитала. Эффект финансового рычага***

*Содержание лекционного курса*

Теории структуры капитала. Производственный и финансовый риски в контексте рыночного риска. Эффект финансового рычага.

*Содержание практических занятий*

1. Теории структуры капитала.

***Тема 17. Риск и производные финансовые инструменты***

*Содержание лекционного курса*

Основы теории опционов. Риск и использование валютных фьючерсных контрактов. Фьючерсные контракты и фондовые индексы. Фьючерсные контракты и процентные ставки. Операции своп.

*Содержание практических занятий*

1. Основы теории опционов.

**5. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине**

Одним из основных видов деятельности обучающегося является самостоятельная работа, которая включает в себя изучение лекционного материала, учебников и учебных пособий, первоисточников, подготовку сообщений, выступления на практических занятиях, выполнение заданий преподавателя.

Методика самостоятельной работы предварительно разъясняется преподавателем и в последующем может уточняться с учетом индивидуальных особенностей обучающихся. Время и место самостоятельной работы выбираются обучающимися по своему усмотрению с учетом рекомендаций преподавателя.

Самостоятельную работу над дисциплиной следует начинать с изучения рабочей программы «Управление финансовыми рисками», которая содержит основные требования к знаниям, умениям и навыкам обучаемых. Обязательно следует вспомнить рекомендации преподавателя, данные в ходе лекционных и практических занятий. Затем – приступать к изучению отдельных тем в порядке, предусмотренном рабочей программой.

Получив представление об основном содержании темы, необходимо изучить материал с помощью учебников, других методических материалов, указанных в разделе 7 указанной рабочей программы. Целесообразно составить краткий конспект или схему, отображающую смысл и связи основных понятий данной темы. Затем, как показывает опыт, полезно изучить выдержки из первоисточников. При желании можно составить их краткий конспект. Важным источником для освоения дисциплины являются ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет». Обязательно следует записывать возникшие вопросы, на которые не удалось ответить самостоятельно.

**6. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине**

Фонд оценочных средств оформлен в виде приложения к рабочей программе дисциплины «Управление финансовыми рисками».

**7.** **Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины**

**7.1. Основная учебная литература**

1. Гибсон Роджер Формирование инвестиционного портфеля: Управление финансовыми рисками [Электронный ресурс]/ Гибсон Роджер— Электрон. текстовые данные.— М.: Альпина Бизнес Букс, 2019.— 280 c.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/82378.html.— ЭБС «IPRbooks»
2. Каранина Е.В. Управление финансовыми рисками. Стратегические модели и профессиональные стандарты [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Каранина Е.В.— Электрон. текстовые данные.— СПб.: Интермедия, 2017.— 152 c.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/66803.html.— ЭБС «IPRbooks»
3. Шапкин А.С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций [Электронный ресурс]/ Шапкин А.С., Шапкин В.А.— Электрон. текстовые данные.— М.: Дашков и К, 2016.— 544 c.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/60565.html.— ЭБС «IPRbooks»

**7.2. Дополнительная учебная литература**

1. Васин С.М., Шутов В.С. Управление рисками на предприятии: Учеб. пособие. – М.: КноРус, 2010.
2. Грачева М.В., Ляпина С.Ю. Управление рисками в инновационной деятельности. Учеб. пособие. – М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2010.
3. Уродовских В.Н. Управление рисками предприятия: Учеб. пособие. – М.: ИНФРА-М, 2011.
4. Фирсова О.А. Управление рисками организаций: Учеб.-метод. Пособие. – Орёл: Межрегиональная Академия безопасности и выживания, 2014. ЭБС IPRbooks, по паролю.
5. Фомичев А.Н. Риск-менеджмент: Учеб. – М.: Дашков и К°, 2011. ЭБС IPRbooks, по паролю.

### 8. Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы

1. Информационно-правовая система «Консультант+» - договор №2856/АП от 01.11.2007
2. Информационно-справочная система «LexPro» - договор б/н от 06.03.2013
3. Официальный интернет-портал базы данных правовой информации [http://pravo.gov.ru](http://pravo.gov.ru/)
4. Портал Федеральных государственных образовательных стандартов высшего образования [http://fgosvo.ru](http://fgosvo.ru/)
5. Портал "Информационно-коммуникационные технологии в образовании" [http://www.ict.edu.ru](http://www.ict.edu.ru/)
6. Научная электронная библиотека <http://www.elibrary.ru/>
7. Национальная электронная библиотека <http://www.nns.ru/>
8. Электронные ресурсы Российской государственной библиотеки <http://www.rsl.ru/ru/root3489/all>
9. Web of Science Core Collection — политематическая реферативно-библиографическая и наукомтрическая (библиометрическая) база данных — [http://webofscience.com](http://webofscience.com/)
10. Полнотекстовый архив ведущих западных научных журналов на российской платформе Национального электронно-информационного консорциума (НЭИКОН) [http://neicon.ru](http://neicon.ru/)
11. Базы данных издательства Springer [https://link.springer.com](https://link.springer.com/)
12. Открытые данные государственных органов <http://data.gov.ru/>
13. [www.cbr.ru](http://www.cbr.ru/). Сайт Банка России.
14. [www.garant.ru](http://www.garant.ru/). Информационно-правовой портал.
15. [www.gks.ru](http://www.gks.ru/). Сайт Федеральной службы государственной статистики.
16. [www.minfin.ru](http://www.minfin.ru/). Сайт Министерства финансов РФ.
17. [www.riskmanage.ru](http://www.riskmanage.ru/#_blank). Сайт клуба российских риск-менеджеров.

### 9. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

|  |  |
| --- | --- |
| **Вид деятельности** | **Методические указания по организации деятельности студента** |
| Лекция | Написание конспекта лекций: кратко, схематично, последовательно фиксировать основные положения, выводы, формулировки, обобщения; помечать важные мысли, выделять ключевые слова, термины. Проверка терминов, понятий с помощью энциклопедий, словарей, справочников с выписыванием толкований в тетрадь. Обозначить вопросы, термины, материал, который вызывает трудности, пометить и попытаться найти ответ в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удается разобраться в материале, необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на консультации, на практическом занятии. |
| Практические занятия | Проработка рабочей программы, уделяя особое внимание целям и задачам, структуре и содержанию дисциплины. Конспектирование источников. Работа с конспектом лекций, подготовка ответов к контрольным вопросам, просмотр рекомендуемой литературы, работа с текстом. Прослушивание аудио- и видеозаписей по заданной теме, решение расчетно-графических заданий, решение задач по алгоритму и др. |
| Индивидуальные задания | Знакомство с основной и дополнительной литературой, включая справочные издания, зарубежные источники, конспект основных положений, терминов, сведений, требующихся для запоминания и являющихся основополагающими в этой теме. Составление аннотаций к прочитанным литературным источникам и др. |
| Самостоятельная работа | Самостоятельная работа проводится с целью: систематизации и закрепления полученных теоретических знаний и практических умений обучающихся; углубления и расширения теоретических знаний студентов; формирования умений использовать нормативную, правовую, справочную документацию, учебную и специальную литературу; развития познавательных способностей и активности обучающихся: творческой инициативы, самостоятельности, ответственности, организованности; формирование самостоятельности мышления, способностей к саморазвитию, совершенствованию и самоорганизации; формирования профессиональных компетенций; развитию исследовательских умений обучающихся. Формы и виды самостоятельной работы: чтение основной и дополнительной литературы – самостоятельное изучение материала по рекомендуемым литературным источникам; работа с библиотечным каталогом, самостоятельный подбор необходимой литературы; работа со словарем, справочником; поиск необходимой информации в сети Интернет; конспектирование источников; реферирование источников; составление аннотаций к прочитанным литературным источникам; составление рецензий и отзывов на прочитанный материал; составление обзора публикаций по теме; составление и разработка терминологического словаря; составление хронологической таблицы; составление библиографии (библиографической картотеки); подготовка к различным формам текущей и промежуточной аттестации (к тестированию, зачету, экзамену); выполнение домашних контрольных работ; самостоятельное выполнение практических заданий репродуктивного типа (ответы на вопросы, тесты; выполнение творческих заданий). Технология организации самостоятельной работы обучающихся включает использование информационных и материально-технических ресурсов образовательного учреждения: библиотеку с читальным залом, укомплектованную в соответствии с существующими нормами; учебно-методическую базу учебных кабинетов, лабораторий и зала кодификации; компьютерные классы с возможностью работы в сети Интернет; аудитории (классы) для консультационной деятельности; учебную и учебно-методическую литературу, разработанную с учетом увеличения доли самостоятельной работы студентов, и иные методические материалы. Перед выполнением обучающимися внеаудиторной самостоятельной работы преподаватель проводит консультирование по выполнению задания, который включает цель задания, его содержания, сроки выполнения, ориентировочный объем работы, основные требования к результатам работы, критерии оценки. Во время выполнения обучающимися внеаудиторной самостоятельной работы и при необходимости преподаватель может проводить индивидуальные и групповые консультации. Самостоятельная работа может осуществляться индивидуально или группами обучающихся в зависимости от цели, объема, конкретной тематики самостоятельной работы, уровня сложности, уровня умений обучающихся. Контроль самостоятельной работы предусматривает:* соотнесение содержания контроля с целями обучения; объективность контроля;
* валидность контроля (соответствие предъявляемых заданий тому, что предполагается проверить);
* дифференциацию контрольно-измерительных материалов.

Формы контроля самостоятельной работы:* просмотр и проверка выполнения самостоятельной работы преподавателем;
* организация самопроверки,
* взаимопроверки выполненного задания в группе; обсуждение результатов выполненной работы на занятии;
* проведение письменного опроса;
* проведение устного опроса;
* организация и проведение индивидуального собеседования; организация и проведение собеседования с группой;
* защита отчетов о проделанной работе.
 |
| Опрос | Опрос - это средство контроля, организованное как специальная беседа преподавателя с обучающимся на темы, связанные с изучаемой дисциплиной, и рассчитанное на выявление объема знаний по определенному разделу, теме, проблеме и т.п. Проблематика, выносимая на опрос определена в заданиях для самостоятельной работы обучающегося, а также может определяться преподавателем, ведущим семинарские занятия. Во время проведения опроса обучающийся должен уметь обсудить с преподавателем соответствующую проблематику на уровне диалога. |
| Коллоквиум | Коллоквиум (от латинского colloquium – разговор, беседа) – одна из форм учебных занятий, беседа преподавателя с учащимися на определенную тему из учебной программы. Цель проведения коллоквиума состоит в выяснении уровня знаний, полученных учащимися в результате прослушивания лекций, посещения семинаров, а также в результате самостоятельного изучения материала. В рамках поставленной цели решаются следующие задачи:* выяснение качества и степени понимания учащимися лекционного материала;
* развитие и закрепление навыков выражения учащимися своих мыслей;
* расширение вариантов самостоятельной целенаправленной подготовки учащихся;
* развитие навыков обобщения различных литературных источников;
* предоставление возможности учащимся сопоставлять разные точки зрения по рассматриваемому вопросу.

В результате проведения коллоквиума преподаватель должен иметь представление:* о качестве лекционного материала;
* о сильных и слабых сторонах своей методики чтения лекций;
* о сильных и слабых сторонах своей методики проведения семинарских занятий;
* об уровне самостоятельной работы учащихся;
* об умении обучающихся вести дискуссию и доказывать свою точку зрения;
* о степени эрудированности учащихся;
* о степени индивидуального освоения материала конкретными обучающимися.

В результате проведения коллоквиума обучающийся должен иметь представление:* об уровне своих знаний по рассматриваемым вопросам в соответствии с требованиями преподавателя и относительно других студентов группы;
* о недостатках самостоятельной проработки материала;
* о своем умении излагать материал;
* о своем умении вести дискуссию и доказывать свою точку зрения.

В зависимости от степени подготовки группы можно использовать разные подходы к проведению коллоквиума. В случае, если большинство группы с трудом воспринимает содержание лекций и на практических занятиях демонстрирует недостаточную способность активно оперировать со смысловыми единицами и терминологией курса, то коллоквиум можно разделить на две части. Сначала преподаватель излагает базовые понятия, содержащиеся в программе. Это должно занять не более четверти занятия. Остальные три четверти необходимо посвятить дискуссии, в ходе которой обучающиеся должны убедиться и, главное, убедить друг друга в обоснованности и доказательности полученного видения вопроса и его соответствия реальной практике. Если же преподаватель имеет дело с более подготовленной, самостоятельно думающей и активно усваивающей смысловые единицы и терминологию курса аудиторией, то коллоквиум необходимо провести так, чтобы сами обучающиеся сформулировали изложенные в программе понятия, высказали несовпадающие точки зрения и привели практические примеры. За преподавателем остается роль модератора (ведущего дискуссии), который в конце «лишь» суммирует совместно полученные результаты. |
| Тестирование | Контроль в виде тестов может использоваться после изучения каждой темы курса. Итоговое тестирование можно проводить в форме: * компьютерного тестирования, т.е. компьютер произвольно выбирает вопросы из базы данных по степени сложности;
* письменных ответов, т.е. преподаватель задает вопрос и дает несколько вариантов ответа, а обучающийся на отдельном листе записывает номера вопросов и номера соответствующих ответов.

Для достижения большей достоверности результатов тестирования следует строить текст так, чтобы у обучающихся было не более 40 – 50 секунд для ответа на один вопрос. Итоговый тест должен включать не менее 60 вопросов по всему курсу. Значит, итоговое тестирование займет целое занятие. Оценка результатов тестирования может проводиться двумя способами:1) по 5-балльной системе, когда ответы студентов оцениваются следующим образом:- «отлично» – более 80% ответов правильные;- «хорошо» – более 65% ответов правильные; - «удовлетворительно» – более 50% ответов правильные.Обучающиеся, которые правильно ответили менее чем на 70% вопросов, должны в последующем пересдать тест. При этом необходимо проконтролировать, чтобы вариант теста был другой; 2) по системе зачет-незачет, когда для зачета по данной дисциплине достаточно правильно ответить более чем на 70% вопросов.  |
| Подготовка к экзамену (зачету) | При подготовке к экзамену (зачету) необходимо ориентироваться на конспекты лекций, рекомендуемую литературу и др. Основное в подготовке к сдаче зачета и экзамена по дисциплине «Управление финансовыми рисками» - это повторение всего материала дисциплины, по которому необходимо сдавать экзамен. При подготовке к сдаче зачета или экзамена обучающийся весь объем работы должен распределять равномерно по дням, отведенным для подготовки к зачету или экзамену, контролировать каждый день выполнение намеченной работы. Подготовка к зачету (экзамену) включает в себя три этапа:* самостоятельная работа в течение семестра;
* непосредственная подготовка в дни, предшествующие зачету (экзамену) по темам курса;
* подготовка к ответу на задания, содержащиеся в билетах (тестах) зачета (экзамена).

Для успешной сдачи зачета (экзамена) по дисциплине «Управление финансовыми рисками» обучающиеся должны принимать во внимание, что:* все основные вопросы, указанные в рабочей программе, нужно знать, понимать их смысл и уметь его разъяснить;
* указанные в рабочей программе формируемые профессиональные компетенции в результате освоения дисциплины должны быть продемонстрированы студентом;
* семинарские занятия способствуют получению более высокого уровня знаний и, как следствие, более высокой оценке на зачете (экзамене);
* готовиться к экзамену необходимо начинать с первой лекции и первого семинара.
 |

**10. Лицензионное программное обеспечение**

1. В процессе обучения на экономическом факультете по всем направлениям подготовки используется следующее лицензионное программное обеспечение:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Программный продукт** | **Тип** | **Тип лицензии** | **Дополнительные сведения** |
| Microsoft Windows XP Professional Russian | Операционная система | OEM-лицензии | Поставляются в составе готового компьютера |
| Microsoft Windows 7 Professional | Операционная система | OEM-лицензии | Поставляются в составе готового компьютера |
| Microsoft Office 2007 | Программный пакет | Microsoft Open License | Лицензия № 45829385 от 26.08.2009 (бессрочно) |
| Microsoft Office 2010 Professional | Программный пакет | Microsoft Open License | Лицензия № 48234688 от 16.03.2011 |
| Microsoft Office 2010 Professional | Программный пакет | Microsoft Open License | Лицензия № 49261732 от 04.11.2011 |
| DrWEB Entrprise Suite | Комплексная система антивирусной защиты | Microsoft Open License | Лицензия № 126408928, действует до 13.03.2018 |
| IBM SPSS Statistic BASE | Прикладное ПО | Договор | Лицензионный договор № 20130218-1 от 12.03.2013 |
| MathCAD Education | Прикладное ПО | Договор-оферта | Лицензионный договор № 456600 от 19.03.2013 |
| 1C:Бухгалтерия 8 учебная версия | Информационная система | Договор | Договор № 01/200213 от 20.02.2013 |
| LibreOffice | Программный пакет | Lesser General Public License | Оферта (свободная лицензия) |
| SciLab | Прикладное ПО | CeCILL | Оферта (свободная лицензия) |

1. **11. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине**
2. Для построения эффективного учебного процесса Кафедра Экономики и управления располагает следующими материально-техническими средствами, которые используются в процессе изучения дисциплины:
3. - доска;
4. - персональные компьютеры (компьютерный класс кафедры, аудитория 403, 16 шт.), каждый из компьютеров подключен к сети Интернет;
5. - экран;
6. - мультимедийный проектор.
7. В процессе преподавания и для самостоятельной работы обучающихся используются также компьютерные классы аудиторий 304 и 307, а также специальные ресурсы кабинета экономики (305 ауд.).

**12. Особенности реализации дисциплины для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья**

Для обеспечения образования инвалидов и обучающихся с ограниченными возможностями здоровья разрабатывается адаптированная образовательная программа, индивидуальный учебный план с учетом особенностей их психофизического развития и состояния здоровья, в частности применяется индивидуальный подход к освоению дисциплины, индивидуальные задания: рефераты, письменные работы и, наоборот, только устные ответы и диалоги, индивидуальные консультации, использование диктофона и других записывающих средств для воспроизведения лекционного и семинарского материала.

В целях обеспечения обучающихся инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья библиотека комплектует фонд основной учебной литературой, адаптированной к ограничению их здоровья, предоставляет возможность удаленного использования электронных образовательных ресурсов, доступ к которым организован в МПСУ. В библиотеке проводятся индивидуальные консультации для данной категории пользователей, оказывается помощь в регистрации и использовании сетевых и локальных электронных образовательных ресурсов, предоставляются места в читальных залах, оборудованные программами невизуального доступа к информации, экранными увеличителями и техническими средствами усиления остаточного зрения.

**13.** **Иные сведения и (или) материалы**

Не предусмотрены.

**Составитель: Балашов Ю.К, к.э.н., декан факультета экономики и права МПСУ**

**14. Лист регистрации изменений**

Рабочая программа учебной дисциплины обсуждена и утверждена на заседании Ученого совета от «24» июня 2013 г. протокол № 10

**Лист регистрации изменений**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № п/п | Содержание изменения | Реквизитыдокументаоб утвержденииизменения | Датавведенияизменения |
|  | Утверждена и введена в действие решением Ученого совета на основании Федерального государственного образовательного стандарта высшего профессионального образования по направлению подготовки 080200 Менеджмент (квалификация (степень) «бакалавр»), утвержденного приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от 20.05.2010 г. № 544 | Протокол заседания Ученого совета от «24» июня 2013 года протокол № 10 |  01.09.2013 |
|  | Актуализирована решением Ученого совета с учетом развития науки, культуры, экономики, техники, технологий и социальной сферы | Протокол заседания Ученого совета от «30» июня 2014 года протокол № 8 | 01.09.2014 |
|  | Актуализирована решением Ученого совета с учетом развития науки, культуры, экономики, техники, технологий и социальной сферы | Протокол заседания Ученого совета от «29» июня 2015 года протокол № 11 | 01.09.2015 |
|  | Актуализирована решением Ученого совета на основании утверждения Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент (уровень бакалавриата), утвержденного приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от 12.01.2016 г. № 7 | Протокол заседания Ученого совета от «29» февраля 2016 года протокол № 5 | 01.03.2016 |
|  | Актуализирована решением Ученого совета с учетом развития науки, культуры, экономики, техники, технологий и социальной сферы | Протокол заседания Ученого совета от «30» мая 2016 года протокол № 8 | 01.09.2016 |
|  | Актуализирована решением Ученого совета с учетом развития науки, культуры, экономики, техники, технологий и социальной сферы | Протокол заседания Ученого совета от «28» августа 2017 года протокол № 11 | 01.09.2017 |
|  | Актуализирована решением Ученого совета с учетом развития науки, культуры, экономики, техники, технологий и социальной сферы | Протокол заседания Ученого совета от «28» августа 2018 года протокол №7 | 01.09.2018 |
|  | Обновлена решением совместного заседания Совета и Кафедр факультета экономики и права ОАНО ВО «МПСУ  | Протокол совместного заседания Совета и Кафедр факультета экономики и права ОАНО ВО «МПСУ» от 30 августа 2019 г. № 1. | 01.09.2019 |
|  | Актуализирована решением Ученого совета с учетом развития науки, культуры, экономики, техники, технологий и социальной сферы | Протокол заседания Ученого совета от «13» мая 2020 года протокол №7 | 01.09.2020 |