

Министерство образования и науки Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования



**Пермский национальный исследовательский
политехнический университет**

Гуманитарный факультет
кафедра Экономика и финансы



УТВЕРЖДАЮ

Проректор по учебной работе
д-р техн. наук, проф.

Н. В. Лобов

«25» 11 2016 г.

УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКИЙ КОМПЛЕКС ДИСЦИПЛИНЫ

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

«Управление финансовыми рисками»

Программа академического бакалавриата

Направление 38.03.01 «Экономика»

Профиль программы бакалавриата:

Финансы и кредит

Квалификация выпускника:

бакалавр

Выпускающая кафедра:

Экономика и финансы

Форма обучения:

очная

Курс: 4.

Семестр(ы): 8

Трудоёмкость:

Кредитов по рабочему учебному плану:

4 3Е

Часов по рабочему учебному плану:

144 ч

Виды контроля:

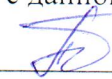
Дифф. зачет 8

Пермь
2016

Учебно-методический комплекс дисциплины «Управление финансовыми рисками» разработан на основании:

- федерального государственного образовательного стандарта высшего образования, утверждённого приказом Министерства образования и науки Российской Федерации «12» ноября 2015 г. номер приказа «1327» по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика (уровень бакалавриата)»;
- компетентностной модели выпускника ОПОП по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика (уровень бакалавриата)», профилю программы бакалавриата «Финансы и кредит», утверждённой «24» июня 2013 г. (с изменениями в связи с переходом на ФГОС ВО);
- базового учебного плана очной формы обучения по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика (уровень бакалавриата)», профилю программы бакалавриата «Финансы и кредит», утверждённого «28» апреля 2016 г.

Рабочая программа согласована с рабочими программами дисциплин: «Корпоративные финансы», «Экономика труда», «Страхование», «Антикризисное управление», участвующих в формировании компетенции совместно с данной дисциплиной.

Разработчик	канд.экон.наук, доц.		Л.М.Плюснина
Рецензент	канд.экон.наук, доц.		Ю.В. Дубровская

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры Экономика и финансы «21» сентября 2016 г., протокол № 2

Заведующий кафедрой Экономика и финансы д-р экон. наук, проф.		И.В. Елохова
--	--	--------------

Рабочая программа одобрена учебно-методической комиссией Гуманитарного факультета «26» сентября 2016 г., протокол № 3.

Председатель учебно-методической комиссии Гуманитарного факультета д-р социол. наук, проф.		В.Н. Стегний
--	--	--------------

СОГЛАСОВАНО

Начальник управления образовательных программ, канд. техн. наук, доц.		Д. С. Репецкий
---	--	----------------

1 Общие положения

1.1 Цель учебной дисциплины – формирование базовых знаний в области управления рисками отдельного субъекта хозяйствования, развитие умений и навыков в вопросах идентификации, анализа и оценки рисков в рыночной экономике и выборе обоснованных решений и методов управления финансовыми рисками на основе базовых концепций риск-менеджмента.

В процессе изучения данной дисциплины студент осваивает следующие компетенции:

– способность критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий (ПК-11).

1.2 Задачи дисциплины:

- **изучение** основных понятий и определений риск-менеджмента;
- **формирование умения** идентифицировать и анализировать состав рисков отдельного субъекта хозяйствования;
- **формирование умения** оценивать риски в рыночной экономике и выбирать обоснованные финансовые решения и методы управления финансовыми рисками;
- **формирование навыков** анализа и управления финансовыми рисками и выбора способа снижения финансовых рисков.

1.3 Предметом освоения дисциплины являются следующие объекты:

- риск-менеджмент;
- кредитный риск;
- валютный риск;
- риск ликвидности;
- инвестиционный риск.

1.4 Место учебной дисциплины в структуре образовательной программы.

Дисциплина «Управление финансовыми рисками» относится к вариативной части Блока 1 «Дисциплины» и является обязательной при освоении ОПОП по профилю программы бакалавриата «Финансы и кредит».

В результате изучения дисциплины обучающийся должен освоить части указанных в пункте 1.1 компетенций и демонстрировать следующие результаты:

- **знать:**
 - природу и виды риска;
 - методы анализа рисков различных вариантов управленческих решений;
 - методы оценки рисков;
 - эффективные инструменты управления рисками;
- **уметь:**
 - провести анализ рисков различных вариантов управленческих решений;
 - оценить риски управленческих решений;
 - выбрать эффективные инструменты управления рисками;
- **владеть:**
 - методиками анализа рисков различных вариантов управленческих решений;
 - методиками оценки рисков управленческих решений;
 - навыками использования эффективных инструментов управления рисками;

В таблице 1.1 приведены последующие⁴ дисциплины, направленные на формирование компетенций, заявленных в пункте 1.1.

Таблица 1.1 – Дисциплины, направленные на формирование компетенций

Код	Наименование компетенции	Предшествующие дисциплины	Последующие дисциплины
Профессиональные компетенции			
ПК-11	Способность критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий субъектов	«Корпоративные финансы», «Экономика труда»	«Страхование», «Антикризисное управление»

2 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Учебная дисциплина обеспечивает формирование части компетенций ПК-11.

2.1 Дисциплинарная карта компетенции ПК-11

Код ПК-11	Формулировка компетенции: Способность критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий
-----------	--

Код ПК-11. Б1.В.11	Формулировка дисциплинарной части компетенции: Способность критически оценить предлагаемые варианты управления рисками, анализировать и содержательно интерпретировать риски
--------------------	---

Требования к компонентному составу части компетенции ПК-11. Б1.В.11

Перечень компонентов	Виды учебной работы	Средства оценки
В результате освоения компетенции студент Знает: – природу и виды риска; – методы анализа рыночных и валютных рисков, риска процентной ставки, рисков инвестиционных проектов; – методы качественной и количественной оценки предпринимательских рисков, рисков инвестиционных проектов; – эффективные инструменты управления рисками;	Лекции. Самостоятельная работа студентов по изучению теоретического материала.	Тестовые вопросы для текущего контроля.
Умеет: – провести анализ форм проявления риска, выявить системные и несистемные риски; – провести анализ рисков обусловленных вероятностью и рисков, обусловленных неопределенностью; – провести анализ и оценку своп-риска, кредитоспособности заемщиков, диверсификацию кредитного портфеля, определить волатильность и способы ее моделирования; – оценить ликвидность и определить риск ликвидности,	Практические занятия. Подготовка к практическим занятиям.	Типовые задания к практическим занятиям и контрольным работам.

оценить рыночные риски с применением показателей модифицированной дюрации и выпуклости; – выбрать эффективные инструменты управления рисками с применением позиционных лимитов, структурных лимитов и лимитов «стоп-лосс»;		
Владеет: – навыками анализа рыночных рисков, риска процентной ставки, рисков инвестиционных проектов; – навыками количественной оценки риска процентной ставки, рисков инвестиционных проектов, и методами минимизации риска ликвидности; – навыками использования диверсификации, хеджирования, ограничения и страхования в качестве эффективных инструментов управления рисками.	Практические занятия. Индивидуальные задания.	Типовые задания к практическим занятиям и контрольным работам. Индивидуальные задания.

3 Структура учебной дисциплины по видам и формам учебной работы

Объем дисциплины в зачетных единицах составляет 3 ЗЕ. Количество часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся указано в таблице 3.1.

Таблица 3.1–Объём и виды учебной работы

№ п.п.	Виды учебной работы	Трудоёмкость		
		по семестрам		всего
1	Аудиторная (контактная работа) / в том числе в интерактивной форме	54/21		54/21
	Лекции (Л) / в том числе в интерактивной форме	18/9		18/9
	Практические занятия (ПЗ) / в том числе в интерактивной форме	32/12		32/12
	Лабораторные работы (ЛР)			
2	Контроль самостоятельной работы (КСР)	4		4
3	Самостоятельная работа студентов (СРС)	90		90
	Изучение теоретического материала	32		32
	Подготовка к аудиторным занятиям	32		32
	Индивидуальные задания	26		26
	Другие виды самостоятельной работы			
4	Итоговый контроль (промежуточная аттестация обучающихся) по дисциплине: дифференцированный зачет			
5	Трудоёмкость дисциплины			
	Всего: в часах (ч) в зачётных единицах (ЗЕ)	144 (ч) 4(ЗЕ)		144 (ч) 4 (ЗЕ)

4 Содержание учебной дисциплины

4.1 Модульный тематический план

Таблица 4.1 – Тематический план по модулям учебной дисциплины

Номер учеб- ного мо- дуля	Номер раз- дела дисци- пли- ны	Номер темы дисцип- лины	Количество часов и виды занятий (очная форма обучения)						Трудоём- ность, ч / ЗЕ	
			аудиторная работа					Итого- вый кон- троль		Само- стоя- тель- ная работа
			всего	Л	ПЗ	ЛР	КС Р			
1	1	1	12	4	8			24	36	
		2	16	6	8		2	21	37	
	Всего по модулю:		28	10	16		2	45	73	
2	2	3	12	4	8			24	36	
		4	14	4	8		2	21	35	
	Всего по модулю:		26	8	16		2	45	71	
Промежуточная аттеста- ция							Дифф. зачёт			
Итого:			54	18	32		4	90	144/4	

4.2 Содержание разделов и тем учебной дисциплины

Модуль 1. Природа и классификация рисков, анализ рисков, риск-менеджмент. Кредитные риски.

Раздел 1. Природа и классификация рисков, анализ рисков, риск-менеджмент. Кредитные риски.

Л – 10 ч, ПЗ – 16 ч, СРС – 45 ч.

Тема 1. Природа риска и классификация рисков.

Предмет, цели и задачи курса. Взаимосвязи анализа и управления рисками с другими дисциплинами. Понятие риска. Формы проявления риска. Природа риска: риски, обусловленные вероятностью, и риски, обусловленные неопределенностью. Предпринимательские и непредпринимательские риски. Многообразие финансовых рисков. Особенности классификации финансовых рисков. Основные элементы классификации рисков.

Тема 2. Риск-менеджмент. Анализ и управление кредитными рисками.

Риск-менеджмент как процесс. Этапы риск-менеджмента: идентификация риска, анализ и количественная оценка рисков, управлением риском, контроль за риском. Принципы риск-менеджмента. Риск-менеджмент как новая философия стратегического управления в финансовом бизнесе. Понятие риск-капитала. Объективная необходимость осуществления риск-менеджмента. Прямое директивное управление рисками. Необходимые условия обеспечения эффективного риск-менеджмента. Лимитирование операций: понятие лимита, целесообразность применения лимитирования и различных ситуациях (stop-loss). Ограничение рисков путем оценки эффективности с учетом риска. Принципы построения системы контроля в банке. Основные методы анализа и оценки кредитоспособности заемщика (фундаментально-аналитический, количественно-статистический). Обеспечение кредитных сделок. Распределение (диверсификация), компенсация (хеджирование) и ограничение.

Модуль 2. Анализ и управление рыночными рисками.

Раздел 2. Анализ и управление рыночными рисками.

Л – 8 ч, ПЗ – 16 ч, СРС – 45 ч.

Тема 3. Анализ и управление валютным риском и риском процентной ставки.

Виды рыночных рисков. Волатильность и способы ее моделирования. Структура валютного риска. Колебания курсов валют как основа существования валютного риска. Своп-риск.

Риск фиксированной процентной ставки (риск ФПС), риск плавающей процентной ставки (риск ППС). Основные подходы к анализу и количественной оценке риска процентной ставки: баланс связанности, анализ дюрации, баланс эластичности. Инструменты управления риском процентной ставки: futures, options, forwardrateagreement.

Тема 4. Анализ и управление риском ликвидности и риском инвестиционных проектов.

Понятие риска ликвидности. Источники возникновения риска ликвидности. Структура риска ликвидности. Основные направления минимизации риска ликвидности.

Профиль риска инвестиционных проектов. Источники возникновения рисков инвестиционных проектов. Анализ и оценка рисков инвестиционных проектов. Управление рисками инвестиционных проектов. Страхование рисков инвестиционных проектов.

4.3 Перечень тем практических занятий

Таблица 4.2 – Темы практических занятий

№ п.п.	Номер темы дисциплины	Наименование темы практического занятия
1	1	Анализ форм проявления риска.
2	1	Анализ рисков обусловленных вероятностью.
3	1	Анализ рисков обусловленных неопределенностью.
4	1	Выявление системных и несистемных рисков.
5	2	Выбор эффективных инструментов управления рисками с применением позиционных лимитов, структурных лимитов и лимитов «стоп-лосс».
6	2	Использование диверсификации в качестве эффективного инструмента управления рисками.
7	2	Анализ и оценка кредитоспособности заемщиков. Диверсификация кредитного портфеля.
8	2	Использование хеджирования в качестве эффективного инструмента управления рисками. Использование ограничения в качестве эффективного инструмента управления рисками.
9	3	Анализ рыночных рисков. Определение волатильности и способов ее моделирования.
10	3	Анализ и количественная оценка риска процентной ставки.
11	3	Анализ и оценка своп-риска.
12	3	Оценка рыночного риска с применением показателей модифицированной дюрации и выпуклости.
13	4	Оценка ликвидности и определение риска ликвидности. Минимизация риска ликвидности.
14	4	Анализ и оценка рисков инвестиционных проектов.
15	4	Управление рисками инвестиционных проектов.
16	4	Использование страхования в качестве эффективного инструмента управления рисками инвестиционных проектов.

4.4 Перечень тем лабораторных работ

Не предусмотрены

8

5. Методические указания для обучающихся по изучению дисциплины

При изучении дисциплины обучающимся целесообразно выполнять следующие рекомендации:

1. Изучение учебной дисциплины должно вестись систематически.
2. После изучения какого-либо раздела по учебнику или конспектным материалам рекомендуется по памяти воспроизвести основные термины, определения, понятия раздела.
3. Особое внимание следует уделить выполнению отчетов по практическим занятиям, лабораторным работам и индивидуальным комплексным заданиям на самостоятельную работу.
4. Изучение дисциплины осуществляется в течение одного семестра, график изучения дисциплины приводится п.7.
5. Вся тематика вопросов, изучаемых самостоятельно, задается на лекциях преподавателем. Им же даются источники (в первую очередь вновь изданные в периодической научной литературе) для более детального понимания вопросов, озвученных на лекции.

Таблица 5.1 – Виды самостоятельной работы студентов (СРС)

№ темы дисциплины	Вид самостоятельной работы студентов	Трудоёмкость, час.
Тема 1	Изучение теоретического материала.	8
	Подготовка к аудиторным занятиям.	8
	Индивидуальное задание.	8
Тема 2	Изучение теоретического материала.	8
	Подготовка к аудиторным занятиям.	8
	Индивидуальное задание.	5
Тема 3	Изучение теоретического материала.	8
	Подготовка к аудиторным занятиям.	8
	Индивидуальное задание.	8
Тема 4	Изучение теоретического материала.	8
	Подготовка к аудиторным занятиям.	8
	Индивидуальное задание.	5
Итого: в ч / в 3Е		90/2,5

5.1. Изучение теоретического материала

Тематика вопросов, вынесенных на самостоятельное изучение:

Тема 1. Классификации финансовых рисков, предлагаемые отечественными и зарубежными авторами. Риски системные и несистемные, основные различия.

Тема 2. История возникновения современного риск-менеджмента. Системы управления рисками: макро- и микро-риск-менеджмент.

Тема 3. Виды своп-операций. Виды процентных ставок.

Тема 4. Риск ликвидности и неопределенность. Способы минимизации рисков инвестиционных проектов.

5.2. Индивидуальные задания

Тема 1. Выполнить задание в форме эссе на тему «Классификация рисков ситуации». Наиболее подробно и просто тема «Понятие риска. Классификация рисков ситуаций» изложена в книге Г.В.Черновой и А.А. Кудрявцева «Управление рисками».

Тема 2. Разделение кредитного риска на ⁹ риск конкретного заемщика и риск портфеля предполагает учет особенностей каждого вида риска в процессе управления. Провести сравнение содержания этапов управления кредитным риском индивидуального заемщика и кредитного риска совокупности кредитных вложений. Выполненное задание студенты представляют преподавателю в письменном виде.

Тема 3. Используя Национальный стандарт РФ «Менеджмент риска. Методы оценки риска», разработанный Федеральным агентством по техническому регулированию и метрологии, (ГОСТ Р ИСО/МЭК 31010—2011), составить таблицу соотношений между различными методами оценки риска и существенными факторами риска в конкретной ситуации и привести примеры выбора метода оценки риска для конкретной ситуации. Выполненное задание студенты представляют преподавателю в письменном виде.

Тема 4. Описать подробно методику «Факторного анализа рисков инвестиционного проекта». Тема «Факторный анализ» наиболее подробно изложена в книге под редакцией М.В. Грачевой «Риск-анализ инвестиционного проекта». Выполненное задание студенты представляют преподавателю в письменном виде.

5.3. Образовательные технологии, используемые для формирования компетенций

Проведение лекционных занятий по дисциплине основывается на активном методе обучения, при которой учащиеся не пассивные слушатели, а активные участники занятия, отвечающие на вопросы преподавателя. Вопросы преподавателя нацелены на активизацию процессов усвоения материала. Преподаватель заранее намечает список вопросов, стимулирующих ассоциативное мышление и установления связей с ранее освоенным материалом.

Практические занятия проводятся на основе реализации метода обучения действием: определяются проблемные области; каждое практическое занятие проводится по своему алгоритму. При проведении практических занятий преследуются следующие цели: применение знаний отдельных дисциплин и креативных методов для решения проблем; закрепление основ теоретических знаний.

6 Фонд оценочных средств дисциплины

6.1 Текущий контроль освоения заданных дисциплинарных компетенций

Текущий контроль освоения дисциплинарных компетенций проводится в следующих формах:

- текущее тестирование для анализа усвоения материала предыдущей лекции;
- оценка работы студента на лекционных и практических занятиях в рамках рейтинговой системы.

6.2 Рубежный и промежуточный контроль освоения заданных дисциплинарных компетенций

Рубежный контроль освоения дисциплинарных компетенций проводится по окончании модулей дисциплины в следующих формах:

- контрольные работы (модуль 1, 2).

6.3 Итоговый контроль освоения заданных дисциплинарных компетенций

1) Дифференцированный зачет

Дифференцированный зачет по дисциплине выставляется по итогам проведенного рубежного контроля и при выполнении заданий всех практических занятий, аудиторных занятий и самостоятельной работы, результатов рейтинга, собеседования.

Фонды оценочных средств, включающий типовые задания к практическим занятиям и, контрольным работам, тесты и методы оценки, критерии оценивания, перечень контрольных

точек и таблица планирования результатов¹⁰ обучения, контрольные задания к зачету, позволяющие оценить результаты освоения данной дисциплины, входит в состав РПД в виде приложения.

Перечень вопросов к зачету:

1. Предмет, цели и задачи анализа и управления финансовыми рисками.
2. Взаимосвязи анализа и управления рисками с другими дисциплинами.
3. Понятие риска. Формы проявления риска.
4. Природа риска: риски, обусловленные вероятностью, и риски, обусловленные неопределенностью.
5. Предпринимательские и непредпринимательские риски.
6. Многообразие финансовых рисков.
7. Особенности классификации финансовых рисков.
8. Основные элементы классификации рисков.
9. Классификации финансовых рисков, предлагаемые отечественными и зарубежными авторами.
10. Риски системные и несистемные, основные различия.
11. Этапы риск-менеджмента: идентификация риска.
12. Анализ и количественная оценка риска.
13. Управление риском, контроль за риском.
14. Принципы риск-менеджмента.
15. История возникновения современного риск-менеджмента.
16. Понятие риск-капитала.
17. Системы управления рисками: макро- и микро-риск-менеджмент.
18. Прямое директивное управление рисками.
19. Лимитирование операций: понятие лимита.
20. Целесообразность применения лимитирования в различных ситуациях (stop-loss).
21. Ограничение рисков путем оценки эффективности с учетом риска.
22. Принципы построения системы контроля в банке.
23. Основные методы анализа и оценки кредитоспособности заемщика.
24. Фундаментально-аналитический метод оценки кредитоспособности заемщика.
25. Количественно-статистический метод оценки кредитоспособности заемщика.
26. Обеспечение кредитных сделок.
27. Распределение (диверсификация) как метод управления финансовыми рисками.
28. Компенсация (хеджирование) как метод управления финансовыми рисками.
29. Ограничение как метод управления финансовыми рисками.
30. Виды рыночных рисков.
31. Волатильность и способы ее моделирования.
32. Структура валютного риска.
33. Колебания курсов валют как основа существования валютного риска.
34. Виды своп-операций.
35. Своп-риск, его характеристика.
36. Виды процентных ставок.
37. Риск фиксированной процентной ставки (риск ФПС), его характеристика.
38. Риск плавающей процентной ставки (риск ППС), его характеристика.
39. Основные подходы к анализу и количественной оценке риска процентной ставки.
40. Баланс связанности, как подход к количественной оценке риска процентной ставки.
41. Анализ дюрации, как подход к количественной оценке риска процентной ставки.

42. Баланс эластичности, как подход к количественной оценке риска процентной ставки.
43. Инструменты управления риском процентной ставки: futures, options, forward rate agreement.
44. Понятие риска ликвидности.
45. Источники возникновения риска ликвидности.
46. Структура риска ликвидности.
47. Основные направления минимизации риска ликвидности.
48. Риск ликвидности и неопределенность
49. Профиль риска инвестиционных проектов.
50. Источники возникновения рисков инвестиционных проектов.
51. Анализ и оценка рисков инвестиционных проектов.
52. Управление рисками инвестиционных проектов.
53. Страхование рисков инвестиционных проектов.
54. Способы минимизации рисков инвестиционных проектов.

2) Экзамен

Не предусмотрен.

6.1 Виды текущего, рубежного и итогового контроля освоения элементов и частей компетенций

Таблица 6.1 - Виды контроля освоения элементов и частей компетенций

Контролируемые результаты освоения дисциплины (ЗУВы)	Вид контроля			
	ТТ	КР	Опрос	Зач
В результате освоения дисциплины студент				
Знает:				
– природу и виды риска;				+
– методы анализа рыночных и валютных рисков, риска процентной ставки, рисков инвестиционных проектов;	+			+
– методы качественной и количественной оценки предпринимательских рисков, рисков инвестиционных проектов;	+			+
– эффективные инструменты управления рисками;	+			+
Умеет:				
– провести анализ форм проявления риска, выявить системные и несистемные риски;		+		
– провести анализ рисков обусловленных вероятностью и рисков, обусловленных неопределенностью;		+		
– оценить ликвидность и определить риск ликвидности, оценить рыночные риски с применением показателей модифицированной дюрации и выпуклости;		+		
– провести анализ и оценку своп-риска, кредитоспособности заемщиков, диверсификацию кредитного портфеля, определить волатильность и способы ее моделирования;		+		
– выбрать эффективные инструменты управления рисками с применением позиционных лимитов, структурных лимитов и лимитов «стоп-лосс»;		+		
Владеет:				
– методиками анализа рыночных рисков, риска процентной ставки, рисков инвестиционных проектов;		+		
– методиками количественной оценки риска процентной ставки, рисков инвестиционных проектов, и методиками минимизации риска ликвидности;		+		
– навыками использования диверсификации, хеджирования,				

ТТ – текущее тестирование (контроль знаний по теме);

РТ – рубежное тестирование по модулю (автоматизированная система контроля знаний);

КР – рубежная контрольная работа по модулю (оценка умений).

Таблица 7.1 – График учебного процесса по дисциплине

[illegible]

8 Перечень учебно-методического и информационного обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

8.1 Карта обеспеченности дисциплины учебно-методической литературой

Б1.В.11 Управление финансовыми рисками <i>(полное название дисциплины)</i>	БЛОК 1. Дисциплины (модули) <i>(цикл дисциплины)</i>								
	<table style="width: 100%;"> <tr> <td style="width: 50%; text-align: center;"> ☒ обязательная ☐ по выбору студента </td> <td style="width: 50%; text-align: center;"> ☐ базовая часть цикла ☒ вариативная часть цикла </td> </tr> </table>	☒ обязательная ☐ по выбору студента	☐ базовая часть цикла ☒ вариативная часть цикла						
☒ обязательная ☐ по выбору студента	☐ базовая часть цикла ☒ вариативная часть цикла								
38.03.01 <i>(код направления / специальности)</i>	Экономика / Финансы и кредит <i>(полное название направления подготовки / специальности)</i>								
Э / ФК <i>(аббревиатура направления / специальности)</i>	<table style="width: 100%;"> <tr> <td style="width: 50%;"> Уровень подготовки <table style="display: inline-table; vertical-align: middle;"> <tr><td style="width: 30px; height: 20px;"></td></tr> <tr><td style="width: 30px; height: 20px; text-align: center;">x</td></tr> <tr><td style="width: 30px; height: 20px;"></td></tr> </table> специалист бакалавр магистр </td> <td style="width: 50%;"> Форма обучения <table style="display: inline-table; vertical-align: middle;"> <tr><td style="width: 30px; height: 20px; text-align: center;">x</td></tr> <tr><td style="width: 30px; height: 20px;"></td></tr> <tr><td style="width: 30px; height: 20px;"></td></tr> </table> очная заочная очно-заочная </td> </tr> </table>	Уровень подготовки <table style="display: inline-table; vertical-align: middle;"> <tr><td style="width: 30px; height: 20px;"></td></tr> <tr><td style="width: 30px; height: 20px; text-align: center;">x</td></tr> <tr><td style="width: 30px; height: 20px;"></td></tr> </table> специалист бакалавр магистр		x		Форма обучения <table style="display: inline-table; vertical-align: middle;"> <tr><td style="width: 30px; height: 20px; text-align: center;">x</td></tr> <tr><td style="width: 30px; height: 20px;"></td></tr> <tr><td style="width: 30px; height: 20px;"></td></tr> </table> очная заочная очно-заочная	x		
Уровень подготовки <table style="display: inline-table; vertical-align: middle;"> <tr><td style="width: 30px; height: 20px;"></td></tr> <tr><td style="width: 30px; height: 20px; text-align: center;">x</td></tr> <tr><td style="width: 30px; height: 20px;"></td></tr> </table> специалист бакалавр магистр		x		Форма обучения <table style="display: inline-table; vertical-align: middle;"> <tr><td style="width: 30px; height: 20px; text-align: center;">x</td></tr> <tr><td style="width: 30px; height: 20px;"></td></tr> <tr><td style="width: 30px; height: 20px;"></td></tr> </table> очная заочная очно-заочная	x				
x									
x									

<u>2016</u> <i>(год утверждения учебного плана ООП)</i>	Семестр(ы) <u>8</u>	Количество групп <u>1</u>	
		Количество студентов <u>30</u>	
<u>Плюснина Л.М.</u> <i>(фамилия, инициалы преподавателя)</i>		<u>к.э.н., доцент</u> <i>(должность)</i>	
<u>Гуманитарный</u> <i>(факультет)</i>			
<u>Экономика и финансы</u> <i>(кафедра)(контактная информация)</i>		<u>т. 219-83-32</u>	

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

№	Библиографическое описание (автор, заглавие, вид издания, место, издательство, год издания, количество страниц)	Количество экземпляров в библиотеке
1 Основная литература		
1	Риск-менеджмент : учебник / А. Н. Фомичев .— 2-е изд .— М. : Дашков и К, 2009, 2008 .— 374 с.	7
2	Риск-менеджмент инвестиционного проекта : учебник для вузов / М. В. Грачева [и др.] ; Под ред. М.В. Грачевой, А.Б. Секерина .— Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2009 .— 544 с.	7
3	Риск-менеджмент : учебное пособие / Л.П. Гончаренко, С.А. Филин ; Российская экономическая академия им. Г.В.Плеханова ; Под ред. Е.А. Олейникова .— 3-е изд., стер .— Москва : КНОРУС, 2010, 2009 .— 215 с.	18
4	Управление рисками в предпринимательстве / С. Н. Воробьев, К. В. Балдин .— 3-е изд .— М. : Дашков и К, 2009, 2008, 2006 .— 770 с.	19
5	Управление рисками на предприятии : учебное пособие для вузов / С.М. Васин, В.С. Шутов .— Москва : КНОРУС, 2010 .— 299 с.	7
2 Дополнительная литература		
2.1 Учебные и научные издания		
1	Анализ и управление рисками организации : учебное пособие для вузов / Н. А. Рыхтикова .— 2-е изд .— Москва : ФОРУМ, 2010 .— 239 с.	6
2	Анализ эффективности и рисков предпринимательской деятельности : методологические аспекты / Г. В. Савицкая .— М. : ИНФРА-М, 2008 .— 271 с.	6
3	Риск-менеджмент организации : учебно-практическое пособие / Н. Б. Ермакова .— М. : Дашков и К, 2008 .— 379 с.	6
4	Риск-менеджмент : учебное пособие / К.В. Балдин .— М. : Эксмо, 2006 .— 365 с.	2
5	Риск-менеджмент : учебное пособие для вузов / В.С. Ступаков, Г. С. Токаренко .— М. : Финансы и статистика, 2007 .— 282 с.	5
6	Риск-менеджмент. Практика ведущих компаний : пер. с англ. / Т. Л. Бартон, У. Г. Шенкир, П. Л. Уокер .— М. : Вильямс, 2008 .— 207 с.	1
7	Риск-менеджмент / Ф.Н. Филина .— М. : ГроссМедиа : РОСБУХ, 2008 .— 231 с.	1
8	Управление рисками промышленного предприятия: опыт и рекомендации/ Р. Н. Федосова, О. Г. Крюкова : опыт и рекомендации / Р. Н. Федосова, О. Г. Крюкова .— Москва : Экономика, 2008 .— 125 с.	4
9	Управление предпринимательскими рисками / Л. М. Макаревич .— М. : Дело и Сервис, 2006 .— 443 с.	2
10	Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски : учебное пособие / Е. А. Федорова, Ф. М. Шелопаев, А. И. Ермоленко .— Москва : КНОРУС, 2010 .— 358 с.	3
2.2 Периодические издания		
	Не используются	
2.3 Нормативно-технические издания		
	Не используются	
2.4 Официальные издания		
	Не используются	

	2.5 Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины	
1	Электронная библиотека Научной библиотеки Пермского национального исследовательского политехнического университета [Электронный ресурс : полнотекстовая база данных электрон. документов изданных в Изд-ве ПНИ-ПУ]. — Электрон. дан. (1 912 записей). — Пермь, 2014-2015. — Режим доступа: http://elib.pstu.ru/	
2	Научная Электронная Библиотека eLibrary [Электронный ресурс : полнотекстовая база данных : электрон. журн. на рус., англ., нем. яз. : реф. и наукометр. база данных] / Науч. электрон. б-ка. — Москва, 1869- . — Режим доступа: http://elibrary.ru/ . — Загл. с экрана.	
3	Электронная библиотека диссертаций РГБ [Электронный ресурс : полнотекстовая база данных : электрон. база данных : диссертации и авторефераты диссертаций по всем отраслям знания] / Рос. гос. б-ка. — Москва, 2003- 2015. — Режим доступа: http://diss.rsl.ru/ . — Загл. с экрана.	
4	Консультант Плюс [Электронный ресурс : справочная правовая система : документы и комментарии : универсал. информ. ресурс]. — Версия Проф, сетевая. — Москва, 1992- . — Режим доступа: Компьютер. сеть Науч. б-ки Перм. нац. исслед. политехн. ун-та, свободный	

Основные данные об обеспеченности на «21» сентября 2016 г.,

(дата составления рабочей программы)

основная литература ☒ обеспечена ☐ не обеспечена

дополнительная литература ☒ обеспечена ☐ не обеспечена

Зав. отделом комплектования
научной библиотеки



Н.В. Тюрикова

Данные об обеспеченности на _____

основная литература ☐ обеспечена ☐ не обеспечена

дополнительная литература ☐ обеспечена ☐ не обеспечена

Зав.отделом комплектования
научной библиотеки

Н.В. Тюрикова

Карта книго-
обеспеченности
в библиотеку сдана

8.3. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине

8.3.1 Перечень программного обеспечения, в том числе компьютерные обучающие и контролирующие программы

Не используются

8.4Аудио- и видео-пособия

Таблица 8.3 – Используемые аудио- и видео-пособия

Вид аудио-, видео-пособия				Наименование учебного пособия
теле-фильм	кино-фильм	слайды	аудио-пособие	
1	2	3	4	5
		+		Презентация курса «Управление финансовыми рисками»

9 Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине

9.1 Специализированные лаборатории и классы

Не требуются

9.2 Основное учебное оборудование

Не требуется

Лист регистрации изменений

№ п.п.	Содержание изменения	Дата, номер протокола заседания кафедры. Подпись заведующего кафедрой
1	2	3
1		
2		
3		
4		