

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации

ФИО: Макуев Валентин Анатольевич

Мытищинский филиал

Должность: Заместитель директора по учебной работе

федерального государственного бюджетного образовательного учреждения высшего

Дата подписания: 23.06.2024 15:15:55

Уникальный программный ключ:

образования «Московский государственный технический университет имени Н. Э. Баумана

a0887579b7e63594c87851bc1bb030c7c4482fa1

(национальный исследовательский университет)»

(МГТУ им. Н. Э. Баумана)



Заместитель директора

по учебной работе

МФ МГТУ им. Н.Э. Баумана

Макуев В.А.

«25» июня 2021 г.

Факультет К «Космический факультет»

Кафедра К4 «Экономика и управление»

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Управление финансовыми рисками и страхование

Автор программы:

Тихомиров Е.А., доцент (к.н.), кандидат экономических наук, tihomirov@bmstu.ru

Утверждена на заседании кафедры «Экономика и управление»
Протокол № 10 заседания кафедры «К4» от 09.06.2021 г.

Начальник Отдела образовательных программ
Шевлякова А.А



Рабочая программа одобрена на 2022/2023 учебный год.
Протокол № 8 заседания кафедры «К4» от 15.04.2022 г.
Лист переутверждения рабочей программы дисциплины / практики.

Оглавление

1. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю), соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы.....	4
2. Место дисциплины в структуре образовательной программы	6
3. Объем дисциплины.....	7
4. Содержание дисциплины, структурированное по модулям учебной дисциплины с указанием отведенного на них количества академических или астрономических часов и видов учебных занятий.....	8
5. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов.....	13
6. Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации студентов по дисциплине.....	14
7. Перечень учебной литературы и дополнительных материалов, необходимых для освоения дисциплины	15
8. Перечень ресурсов сети интернет, рекомендуемых для самостоятельной работы при освоении дисциплины.....	16
9. Методические указания для студентов по освоению дисциплины	17
10. Перечень информационных технологий, используемых при изучении дисциплины, включая перечень программного обеспечения, информационных справочных систем и профессиональных баз данных	18
11. Описание материально-технической базы, необходимой для изучения дисциплины.....	19

1. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ), СООТНЕСЕННЫЕ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Настоящая рабочая программа дисциплины устанавливает требования к знаниям и умениям студента, а также определяет содержание и виды учебных занятий и отчетности.

Программа разработана в соответствии с:

- Самостоятельно устанавливаемыми образовательными стандартами (СУОС 3++) по направлениям подготовки (уровень магистратуры): 38.04.01 «Экономика», 38.04.02 «Менеджмент»;

- Основными профессиональными образовательными программами по направлениям подготовки 38.04.01 «Экономика», 38.04.02 «Менеджмент»;

- Учебными планами МГТУ им. Н.Э. Баумана по направлениям подготовки 38.04.01 «Экономика», 38.04.02 «Менеджмент».

При освоении дисциплины планируется формирование компетенций, предусмотренных ОПОП на основе СУОС 3++ по направлениям подготовки 38.04.01 «Экономика», 38.04.02 «Менеджмент» (уровень магистратуры)

Код компетенции по СУОС 3++	Формулировка компетенции
	Универсальные компетенции собственные
УКС-1 (38.04.01)	Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, выработать стратегию действий с использованием междисциплинарного подхода, формулировать выводы, адекватные полученным результатам, проводить прогнозирование, ставить исследовательские задачи и выбирать пути их достижения
УКС-2 (38.04.02)	Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла, действовать в нестандартных ситуациях, нести социальную и этическую ответственность за принятые решения
	Профессиональные компетенции собственные
ПКС-3 (38.04.01/31 Внешнеэкономическая деятельность и международный бизнес)	Способен к организации работ по внешнеэкономической деятельности

Для категорий «знать, уметь, владеть» планируется достижение результатов обучения (РО), вносящих на соответствующих уровнях вклад в формирование компетенций, предусмотренных основной профессиональной образовательной программой (табл. 1).

Таблица 1. Индикаторы достижения компетенции

1	2	3
Компетенция: код по СУОС 3++, формулировка	Индикаторы	Формы и методы обучения, способствующие формированию и развитию компетенции
<p>УКС-1 (38.04.01) Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий с использованием междисциплинарного подхода, формулировать выводы, адекватные полученным результатам, проводить прогнозирование, ставить исследовательские задачи и выбирать пути их достижения</p>	<p>ЗНАТЬ - методы выявления и решения проблемной ситуации УМЕТЬ - применять методы системного и критического анализа для решения проблемных ситуаций - разрабатывать стратегию действий, принимать конкретные решения для ее реализации</p>	<p>Лекции Семинары Самостоятельная работа Активные и интерактивные формы (методы) обучения: обсуждение практических примеров на лекциях и семинарах</p>
<p>УКС-2 (38.04.02) Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла, действовать в нестандартных ситуациях, нести социальную и этическую ответственность за принятые решения</p>	<p>УМЕТЬ - управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла, в том числе в нестандартных ситуациях ВЛАДЕТЬ - методами оценки потребности в ресурсах и эффективности проекта, в том числе его экологической и социальной значимости</p>	<p>Лекции Семинары Самостоятельная работа Активные и интерактивные формы (методы) обучения: обсуждение практических примеров на лекциях и семинарах</p>
<p>ПКС-3 (38.04.01/31 Внешнеэкономическая деятельность и международный бизнес) Способен к организации работ по внешнеэкономической деятельности</p>	<p>ЗНАТЬ - методы и основы системного анализа внешнеэкономической информации УМЕТЬ - рассчитывать финансовые показатели эффективности внешнеэкономической деятельности организации</p>	<p>Лекции Семинары Самостоятельная работа Активные и интерактивные формы (методы) обучения: обсуждение практических примеров на лекциях и семинарах</p>

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Дисциплина входит в блок Б1 «Дисциплины (модули)» образовательных программ магистратуры по направлениям 38.04.01 «Экономика», 38.04.02 «Менеджмент».

Изучение дисциплины предполагает предварительное освоение следующих дисциплин учебного плана:

- Предпринимательская деятельность (для 38.04.02);
- Международная инвестиционная деятельность (для 38.04.01).

Освоение данной дисциплины необходимо как предшествующее для следующих дисциплин образовательной программы:

- Принятие управленческих решений в международном бизнесе (для 38.04.01);
- Управление международными проектами (для 38.04.01);
- Управленческая экономика (для 38.04.02);
- Маркетинг инновационных продуктов (для 38.04.02).

Освоение учебной дисциплины связано с формированием компетенций с учетом матриц компетенций ОПОП для направлений (уровень магистратуры): 38.04.01 Экономика, 38.04.02 Менеджмент.

3. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ

Общий объем дисциплины составляет 2 зачетные единицы(з.е.), 72 академических часа (54 астрономических часа). В том числе: 1 семестр – 2 з.е. (72 ак.ч.).

Таблица 2. Объем дисциплины по видам учебных занятий (в академических часах)

Виды учебной работы	Объем по семестрам, акад. ч.	
	Всего	Количество семестров освоения дисциплины
		1
Объем дисциплины	72	72
Аудиторная работа*	36	36
Лекции (Л)	18	18
Семинары (С)	18	18
Самостоятельная работа (СР)	36	36
Проработка учебного материала лекций	2.25	2.25
Подготовка к семинарам	2.25	2.25
Подготовка к рубежному контролю	3	3
Другие виды самостоятельной работы	28.5	28.5
Вид промежуточной аттестации		Зачёт

*в том числе, в форме практической подготовки

4. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ, СТРУКТУРИРОВАННОЕ ПО МОДУЛЯМ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ С УКАЗАНИЕМ ОТВЕДЕННОГО НА НИХ КОЛИЧЕСТВА АКАДЕМИЧЕСКИХ ИЛИ АСТРОНОМИЧЕСКИХ ЧАСОВ И ВИДОВ УЧЕБНЫХ ЗАНЯТИЙ

Таблица 3. Содержание дисциплины

№ п/п	Тема (название) модуля	Виды занятий*, часы				Активные и интерактивные формы проведения занятий		Компетенции, закрепленные за темой (код по СУОС 3++)	Текущий контроль результатов обучения		
		Л	С	ЛР	СР	Форма проведения занятий	Часы		Срок (неделя)	Формы	Баллы (мин/макс)
1 семестр											
1	Сущность и управление финансовыми рисками. Эффективность страхования в управлении и диверсификации финансовых рисков	18	18	0	36	обсуждение практических примеров на лекциях	12	УКС-1, УКС-2, ПКС-3	18	Рубежный контроль	60/100
	ИТОГО за семестр	18	18	0	36	-	12	-	-	-	60/100

*в том числе, в форме практической подготовки

№, п/п	Наименование модуля, содержание	Часы
1	«Сущность и управление финансовыми рисками. Эффективность страхования в управлении и диверсификации финансовых рисков»	
	Лекции	18
1.1	Сущность, содержание и функции управления финансовым риском в рыночной экономике. Финансовые риски и финансовое управление в рыночной экономике. Сущность и функции финансового риска, принципы управления финансовым риском. Система управления финансовым риском: управляемая и управляющая подсистемы. Особенности организации управления финансовым риском на предприятии. Финансовый риск-менеджмент как форма предпринимательства. Финансовые рычаги и финансовые риски.	2
1.2	Содержание приемов и методов управления финансовым риском. Основные приемы, их назначение и классификация. Современные приемы управления финансовым риском (инновации в финансовом риске). Методы управления финансовым риском: самострахование и страхование, избежание риска (уклонение от риска), удержание риска (принятие риска на себя, самострахование), передача риска (страхование, двойное страхование, сострахование, перестрахование, ретроцессия).	2
1.3	Процесс управления финансовым риском. Содержание, стадии и структура процесса управления финансовыми рисками. Выявление потенциальных рисков, связанных с финансовой деятельностью фирмы (первая стадия процесса). Выявление факторов, влияющих на уровень финансовых рисков (вторая стадия процесса). Оценка и ранжирование финансовых рисков (третья стадия процесса). Разработка стратегии и тактики (программы) управления финансовыми рисками (четвертая стадия процесса).	2
1.4	Сущность и виды финансовых рисков. Различные определения финансового риска. Сущность финансового риска. Объективная и субъективная основа финансового риска. Виды возможных финансовых потерь, включаемые в определение финансового риска. Финансовые риски внутри финансовой деятельности фирмы. Финансовые риски и внешняя финансовая среда деятельности фирмы. Характеристика признаков финансовых рисков и факторов их развития.	2
1.5	Процесс идентификации финансовых рисков. Идентификация рискованных обстоятельств объективной и субъективной, внешней и внутренней природы при выявлении потенциальных рисков и факторов их развития в финансовой деятельности фирмы. Классификация методов оценки и анализа финансовых рисков. Количественные методы оценки и анализа финансовых рисков: методы математической статистики: метод математического ожидания, метод стандартного отклонения, метод коэффициента вариации, методы корреляционно-регрессионного анализа – коэффициенты парной и множественной корреляции, коэффициент детерминации, коэффициент Дарбина – Уотсона (DW), ранговой корреляции, уравнения регрессии, коэффициента эластичности, множественной регрессии); методы дисперсионного анализа, метод главных компонент, методы кластерного анализа, методы дискриминантного анализа; расчетно-аналитические методы: метод коэффициента риска,	2

	методы оценки финансовой устойчивости и платежеспособности, метод ставки процента с поправкой на риск, метод критических значений, метод одного значения, метод корректировки, метод нескольких значений, метод анализа безубыточности, метод анализа чувствительности, метод анализа сценариев, методы многофакторного анализа.	
1.6	Анализ эффективности страхования и самострахования как двух главных методов управления финансовыми рисками. Особенности оценки эффективности методов управления финансовыми рисками. Общие подходы к оценке эффективности методов управления финансовыми рисками. Экономические критерии оценки эффективности управления финансовыми рисками. Анализ сравнительной экономической эффективности страхования и самострахования финансовых рисков методом Хаустона.	2
1.7	Виды страхования финансовых рисков. Имущественное страхование финансовых рисков: страхование потери прибыли вследствие вынужденной остановки производства, страхование финансовых инвестиций, страхование финансовых гарантий, страхование облигаций, страхование кредитных рисков, страхование банковских рисков, страхование инвестиций. Новые виды имущественного страхования финансовых рисков: страхование аварийных денег, страхование делькредере, страхование денежной наличности на время перевозки, страхование денежных средств, страхование депозитов, страхование дополнительных расходов, страхование доходов от инвестиций, страхование кредитной карты, страхование на случай уменьшения стоимости заложенного имущества, страхование обратного потока денежных средств, страхование остаточной стоимости, страхование от колебания курсов валют, страхование портфеля ценных бумаг, страхование после пусковых гарантийных обязательств, страхование по стоимости замены, страхование прав владения активами, полученными в обмен на долговые обязательства за рубежом, страхование правового титула, страхование производителя продукции на случай применения штрафных санкций, страхование потери прибыли, страхование риска неплатежа, страхование финансовых обязательств, страхование фрахта, страхование на случай аннулирования или не ратификации контракта.	2
1.8	Биржевое самострахование (хеджирование) финансовых рисков с использованием производных финансовых инструментов. Инвестиции как объект страхования. Особенности видов инвестиций как объектов страхования. Виды рисков в инвестиционной деятельности: общие риски, технические риски, специальные риски, риски хозяйственной деятельности. Особенности страхования рисков инвестиционной деятельности. Методы организации страховой защиты инвестиций: самострахование, страхование, сострахование, перестрахование, государственные гарантии и полугосударственные гарантийные фонды.	2
1.9	Самострахование финансовых рисков методом диверсификации. Сущность диверсификации как метода управления финансовым риском. Стратегии и тактика диверсификации. Виды диверсификации финансовых рисков: горизонтальная и вертикальная диверсификация, диверсификация видов деятельности и зон хозяйствования, диверсификация сбыта и поставок, диверсификация инвестиций и источников их финансирования, распределение ответственности в многосторонних сделках, распределение риска во времени, диссипация как комбинация видов диверсификации.	2
	Семинары	18

C1.1	Сущность, содержание и функции управления финансовым риском в рыночной экономике. Правовое и методологическое обеспечение управления финансовым риском. Информационно-аналитическое обеспечение управления финансовым риском. Сферы управления финансовым риском. Аппарат управления риском: звенья, уровни, организации. Организация управления риском на предприятии: службы, их задачи и функции.	2
C1.2	Содержание приемов и методов управления финансовым риском. Основные приемы, их назначение и классификация. Современные приемы управления финансовым риском (инновации в финансовом риске). Методы управления финансовым риском: объединение риска, снижение степени риска (превентивная локализация и минимизация риска), лимитирование, диверсификация риска (метод диссипации), хеджирование риска, использование внутренних финансовых нормативов.	2
C1.3	Процесс управления финансовым риском. Выбор методов, приемов и определение путей нейтрализации финансовых рисков (пятая стадия процесса). Применение выбранных методов, приемов нейтрализации финансовых рисков с учетом заданных целей и задач (шестая стадия процесса). Оценка результатов применения методов и приемов управления финансовыми рисками с учетом отклонений ожидаемых и фактических результатов (седьмая стадия процесса). Корректировка выбранных целей, задач, методов и приемов, ожидаемых результатов управления финансовыми рисками (восьмая стадия процесса).	2
C1.4	Сущность и виды финансовых рисков. Классификация видов финансовых рисков по: возможности страхования и самострахования, уровню финансовых потерь, сфере возникновения, возможности предвидения, длительности действия, виду ущерба, объекту возникновения, кумуляции, диверсификации, ожидаемым экономическим результатам, видам финансовых операций, возможности дальнейшей классификации.	2
C1.5	Процесс идентификации финансовых рисков. Идентификация рискованных обстоятельств объективной и субъективной, внешней и внутренней природы при выявлении потенциальных рисков и факторов их развития в финансовой деятельности фирмы. Классификация методов оценки и анализа финансовых рисков. Качественные методы оценки и анализа финансовых рисков: экспертные методы оценки, аналоговые методы оценки (историко-ассоциативные и литературно-фантастические аналогии), метод концептуальных переносов, метод рейтинговых оценок, метод «должного внимания» (метод «Due Diligence»), метод «дерево решений», метод построения «деревьев событий», метод «события – последствия», метод «деревьев отказов», метод индексов опасности. Комбинированные качественно-количественные методы оценки и анализа финансовых рисков: методы имитационного моделирования, метод Дельфи, метод «Монте-Карло».	2
C1.6	Анализ эффективности страхования и самострахования как двух главных методов управления финансовыми рисками. Особенности оценки эффективности методов управления финансовыми рисками. Общие подходы к оценке эффективности методов управления финансовыми рисками. Экономические критерии оценки эффективности управления финансовыми рисками. Анализ сравнительной экономической эффективности страхования и самострахования финансовых рисков методом Хаустона.	2
C1.7	Виды страхования финансовых рисков.	2

	Страхование финансовых рисков в личном страховании: накопительное страхование-вклад по полису «с прибылью», страхование жизни с участием в прибыли, кредитное страхование жизни, страхование жизни с обеспечением семейного дохода, страхование закладной, кредитное страхование здоровья, страхование от медицинских расходов, страхование от накладных (общих) расходов, страхование пенсии, страхование ренты, страхование пенсии с инвестиционным планом.	
С1.8	Биржевое самострахование (хеджирование) финансовых рисков с использованием производных финансовых инструментов. Страхование инвестиций от политических рисков. Страхование имущественных интересов инвесторов от технических рисков. Титульное страхование (страхование вещных прав инвестора). Классификация производных финансовых инструментов как методов самострахования финансовых рисков: опционы, форварды, фьючерсы, свопы и другие финансово – кредитные деривативы. Сущность и виды хеджирования. Основные виды стратегий хеджирования и биржевая спекуляция.	2
С1.9	Самострахование финансовых рисков методом диверсификации. Виды диверсификации финансовой деятельности фирмы: диверсификация покупателей, диверсификация фондового портфеля формы, диверсификация депозитного портфеля фирмы, диверсификация валютной корзины, диверсификация проектов реальных инвестиций.	2
	Самостоятельная работа	36
СР1.1	Проработка учебного материала лекций	2.25
СР1.2	Подготовка к семинарам	2.25
СР1.3	Подготовка к рубежному контролю	3
СР1.4	Другие виды самостоятельной работы	28.5

5. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ СТУДЕНТОВ

Самостоятельная работа студентов по дисциплине обеспечивается следующими учебно-методическими материалами:

1. Рабочая программа дисциплины.
2. Учебная литература и дополнительные материалы [Раздел 7 Рабочей программы дисциплины].
3. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» [Раздел 8 Рабочей программы дисциплины].
4. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины [Раздел 9 Рабочей программы дисциплины], обеспечивающие самостоятельную работу студента при подготовке к учебным занятиям, выполнении домашних работ, подготовке к контрольным мероприятиям и аттестациям.
5. Комплект индивидуальных заданий.

Студенты получают доступ к указанным материалам начиная с первого занятия по дисциплине.

6. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ СТУДЕНТОВ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Фонд оценочных средств (ФОС) для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине базируется на перечне компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы (раздел 1). ФОС обеспечивает объективный контроль достижения всех результатов обучения, запланированных для дисциплины.

ФОС включает в себя:

- перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы;
- описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания;
- типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, владений и (или) опыта деятельности, характеризующие этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы;
- методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, владений и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций.

Контроль освоения дисциплины производится в соответствии с Положением о текущем контроле успеваемости и промежуточной аттестации студентов МГТУ им. Н.Э. Баумана.

ФОС является приложением к данной рабочей программе дисциплины.

7. ПЕРЕЧЕНЬ УЧЕБНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ И ДОПОЛНИТЕЛЬНЫХ МАТЕРИАЛОВ, НЕОБХОДИМЫХ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Литература по дисциплине

1. Лукасевич, И. Я. Финансовый менеджмент в 2 ч. Часть 1. Основные понятия, методы и концепции : учебник и практикум для вузов / И. Я. Лукасевич. — 4-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 377 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-03726-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/468698>
2. Финансовый менеджмент: проблемы и решения в 2 ч. Часть 2 : учебник для вузов / А. З. Бобылева [и др.] ; под редакцией А. З. Бобылевой. — 4-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 291 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-14718-6. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/479363>
3. Управление финансовыми рисками : учебник и практикум для вузов / И. П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И. П. Хоминич. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 569 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-13380-6. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/458713>
4. Румянцева, Е. Е. Инвестиционный анализ : учебное пособие для вузов / Е. Е. Румянцева. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 281 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-10389-2. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/471322>

Дополнительные материалы

5. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент: учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2020. — 365 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-3502-8. — Текст: электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/450164>
6. Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе: учебник и практикум для среднего профессионального образования / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2020. — 381 с. — (Профессиональное образование). — ISBN 978-5-534-10194-2. — Текст: электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/456446>
7. Основы риск-менеджмента / Д. Гэлаи, М. Кроуи, В. Б. Минасян, Р. Марк. — Москва: Издательство Юрайт, 2020. — 390 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02578-1. — Текст: электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/449729>
8. Воронцовский, А. В. Оценка рисков: учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 179 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02411-1. — Текст: электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/452702>

8. ПЕРЕЧЕНЬ РЕСУРСОВ СЕТИ ИНТЕРНЕТ, РЕКОМЕНДУЕМЫХ ДЛЯ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ ПРИ ОСВОЕНИИ ДИСЦИПЛИНЫ

1. Сайт кафедры «Экономика и управление»: <https://mf.bmstu.ru/info/faculty/kf/caf/k4/>
2. Открытая информационная группа кафедры в социальной сети «Instagram»: https://www.instagram.com/k4_bmstu/
3. Российская государственная библиотека. <http://www.rsl.ru>.
4. Государственная публичная научно-техническая библиотека России. <http://www.gpntb.ru>.
5. Библиотека МГТУ им. Н.Э. Баумана. <http://library.bmstu.ru>.
6. Научно-техническая библиотека КФ МГТУ им. Н.Э. Баумана. <http://library.bmstu-kaluga.ru>.
7. Научная электронная библиотека <http://eLIBRARY.RU>.
8. Электронно-библиотечная система издательства «Лань» <http://e.lanbook.com>.
9. Электронно-библиотечная система «Университетская библиотека онлайн» <http://biblioclub.ru>.
10. Электронно-библиотечная система «IPRbooks» <http://www.iprbookshop.ru>.
11. Электронно-библиотечная система (ЭБС) «Юрайт» <https://biblio-online.ru>.
12. Центральная библиотека образовательных ресурсов Минобрнауки РФ. www.edulib.ru.
13. Единая коллекция цифровых образовательных ресурсов <http://school-collection.edu.ru>.
14. Федеральный центр информационно-образовательных ресурсов. <http://fcior.edu.ru>.
15. Журнал «Коммерсант» – www.kommersant.ru;
16. Журнал «Менеджмент в России и за рубежом» - www.dis.ru/manag
17. Журнал «Проблемы теории и практики управления» - www.uptp.ru
18. Журнал «Управление персоналом» - www.top-personal.ru
19. Журнал «Экономика России: XXI век» – www.ruseconomy.ru;
20. Журнал «Экономист» – www.economist.com.ru;
21. Журнал «Эксперт» – <http://www.expert.ru>;
22. Институт суверенных фондов благосостояния – www.swfinstitute.org;
23. Институт экономического анализа – <http://www.iea.ru>;
24. Международный валютный фонд, МВФ (International Monetary Fund, IMF) -- <http://www.imf.org/external/russian/index.htm>;
25. Международный институт стратегических исследований – www.iiss.org;
26. Министерство образования РФ – www.edu.ru;
27. Министерство финансов – <http://www.minfin.ru>;
28. Московский центр качества образования – <http://www.mcko.ru/>;
29. Научная электронная библиотека «Elibrary» – <http://elibrary.ru/defaultx.asp>;
30. Открытая электронная библиотека «Киберленинка» – <http://cyberleninka.ru>;
31. Портал «Электронные журналы» – <http://www.eduhmao.ru/info-информационно-просветительский>;
32. Путеводитель по справочным и библиографическим ресурсам – <http://www.nlr.ru/res/inv/guideseria/pedagogica/>;
33. Федеральная служба государственной статистики – <http://www.gks.ru/>;
34. Электронная библиотека диссертаций – www.diss.rsl.ru
35. Электронная библиотека диссертаций Российской государственной библиотеки <http://elibrary.rsl.ru>;
36. Электронная библиотека РФФИ – <http://www.rfbr.ru/rffi/ru/>

9. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ СТУДЕНТОВ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

Приступая к работе, каждый студент должен принимать во внимание нижеследующие положения.

Дисциплина построена по модульному принципу, каждый модуль представляет собой логически завершённый раздел курса. Дисциплина делится на один модуль.

На первом занятии студент получает информацию для доступа к комплексу учебно-методических материалов по дисциплине.

Лекционные занятия посвящены рассмотрению ключевых, базовых положений курса и разъяснению учебных заданий, выносимых на самостоятельную проработку.

Семинарские занятия проводятся для закрепления усвоенной информации, приобретения навыков ее применения для решения практических задач в предметной области дисциплины.

Практическая подготовка при реализации учебной дисциплины организуется путем проведения практических занятий, практикумов, лабораторных работ и индивидуальных и(или) групповых консультаций, предусматривающих участие обучающихся в выполнении отдельных элементов работ, связанных с будущей профессиональной деятельностью.

Практическая подготовка может включать в себя отдельные занятия лекционного типа, которые предусматривают передачу учебной информации обучающимся, необходимой для последующего выполнения работ, связанных с будущей профессиональной деятельностью.

Самостоятельная работа студентов включает следующие виды: проработка учебного материала лекций, подготовка к семинарам, подготовка к рубежному контролю. Результаты всех видов работы студентов формируются в виде их личного рейтинга, который учитывается на промежуточной аттестации. Самостоятельная работа предусматривает не только проработку материалов лекционного курса, но и их расширение в результате поиска, анализа, структурирования и представления в компактном виде современной информации из всех возможных источников.

Текущий контроль проводится в течение каждого модуля, его итоговые результаты складываются из оценок по следующим видам контрольных мероприятий:
- Рубежный контроль.

Освоение дисциплины и ее успешное завершение на стадии промежуточной аттестации возможно только при регулярной работе во время семестра и планомерном прохождении текущего контроля. Набрать рейтинг по всем модулям в каждом семестре, пройти по каждому модулю плановые контрольные мероприятия в течение экзаменационной сессии невозможно.

Для завершения работы в семестре студент должен выполнить все контрольные мероприятия.

Промежуточная аттестация по дисциплине проходит в форме зачета.

Методика оценки по рейтингу

Студент, выполнивший все предусмотренные учебным планом задания и сдавший все контрольные мероприятия, получает итоговую оценку по дисциплине за семестр в соответствии со шкалой:

Рейтинг	Оценка на зачете
85 – 100	Зачтено
71 – 84	Зачтено
60 – 70	Зачтено
0 – 59	Не зачтено

Оценивание дисциплины ведется в соответствии с Положением о текущем контроле успеваемости и промежуточной аттестации студентов МГТУ им. Н.Э. Баумана.

10. ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ИЗУЧЕНИИ ДИСЦИПЛИНЫ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ, ИНФОРМАЦИОННЫХ СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ И ПРОФЕССИОНАЛЬНЫХ БАЗ ДАННЫХ

Информационные технологии:

- Электронная информационно-образовательная среда МГТУ им. Н.Э. Баумана обеспечивает доступ к учебным планам, рабочим программам дисциплин (модулей), программам практик, электронным учебным изданиям и электронным образовательным ресурсам, указанным в рабочих программах дисциплин (модулей), программах практик, формирование электронного портфолио обучающегося, в том числе сохранение его работ и оценок за эти работы. Предусмотрена возможность синхронного и асинхронного взаимодействия студентов и преподавателей посредством технологий и служб по пересылке и получению электронных сообщений между пользователями компьютерной сети Интернет.
- e-mail преподавателя для оперативной связи: tihomirov@bmstu.ru

Программное обеспечение:

- 7-Zip
- Acrobat Reader
- Microsoft Office
- Windows

Информационные справочные системы:

- Информационно-правовая система «Гарант» <http://www.garant.ru>;
- Информационно-правовая система «Консультант Плюс» <http://www.consultant.ru>;

Профессиональные базы данных:

- Государственная статистика РФ – <http://fedstat.ru/indicator/33387>;
- Европейская статистика – <http://ec.europa.eu/eurostat/>

**11. ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ
ДЛЯ ИЗУЧЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ**

Перечень материально-технического обеспечения дисциплины

№, п/п	Вид занятий	Вид и наименование оборудования
1	Лекции	специально оборудованные аудитории с мультимедийными средствами, средствами звуковоспроизведения и имеющими выход в сеть Интернет; помещения для проведения аудиторных занятий, оборудованные учебной мебелью; аудитории, оснащенные компьютерами с доступом к базам данных и сети Интернет; студии; компьютерные классы.
2	Семинары	специально оборудованные аудитории с мультимедийными средствами, средствами звуковоспроизведения и имеющими выход в сеть Интернет; помещения для проведения аудиторных занятий, оборудованные учебной мебелью; аудитории, оснащенные компьютерами с доступом к базам данных и сети Интернет; студии; компьютерные классы.
3	Самостоятельная работа	библиотека, имеющая рабочие места для студентов; выставочные залы; аудитории, оснащенные компьютерами с доступом к сети Интернет. Социокультурное пространство университета позволяет студенту качественно выполнять самостоятельную работу.

ЛИСТ ВНЕСЕНИЯ ИЗМЕНЕНИЙ

1). П.7. ПЕРЕЧЕНЬ ОСНОВНОЙ И ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ УЧЕБНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ, ЧИТАТЬ В СЛЕДУЮЩЕЙ РЕДАКЦИИ:

7. Перечень учебной литературы и дополнительных материалов, необходимых для освоения дисциплины

Литература по дисциплине:

1. ФИНАНСОВЫЙ МЕНЕДЖМЕНТ В 2 Ч. ЧАСТЬ 1. ОСНОВНЫЕ ПОНЯТИЯ, МЕТОДЫ И КОНЦЕПЦИИ 4-е изд., пер. и доп. Учебник и практикум для вузов / Лукасевич И. Я. - 2021. - URL: <https://urait.ru/book/FAB48DD3-C39B-4CA0-8614-C6B732A40C36>.
2. ИНВЕСТИЦИОННЫЙ АНАЛИЗ. Учебное пособие для вузов / Румянцева Е. Е. - 2021. - URL: <https://urait.ru/book/728398EE-C4CF-495A-99D2-D8DA17E1E1C2>.
3. УПРАВЛЕНИЕ ФИНАНСОВЫМИ РИСКАМИ 2-е изд., испр. и доп. Учебник и практикум для вузов / Под ред. Хоминич И.П. - 2021. - URL: <https://urait.ru/book/4A5CD698-70AA-4F20-96D8-BEE3EB9C6FE0>.
4. ФИНАНСОВЫЙ МЕНЕДЖМЕНТ: ПРОБЛЕМЫ И РЕШЕНИЯ В 2 Ч. ЧАСТЬ 2 4-е изд., пер. и доп. Учебник для вузов / Под ред. Бобылевой А.З. - 2021. - URL: <https://urait.ru/book/F4326981-80AB-4B3E-B372-5F24E2101E17>.

2). П.10. ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ИЗУЧЕНИИ ДИСЦИПЛИНЫ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ИНФОРМАЦИОННЫХ СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ, ЧИТАТЬ В СЛЕДУЮЩЕЙ РЕДАКЦИИ:

10. Перечень информационных технологий, используемых при изучении дисциплины, включая перечень программного обеспечения, информационных справочных систем и профессиональных баз данных

Программное обеспечение:

- 7-Zip
- Foxit Reader
- LibreOffice

Преподаватель кафедры:

Тихомиров Е.А., доцент (к.н.), кандидат экономических наук, tihomirov@bmstu.ru