



Федеральное агентство по рыболовству
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Калининградский государственный технический университет»
(ФГБОУ ВО «КГТУ»)

УТВЕРЖДАЮ
Начальник УРОПС

Рабочая программа дисциплины
«ОЦЕНКА И УПРАВЛЕНИЕ ФИНАНСОВЫМИ РИСКАМИ»

основной профессиональной образовательной программы магистратуры
по направлению подготовки
38.04.08 ФИНАНСЫ И КРЕДИТ

Профиль программы
«УПРАВЛЕНИЕ КОРПОРАТИВНЫМИ ФИНАНСАМИ»

ИНСТИТУТ
ВЫПУСКАЮЩАЯ КАФЕДРА
РАЗРАБОТЧИК

Отраслевой экономики и управления
Экономики и финансов
УРОПС

1 ЦЕЛЬ И ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1 Целью освоения дисциплины «Оценка и управление финансовыми рисками» является формирование у магистрантов теоретических знаний и практических навыков в области управления финансовыми рисками в деятельности хозяйствующих субъектов, разработки эффективных управленческих решений, нацеленных на повышение устойчивости организации.

1.2 Процесс изучения дисциплины направлен на формирование элементов следующих компетенций в соответствии с ФГОС ВО и ОПОП ВО по данному направлению подготовки.

Таблица 1 – Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с установленными компетенциями

Код и наименование компетенции	Наименование дисциплины	Результаты обучения (владения, умения и знания), соотнесенные с компетенциями
ОПК-4: Способен обосновывать и принимать финансово-экономические и организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности.	Оценка и управление финансовыми рисками	<u>Знать:</u> - категорийно-понятийный аппарат управления финансовыми рисками организации; - законодательство РФ и отраслевые стандарты по управлению рисками; - основы расчета и анализа показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов с точки зрения управления финансовыми рисками; - методы оценки и инструменты управления финансовыми рисками организации с использованием современных технических средств. <u>Уметь:</u> - анализировать и интерпретировать информацию, определять причинно-следственные связи в ходе выявления финансовых рисков; - выявлять, регистрировать, анализировать и классифицировать риски, формировать карты риска субъекта хозяйствования; - представлять информацию о рисках по разным стандартам риск-менеджмента; - разрабатывать мероприятия по управлению финансовыми рисками в целях устойчивого развития субъекта хозяйствования. <u>Владеть:</u> - навыками анализа различных источников информации с целью выявления, оценки и управления финансовыми рисками в деятельности хозяйствующих субъектов и принятия соответствующих управленческих решений; - навыками количественного и качественного анализа финансовых рисков организации; - умениями получения и обработки информации, необходимой для оценки финансовых рисков и разработки управленческих решений; - методами управления рисками в процессе финансово-хозяйственной деятельности организации.

2 ТРУДОЁМКОСТЬ ОСВОЕНИЯ, СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ, ФОРМЫ АТТЕСТАЦИИ ПО НЕЙ

Дисциплина "Оценка и управление финансовыми рисками" относится к блоку 1 обязательной части.

Общая трудоемкость дисциплины составляет 7 зачетных единиц (з.е.), т.е. 252 академических часа (189 астр. часов) контактной и самостоятельной учебной работы студента; работой, связанной с текущей и промежуточной (заключительной) аттестацией по дисциплине.

Распределение трудоемкости освоения дисциплины по семестрам, видам учебной работы студента, а также формы контроля приведены ниже.

Таблица 2 - Объем (трудоёмкость освоения) в заочной форме обучения и структура дисциплины

Наименование	Курс	Сессия	Форма контроля	з.е.	Акад. часов	Контактная работа				СРС	Подготовка и аттестация в период сессии
						Лек	Лаб	Пр	РЭ		
Оценка и управление финансовыми рисками	2	Зимняя	З	7	108	4	-	4	4	92	4
		Летняя	Контр., Э		144	6	-	10	8	111	9
Итого по дисциплине:				7	252	10	-	14	12	203	13

Обозначения: Э – экзамен; З – зачет; ДЗ – дифференцированный зачет (зачет с оценкой); КР (КП) – курсовая работа (курсовой проект); контр. – контрольная работа, РГР – расчетно-графическая работа; Лек – лекционные занятия; Лаб. – лабораторные занятия; Пр. – практические занятия; РЭ – контактная работа с преподавателем в ЭИОС; КА – контактная работа, включающая индивидуальные консультации, консультации перед экзаменом, аттестацию, консультации и аттестацию по КР(КП), практику; СРС – самостоятельная работа студентов

При разработке образовательной технологии организации учебного процесса основной упор сделан на соединение активной и интерактивной форм обучения. Интерактивная форма позволяет студентам проявить самостоятельность в освоении теоретического материала и овладении практическими навыками, формирует интерес и позитивную мотивацию к учебе.

3 УЧЕБНАЯ ЛИТЕРАТУРА И УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ СТУДЕНТА

Учебно-методическое обеспечение дисциплины приведено в таблицах 3 и 4.

Таблица 3 – Перечень основной и дополнительной литературы

Наименование дисциплины	Основная литература	Дополнительная литература
Оценка и управление финансовыми рисками	1. Балабин, А. А. Управление рисками: учебное пособие / А. А. Балабин. — Новосибирск: НГТУ, 2022. — 128 с. — ISBN 978-5-7782-4850-2. — Текст: электронный // Лань: электронно-библиотечная система. — URL: https://e.lanbook.com/book/404744 (дата обращения: 08.07.2025). — Режим доступа: для авториз. пользователей. 2. Жулева, О. И. Финансовый менеджмент и управление финансовыми рисками: учебное пособие / О. И. Жулева. — Санкт-Петербург: СПбГУП, 2020. — 99 с. — ISBN 978-5-7621-1094-5. —: электронный // Лань: электронно-библиотечная система. — URL: https://e.lanbook.com/book/215423 (дата обращения: 09.07.2025). — Режим доступа: для авториз. пользователей. 3. Зайцева, О. П. Страхование: учебное пособие / О. П. Зайцева. — Омск: Омский ГАУ, 2022. — 107 с. — ISBN 978-5-907507-39-5. — Текст: электронный // Лань: электронно-библиотечная система. — URL: https://e.lanbook.com/book/202250 (дата обращения: 08.07.2025). — Режим доступа: для авториз. пользователей. 4. Первушина, Т. Л. Оценка и анализ рисков: учебное пособие / Т. Л. Первушина. — Красноярск: СибГУ им. академика М. Ф. Решетнёва, 2022. — 76 с. — Текст: электронный // Лань: электронно-библиотечная система. — URL: https://e.lanbook.com/book/330179 (дата обращения: 08.07.2025). — Режим доступа: для авториз. пользователей. 5. Шеверева, Е. А. Оценка рисков: учебное пособие / Е. А. Шеверева, С. И. Богатырев. — Москва: РТУ МИРЭА, 2022. — 162 с. — Текст: электронный // Лань: электронно-библиотечная система. — URL: https://e.lanbook.com/book/310883 (дата обращения: 08.07.2025). — Режим доступа: для авториз. пользователей.	1. Омельянович, Л. А. Управление рисками: учебное пособие / Л. А. Омельянович, Ю. Л. Верич. — Донецк: ДонНУЭТ имени Туган-Барановского, 2024. — 155 с. — Текст: электронный // Лань: электронно-библиотечная система. — URL: https://e.lanbook.com/book/494417 (дата обращения: 08.07.2025). — Режим доступа: для авториз. пользователей. 2. Полякова, М. А. Управление налоговыми обязательствами и рисками предприятия: методология и практика: монография / М. А. Полякова, А. В. Носов. — Пенза: ПГАУ, 2024. — 201 с. — ISBN 978-5-00196-282-3. — Текст: электронный // Лань: электронно-библиотечная система. — URL: https://e.lanbook.com/book/451337 (дата обращения: 08.07.2025). — Режим доступа: для авториз. пользователей.

Таблица 4 – Перечень периодических изданий, учебно-методических пособий и нормативной литературы

Наименование дисциплины	Периодические издания	Учебно-методические пособия, нормативная литература
Оценка и управление финансовыми рисками	Периодические издания: «Финансы», «Финансы и кредит», «Финансовый журнал», «Современные страховые технологии», «Страховое дело», «Страховой случай»	1. Починок, Н. Б. Управление финансовыми рисками предприятия: учебно-методическое пособие / Н. Б. Починок, Г. И. Андрющенко, Н. Б. Гусарева. — Москва: РГСУ, 2019. — 216 с. — ISBN 978-5-7139-1378-6. — Текст: электронный //: электронно-библиотечная система. — URL: https://e.lanbook.com/book/158522 (дата обращения: 09.07.2025). — Режим доступа: для авториз. пользователей. 2. Страхование: учебно-методическое пособие / составители О. Н. Козлова, Е. А. Долбня. — Кемерово: КемГУ, 2022. — 96 с. — ISBN 978-5-8353-2906-9. — Текст: электронный // Лань: электронно-библиотечная система. — URL: https://e.lanbook.com/book/233330 (дата обращения: 08.07.2025). — Режим доступа: для авториз. пользователей. 3. Мнацаканян, А. Г. Методические указания по оформлению учебных текстовых работ (рефератов, контрольных, курсовых, выпускных квалификационных работ) для всех специальностей и направлений ИФЭМ / А. Г. Мнацаканян, Ю. Я. Настин, Э. С. Круглова. - 2-е изд., доп. — Калининград: Изд-во ФГБОУ ВО "КГТУ", 2018. — 28 с.

4 ИНФОРМАЦИОННЫЕ ТЕХНОЛОГИИ И ИНТЕРНЕТ-РЕСУРСЫ ДИСЦИПЛИНЫ

Информационные технологии

В ходе освоения дисциплины, обучающиеся используют возможности интерактивной коммуникации со всеми участниками и заинтересованными сторонами образовательного процесса, ресурсы и информационные технологии посредством электронной информационной образовательной среды университета.

Перечень современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем, к которым обучающимся по образовательной программе обеспечивается доступ (удаленный доступ), а также перечень лицензионного программного обеспечения определяется в рабочей программе и подлежит обновлению при необходимости.

Электронные образовательные ресурсы:

Российская образовательная платформа и конструктор бесплатных открытых онлайн-курсов и уроков - <https://stepik.org>

Образовательная платформа - <https://openedu.ru/>

Состав современных профессиональных баз данных (СПБД) и информационных справочных систем (ИСС):

- Справочная правовая система «Консультант Плюс»: <https://www.e-disclosure.ru/>
- База данных «Экономические исследования» ЦБ России: https://www.cbr.ru/ec_research/
- Министерство экономического развития Российской Федерации: (официальный сайт) [Электронный ресурс]: <http://economy.gov.ru>.
- Правительство РФ [Электронный ресурс]: <http://government.ru>
- Центральный банк РФ [Электронный ресурс]: <http://www.cbr.ru>
- Официальный интернет-портал правовой информации: <http://pravo.gov.ru>
- Официальный сайт Всемирного банка <http://www.worldbank.ru>
- Официальный сайт Росстат РФ: <http://www.gks.ru>
- База данных информационного агентства «Финмаркет»: <http://www.finmarket.ru>
- Единый федеральный реестр сведений о банкротстве (ЕФРСБ): <https://bankrot.fedresurs.ru/>
- Центральный банк Российской Федерации (Банк России) раздел "Финансовые рынки": <https://www.cbr.ru>
- Министерство финансов РФ (отдел регулирования страховой деятельности): <https://minfin.gov.ru>

- Всероссийский союз страховщиков (ВСС): <https://www.ins-union.ru>
- Агентство страховых новостей: <https://www.asn-news.ru>
- Профессиональный страховой портал "Страхование сегодня": <https://www.insur-info.ru>
- Страхование в России. Сайт посвящен вопросам российского страхования: <http://www.allinsurance.ru>

5 МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Аудиторные занятия проводятся в специализированных аудиториях с мультимедийным оборудованием, в компьютерных классах, а также в других аудиториях университета согласно расписанию занятий.

Консультации проводятся в соответствии с расписанием консультаций.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду университета.

При освоении дисциплины используется программное обеспечение общего назначения и специализированное программное обеспечение.

Перечень соответствующих помещений и их оснащения размещен на официальном сайте университета в информационно-телекоммуникационной сети Интернет.

6 ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ АТТЕСТАЦИИ, СИСТЕМА ОЦЕНИВАНИЯ И КРИТЕРИИ ОЦЕНКИ

Типовые контрольные задания и иные материалы, необходимые для оценки результатов освоения дисциплины (в т.ч. в процессе освоения), а также методические материалы, определяющие процедуры этой оценки приводятся в приложении к рабочей программе дисциплины (утверждается отдельно).

Оценивание результатов обучения может проводиться с применением электронного обучения, дистанционных образовательных технологий.

7 СВЕДЕНИЯ О РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ И ЕЕ СОГЛАСОВАНИИ

Рабочая программа дисциплины «Оценка и управление финансовыми рисками» представляет собой компонент основной профессиональной образовательной программы магистратуры по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит, профиль «Управление корпоративными финансами».

Рабочая программа актуализирована, рассмотрена и одобрена на заседании кафедры экономики и финансов (протокол № 9 от 27 мая 2026 г.).

И.о. заведующего кафедрой



А.Н. Кохан