

РОСЖЕЛДОР
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Ростовский государственный университет путей сообщения»
(ФГБОУ ВО РГУПС)

О.В. Андреева

МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ
ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ
«РИСК-ОРИЕНТИРОВАННЫЕ ФИНАНСОВЫЕ СТРАТЕГИИ»

Учебно-методическое пособие

Ростов-на-Дону
2017

ББК 65.29я7 + 06

Рецензент – доктор экономических наук, профессор Л.Ю. Андреева

Андреева, О.В.

Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины «Риск-ориентированные финансовые стратегии»: учебно-методическое пособие / О.В. Андреева; ФГБОУ ВО РГУПС. – Ростов н/Д, 2017. – 29 с.

Учебно-методическое пособие для обучающихся по освоению дисциплины ориентировано на обеспечение методической поддержки обучающихся в ходе освоения дисциплины.

Адресовано обучающимся, изучающим дисциплину «Риск-ориентированные финансовые стратегии», в целях организации и методического сопровождения аудиторной и внеаудиторной работы по направлению «Экономика».

Одобрено к изданию кафедрой «Экономика и финансы».

© Андреева О.В., 2017

© ФГБОУ ВО РГУПС, 2017

СОДЕРЖАНИЕ

Наименование, цель и задача дисциплины	5
Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения Образовательной программы.....	6
Место дисциплины 1Б.В.ОД «Риск-ориентированные финансовые стратегии» в структуре Образовательной программы	6
Объем дисциплины в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся	7
Вид обучения: 4 года очное бакалавриат	7
Вид обучения: 4.8 лет заочное бакалавриат.....	7
Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий.....	8
Содержание дисциплины.....	8
Отведенное количество часов по видам учебных занятий и работы	11
Лабораторный практикум	11
Практические занятия (семинары).....	12
Самостоятельное изучение учебного материала (самоподготовка).....	14
Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине	15
Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине	15
Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения Образовательной программы	15
Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования	15
Описание шкал оценивания компетенций	16
Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы.....	17
Курсовые проекты (работы)	17
Контрольные работы, расчетно-графические работы, рефераты	19
Перечни сопоставленных с ожидаемыми результатами освоения дисциплины вопросов (задач):	19
Методические материалы, определяющие процедуру оценивания знаний, умений, навыков, характеризующих этапы формирования компетенций	25

Показатели и критерии оценивания сформированности компетенций на различных этапах их формирования.....	25
Шкалы и процедуры оценивания.....	26
Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины.....	27
Основная литература.....	27
Дополнительная литература.....	27
Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины.....	27
Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины.....	28

НАИМЕНОВАНИЕ, ЦЕЛЬ И ЗАДАЧА ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина «Риск-ориентированные финансовые стратегии».

Целью дисциплины «Риск-ориентированные финансовые стратегии» является расширение и углубление подготовки в составе других базовых и вариативных дисциплин блока «Блок 1–Дисциплины (модули)» Образовательной программы в соответствии с требованиями, установленными федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования для формирования у выпускника профессиональных компетенций, способствующих решению профессиональных задач в соответствии с видами профессиональной деятельности, предусмотренными учебным планом и профилем подготовки «Финансы в транспортно-промышленном комплексе».

Для достижения цели поставлены задачи ведения дисциплины:

- подготовка обучающегося по разработанной в университете Образовательной программе к успешной аттестации планируемых результатов освоения дисциплины;
- подготовка обучающегося к освоению дисциплин «Антикризисное финансовое управление», «Междисциплинарный курс экономических дисциплин», «Финансовый менеджмент»;
- подготовка обучающегося к прохождению практики;
- подготовка обучающегося к защите выпускной квалификационной работы;
- развитие социально-воспитательного компонента учебного процесса.

**ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО
ДИСЦИПЛИНЕ, СООТНЕСЕННЫХ С ПЛАНИРУЕМЫМИ
РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ**

Планируемый результат освоения дисциплины	Планируемый результат освоения Образовательной программы
<p>Знает: Особенности формирования управленческих решений и перспективные направления их совершенствования с учетом результатов оценки внутренних и внешних рисков</p> <p>Умеет: Осуществлять анализ, оценку и выбор конкретного варианта управленческого решения на; формулировать рекомендации (предложения) по результатам исследования с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий с расчетным обоснованием.</p> <p>Имеет навыки: Разработки и обоснования предложений по совершенствованию управленческих решений с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий</p>	<p>ПК-11–способностью 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</p>

**МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ 1Б.В.ОД «РИСК-ОРИЕНТИРОВАННЫЕ
ФИНАНСОВЫЕ СТРАТЕГИИ» В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ
ПРОГРАММЫ**

Дисциплина отнесена к Блоку 1Б Образовательной программы. Дисциплина входит в состав вариативной части (В.ОД).

Требования к входным знаниям, умениям и компетенциям обучающегося, необходимым для изучения данной дисциплины, соответствуют требованиям по результатам освоения предшествующих дисциплин : «Финансовое планирование и прогнозирование в транспортно-промышленном комплексе», «Эконометрика».

Нормативный срок освоения Образовательной программы по очной форме обучения – 4 года. Наименование формы и срока обучения из базы данных РГУПС (вид обучения): 4 года очное бакалавриат, 4.8 лет заочное бакалавриат.

Обозначения-аббревиатуры учебных групп, для которых данная дисциплина актуальна: ПФБ, РФБ.

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

Вид обучения: 4 года очное бакалавриат

Общая трудоемкость данной дисциплины 9 зачетных единиц, или 324 часа, в том числе контактная работа обучающегося с преподавателем (КРОП); по учебным занятиям КРОП с учетом ИЗ и КСР, составляет 148 часов.

Виды учебной работы	Всего часов	КРОП, часов	Число часов в семестре	
			4	5
Аудиторные занятия всего и в т.ч.	144	144	64	80
Лекции (Лек)	48	48	16	32
Лабораторные работы (Лаб)	32	32	16	16
Практические, семинары (Пр)	64	64	32	32
Индивидуальные занятия (ИЗ), контроль самостоятельной работы (КСР)	4	4	2	2
Самостоятельная работа (СРС), всего и в т.ч.	131		69	62
Контрольная работа (К)				
Расчетно-графическая работа (РГР)				
Курсовая работа (КР)	10			10
Курсовой проект (КП)				
Самоподготовка	121		69	52
Контроль, всего и в т.ч.	45		9	36
Экзамен (Экз)	36			36
Зачет (За)	9		9	
Общая трудоемкость, часы	324	148	144	180
Зачетные единицы (ЗЕТ)	9		4	5

Вид обучения: 4.8 лет заочное бакалавриат

Общая трудоемкость данной дисциплины 9 зачетных единиц, или 324 часа, в том числе контактная работа обучающегося с преподавателем (КРОП); по учебным занятиям КРОП с учетом ИЗ и КСР, составляет 46 часов.

Виды учебной работы	Всего часов	КРОП, часов	Число часов в заезде			
			5	6	7	8
Аудиторные занятия всего и в т.ч.	26	26	6	4	2	14
Лекции (Лек)	12	12	4		2	6
Лабораторные работы (Лаб)	4	4		2		2
Практические, семинары (Пр)	10	10	2	2		6
Индивидуальные занятия (ИЗ), контроль самостоятельной работы (КСР)	20	20	4	4		12

Самостоятельная работа (СРС), всего и в т.ч.	265		60	64		141
Контрольная работа (К)	6			6		
Расчетно-графическая работа (РГР)						
Курсовая работа (КР)	10					10
Курсовой проект (КП)						
Самоподготовка	249		60	58		131
Контроль, всего и в т.ч.	13			4		9
Экзамен (Экз)	9					9
Зачет (За)	4			4		
Общая трудоемкость, часы	324	46	70	76	2	176
Зачетные единицы (ЗЕТ)	9					

СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ, СТРУКТУРИРОВАННОЕ ПО ТЕМАМ (РАЗДЕЛАМ) С УКАЗАНИЕМ ОТВЕДЕННОГО НА НИХ КОЛИЧЕСТВА АКАДЕМИЧЕСКИХ ЧАСОВ И ВИДОВ УЧЕБНЫХ ЗАНЯТИЙ

Содержание дисциплины

Семестр № 4

1. Идентификация, детерминация и оценка актуальных задач финансового управления в транспортной отрасли. (Компетенция/и ПК-11)
 - 1.1. Теоретико-методологическое обеспечение направлений совершенствования организа управления в транспортной отрасли.
 - 1.2. Устойчивое развитие и преобразующее инвестирование как детерминант функциональной модели организационно-финансового управления.
 - 1.3. Идентификация пула приоритетных финансовых инструментов поддержки устойчивого развития российских предприятий.
 - 1.4. Дифференциальный контент-анализ дефиниций платежеспособности кредитоспособности предприятий транспортно-промышленного комплекса.
 - 1.5. Актуальные модели оценки кредитоспособности предприятий транспортно-промышленного комплекса как базис эффективного финансового управления.
2. Риск-ориентированные финансовые детерминанты реализации крупных проектов транспортной инфраструктуры. (Компетенция/и ПК-11)
 - 2.1. Инфраструктурные коридоры развития как продуцент технологий импорта экономического роста.
 - 2.2. Риск-ориентированная финансовая параметризация транснациональных проектов транспортной инфраструктуры.

- 2.3. Разработка проактивных технологий финансового обеспечения реализации транснациональных ГЧП-проектов на транспорте.
 - 2.4. Современный алгоритм идентификации и оценки рисков в интересах формирования риск-ориентированной стратегии.
 - 2.5. Базисный контент риск-ориентированной модели управления финансовой устойчивостью предприятий железнодорожного транспорта.
3. Прикладные аспекты оценки рисков нагрузки ОАО «Российские железные дороги». (Компетенция/и ПК-11)
- 3.1. Концептуальный базис моделирования риск-ориентированного финансового управления на микро- и мезоуровнях.
 - 3.2. Идентификация роли и места рисков инвестирования в развитие нематериальных активов в общей рискованной нагрузке ОАО «Российские железные дороги».
 - 3.3. Роль и место нематериальных активов в обеспечении устойчивого развития крупных корпораций.
 - 3.4. Предложения по совершенствованию системы риск-менеджмента в ОАО «Российские железные дороги».
 - 3.5. Комплаенс-контроль в риск-ориентированной финансовой стратегии управления устойчивым развитием.
4. Маркетинговые инструменты повышения эффективности и конкурентоспособности предприятий железнодорожного транспорта. (Компетенция/и ПК-11)
- 4.1. Маркетинговое управление обеспечением финансовой устойчивости при реализации инновационных проектов корпорации.
 - 4.2. Теоретико-методологический базис обеспечения конкурентоспособности и эффективности железных дорог.
 - 4.3. Исследование конвергенции дефиниций «конкурентоспособность» и «эффективность».
 - 4.4. Организационно-финансовые и маркетинговые технологии обеспечения эффективности предприятий железнодорожного транспорта.

Семестр № 5

5. Разработка инновационных инструментов и технологий финансового управления человеческим капиталом (на примере ОАО «Российские железные дороги»). (Компетенция/и ПК-11)
- 5.1. Институциональный механизм управления персоналом на основе риск-ориентированного подхода.
 - 5.2. Технология оценки рисков инвестиций в человеческий капитал на основе нечеткой логики.
 - 5.3. Идентификация ключевых направлений воздействия стратегии развития человеческого капитала компаний на базе компетентностной специализационной дифференциации.

- 5.4. Взаимодействие вузов и транспортных компаний как механизм развития профессиональных компетенций молодых специалистов.
- 5.5. Модель динамического контроллинга изменения уровня компетентностного потенциала кадров (на примере ОАО «РЖД»).
6. Современные информационно-финансовые технологии в управлении устойчивым развитием. (Компетенция/и ПК-11)
- 6.1. Особенности финансового управления развитием крупных корпораций в условиях информационно-сетевой экономики.
- 6.2. Влияние инструментов информационно-сетевой экономики на финансовые результаты деятельности крупных корпораций.
- 6.3. Автоматизация управления корпоративными финансовыми ресурсами в условиях централизации учетных функций (на примере ОАО «Российские железные дороги»).
- 6.4. Формирование учетно-аналитической и отчетной информации в системе управления финансовыми потоками корпорации (на примере).
- 6.5. Новая парадигма финансового контроллинга в управлении устойчивым развитием.
7. Антикоррупционная составляющая в обеспечении системы комплаенс-контроля предприятий железнодорожного транспорта. (Компетенция/и ПК-11)
- 7.1. Исследование конвергенции финансовых и правовых рисков как базисного продуцента коррупционных преступлений.
- 7.2. Роль и значение оперативно-розыскной деятельности в борьбе со взяточничеством и коммерческим подкупом.
- 7.3. Анализ объективных и субъективных признаков деяния при провокации взятки либо коммерческого подкупа.
- 7.4. Анализ практики правоприменения при разногласиях в оценке действий, совершаемых в ходе оперативно-розыскных мероприятий по выявлению, документированию, пресечению взяточничества и коммерческого.
- 7.5. Разработка направлений совершенствования методики доказывания по уголовным делам о взяточничестве и коммерческом подкупе на основе результатов оперативно-розыскной деятельности.
8. Актуальные проблемы правового обеспечения финансово-экономической безопасности железнодорожного транспорта. (Компетенция/и ПК-11)
- 8.1. Особенности методики профилактики и предупреждения краж грузов на железнодорожном транспорте.
- 8.2. Предупреждение и выявление преступлений, связанных с хищением нефтепродуктов на железнодорожном транспорте.
- 8.3. Организация оперативного обслуживания объектов железнодорожного транспорта оперативными подразделениями уголовного розыска ОВД на транспорте.
- 8.4. Предупреждение преступлений в поездах и на железнодорожных перегонах.

Отведенное количество часов по видам учебных занятий и работы

Вид обучения: 4 года очное бакалавриат

Номер раздела данной дисциплины	Трудоемкость в часах по видам занятий			
	Лекции	Практические занятия, семинары	Лабораторные работы	Самоподготовка
1	4	8	4	16
2	4	8	4	16
3	4	8	4	17
4	4	8	4	20
5	8	8	4	12
6	8	8	4	14
7	8	8	4	12
8	8	8	4	14
Итого	48	64	32	121
В т.ч. по интерактивным формам		36	32	

Лабораторный практикум

Вид обучения: 4 года очное бакалавриат

Номер раздела данной дисциплины	Наименование лабораторных работ	Трудоемкость аудиторной работы, часы
Семестр № 4		
1	Финансовая политика и стратегия устойчивого роста; Краткосрочная и долгосрочная финансовая политика; Универсальные методы, механизмы и инструменты финансовой политики.	4
2	Оценка риска долгосрочного инвестиционного проекта на основе дерева событий; Оценка риска по методу сценариев будущего развития.	4
3	Особенности принятия решений в специфических условиях риск-менеджмента; Анализ и интерпретация макроэкономических детерминант развития организаций транспортно-промышленного комплекса.	4
4	Методы оценки финансовых результатов маркетинговых инструментов в повышении эффективности и конкурентоспособности предприятий железнодорожного транспорта.	4
Семестр № 5		
5	Управление человеческим капиталом в финансовой стратегии корпорации; Европейский опыт мотивации и индивидуальной и корпоративной ответственности в области человеческих ресурсов	4

Номер раздела данной дисциплины	Наименование лабораторных работ	Трудоемкость аудиторной работы, часы
6	Технологии обеспечения устойчивого развития российских предприятий при переходе к инновационно-ориентированному развитию экономики.	4
7	Эффективность антикоррупционной политики: отечественный опыт и опыт зарубежных государств.	4
8	Информационная безопасность корпоративных финансовых систем; Информационная безопасность корпоративных финансовых систем; Схема меры защиты финансовой информации; Сетевые угрозы финансовой безопасности.	4

Практические занятия (семинары)

Вид обучения: 4 года очное бакалавриат

Номер раздела данной дисциплины	Наименование (тематика) практических работ, семинаров	Трудоемкость аудиторной работы, часы
Семестр № 4		
1	Особенности организационно-финансового управления в организациях транспортно-промышленного комплекса; Управление затратами и финансовыми результатами деятельности компании и управление реальными инвестициями в разрезе устойчивого развития организаций транспортно-промышленного комплекса; Управление финансовыми ресурсами и финансовыми рисками для обеспечения устойчивого развития российских предприятий.	8
2	Факторы риска, симптомы, бифуркации и контроль; Идентификация и предварительный анализ источников риска; Современный методический инструментарий оценки уровня риска в интересах формирования риск-ориентированной стратегии; Методологические основы управления финансовыми рисками в интересах реализации крупных проектов транспортной инфраструктуры; Механизмы нейтрализации финансовых рисков; Анализ и управление рисками инвестиционных проектов.	8
3	Моделирование и системный анализ процесса прогнозирования параметров риска; Анализ риск-ориентированного финансового управления на микро- и мезоуровнях; Основы управленческой диагностики рисков; Модель функции риск-менеджмента в управлении организацией транспортно-промышленного комплекса; Специфика комплаенс-контроля как значимого элемента риск-ориентированной финансовой стратегии.	8

Номер раздела данной дисциплины	Наименование (тематика) практических работ, семинаров	Трудоемкость аудиторной работы, часы
4	Маркетинговое управление как эффективный инструмент обеспечения финансовой устойчивости при реализации инновационных проектов корпорации Роль и инструментарий маркетинга при различных уровнях конкурентоспособности предприятий железнодорожного транспорта; Эффективность совершенствования управления конкурентоспособностью предприятия; Сущность организационно-финансовых и маркетинговых технологий обеспечения эффективности предприятий транспортно-промышленного комплекса.	8
Семестр № 5		
5	Обзор инновационных инструментов и технологий финансового управления человеческим капиталом; Интеллектуальный капитал как основа экономики знаний и формирования конкурентных преимуществ; Управление человеческим капиталом как фактор обеспечения эффективности предприятий железнодорожного транспорта; Оценка рисков различных форм инвестирования в человеческий капитал.	8
6	Анализ влияния информационно-сетевой экономики на особенности финансового управления развитием крупных корпораций; Выбор и разработка стратегии финансового управления в условиях информационно-сетевой экономики и перехода России к инновационному типу развития; Контроллинг как современная концепция управления устойчивым развитием.	8
7	Исследование антикоррупционной составляющей как значимый элемент в системе комплаенс-контроля предприятий.	8
8	Инструменты управления рисками и противодействие угрозам финансово-экономической безопасности железнодорожного транспорта; Взаимодействие частных и государственных институтов в сфере финансово-экономической безопасности; Информационные технологии в обеспечении финансово-экономической безопасности.	8

Самостоятельное изучение учебного материала (самоподготовка)

Вид обучения: 4 года очное бакалавриат

Номер раздела данной дисциплины	Наименование тем, вопросов, вынесенных для самостоятельного изучения	Трудоемкость внеаудиторной работы, часы
Семестр № 4		
1	Финансовая отчетность корпоративных структур: экспресс-тест: 1) I. Бухгалтерский Баланс. Форма № 1 2) II. Отчет о прибылях и убытках. Форма № 2 3) III. Отчет об изменениях капитала. Форма № 3 4) IV. Отчет о движении денежных средств. Форма № 4 5) Анализ баланса 6) Анализ отчета о прибылях и убытках.	16
2	Особенности интегральной оценки риска реальных инвестиционных проектов; Отраслевая специфика методологии оценки проектных рисков; Анализ системы управления проектными рисками на конкретном предприятии; Информационная среда управления проектными рисками.	16
3	Распределение обязанностей по управлению рисками: карты распределения ответственности; Риски хозяйствующих субъектов, связанные с налоговым контролем; Анализ финансовой и управленческой отчетности в системе управления компанией. Методический инструментарий финансовых вычислений.	17
4	Системы повышения конкурентоспособности предприятия транспортно-промышленного комплекса, использующиеся в Японии; Бенчмаркинг как один из этапов реализации инновационного процесса на предприятии; Отличие бенчмаркинга от философии кайдзен в западном понимании.	20
Семестр № 5		
5	Инвестирование в нематериальные активы: отечественный и зарубежный опыт; Опыт реализации новых форм инвестирования в человеческий капитал; Возврат инвестиций в человеческий капитал: результаты и проблемы.	12
6	Современные автоматизированные системы управления запасами на предприятии; Рациональная организация трудовых процессов как фактор устойчивого развития предприятий транспортно-промышленного комплекса.	14
7	Государственная и муниципальная служба. Разрешение конфликта интересов. Кодексы и этика поведения государственных служащих.	12

Номер раздела данной дисциплины	Наименование тем, вопросов, вынесенных для самостоятельного изучения	Трудоемкость внеаудиторной работы, часы
8	Законодательно-правовое обеспечение экономической безопасности; Экономическая безопасность государства; Экономическая безопасность регионов России.	14

Объем самостоятельного изучения учебного материала (самоподготовка) по виду обучения 4.8 лет заочное бакалавриат составляет 249 час.

Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

№ п/п	Библиографическое описание
1	Андреева, О.В. Учебно-методические указания для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине «Риск-ориентированные финансовые стратегии» / Ростов-н/Д: ФГБОУ ВО РГУПС, 2017.

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения Образовательной программы

Компетенция	Указание (+) этапа формирования в процессе освоения ОП (семестр)	
	4	5
ПК-11	+	+

Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования

Компетенция	Этап формирования ОП (семестр)	Показатель оценивания	Критерий оценивания
ПК-11	4	Дуальная оценка на зачете	- полнота усвоения материала, - качество изложения материала, - правильность выполнения заданий, - аргументированность решений.
		Процент верных на тестировании	- правильность выполнения заданий.
		Выполненное практическое задание	- правильность выполнения заданий.

Компетенция	Этап формирования ОП (семестр)	Показатель оценивания	Критерий оценивания
	5	Выполненная лабораторная работа	- правильность выполнения заданий.
		Балльная оценка на экзамене	- полнота усвоения материала, - качество изложения материала, - правильность выполнения заданий, - аргументированность решений.
		Процент верных на тестировании	- правильность выполнения заданий.
		Выполненное практическое задание	- правильность выполнения заданий.
		Выполненная лабораторная работа	- правильность выполнения заданий.
		Балльная оценка за курсовую работу	- качество изложения материала, - правильность выполнения заданий, - аргументированность решений.

Описание шкал оценивания компетенций

Значение оценки	Уровень освоения компетенции	Шкала оценивания (для аттестационной ведомости, зачетной книжки, документа об образовании)	Шкала оценивания (процент верных при проведении тестирования)
Балльная оценка – «удовлетворительно».	Пороговый	Оценка «удовлетворительно» выставляется обучающемуся, который имеет знания только основного материала, но не усвоил его деталей, допускает неточности, недостаточно правильные формулировки, нарушения последовательности изложения программного материала и испытывает трудности в выполнении практических навыков.	От 40% до 59%
Балльная оценка – «хорошо».	Базовый	Оценка «хорошо» выставляется обучающемуся, твердо знающему программный материал, грамотно и по существу его излагающему, который не допускает существенных неточностей в ответе, правильно применяет теоретические положения при решении практических работ и задач, владеет необходимыми навыками и приемами их выполнения.	От 60% до 84%

Значение оценки	Уровень освоения компетенции	Шкала оценивания (для аттестационной ведомости, зачетной книжки, документа об образовании)	Шкала оценивания (процент верных при проведении тестирования)
Балльная оценка– «отлично».	Высокий	Оценка «отлично» выставляется обучающемуся, глубоко и прочно усвоившему программный материал, исчерпывающе, последовательно, грамотно и логически стройно его излагающему, в ответе которого тесно увязываются теория с практикой. При этом обучающийся не затрудняется с ответом при видоизменении задания, показывает знакомство с литературой, правильно обосновывает ответ, владеет разносторонними навыками и приемами практического выполнения практических работ.	От 85% до 100%
Дуальная оценка– «зачтено».	Пороговый, Базовый, Высокий	Оценка «зачтено» выставляется обучающемуся, который имеет знания, умения и навыки, не ниже знания только основного материала, может не освоить его детали, допускать неточности, недостаточно правильные формулировки, нарушения последовательности изложения программного материала и испытывает трудности в выполнении практических навыков.	От 40% до 100%
Балльная оценка– «неудовлетворительно», Дуальная оценка– «не зачтено».	Не достигнут	Оценка «неудовлетворительно, не зачтено» выставляется обучающемуся, который не знает значительной части программного материала, допускает ошибки, неуверенно выполняет или не выполняет практические работы.	От 0% до 39%

Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы

Типовые контрольные задания

Курсовые проекты (работы)

- методология финансового анализа на базе анализа финансовых коэффициентов экономической деятельности компании;
- формирование и управление инвестиционным портфелем в разрезе риск-ориентированной финансовой стратегии;
- анализ и оценка инвестиционной привлекательности предприятия;

- финансовое планирование и финансовый контроллинг в управлении финансами предприятия;
- макроэкономические детерминанты параметров риск-ориентированной финансовой стратегии;
- идентификация инвестиционного портфеля в условиях неопределенности и риска;
- сущность и содержание риск-менеджмента как основного инструмента устойчивого развития;
- управление кредитным риском в деятельности кредитных организаций;
- современный алгоритм идентификации и оценки рисков в интересах формирования риск-ориентированной стратегии;
- оценка финансовой устойчивости бизнеса при проведении сделок дью-дилидженс;
- предпосылки и факторы, предшествующие наступлению рискованных ситуаций;
- классификация финансовых рисков и методы управления рисками;
- управление дебиторской задолженностью как значимый элемент кредитной политики компании;
- диагностика надежности кредитных институтов в финансовой стратегии компании;
- управление оборотными средствами – балансирование между рисками;
- анализ окружающей среды при разработке риск-ориентированной стратегии предприятия;
- особенности привлечения финансовых ресурсов в разрезе риск-ориентированной стратегии организаций;
- хеджирование рисков предприятий транспортно-промышленного комплекса;
- разработка системы управления рисками на промышленном предприятии;
- разработка и совершенствование системы мониторинга рисков в предприятиях транспортно-промышленного комплекса;
- технология оценки рисков инвестиций в человеческий капитал;
- институциональный механизм управления персоналом на основе риск-ориентированного подхода;
- разработка политики информационной безопасности в управлении финансами;
- моделирование внешней среды и архитектуры факторов, детерминирующих развитие компании корпоративного сектора;
- оценка кредитоспособности предприятий транспортно-промышленного комплекса.

Контрольные работы, расчетно-графические работы, рефераты

- модель риск-ориентированной финансовой стратегии корпорации;
 - управление финансовыми рисками;
 - анализ финансового состояния и результатов деятельности фирмы;
 - сущность и методы финансового планирования на предприятии;
 - инструментарий управления рисками;
 - управление рисками долгосрочного инвестиционного проекта;
 - стратегии рискованных решений и основные методы управления рисками;
 - измерение риска и критерии принятия рискованных решений;
 - анализ чувствительности как метод оценки устойчивости инвестиционного проекта;
 - основные меры риска долгосрочного инвестиционного проекта;
 - основные цели и этапы процедуры выявления рисков;
 - оценка значимости выявленных рисков в организации;
 - внутренние процедуры оценки достаточности капитала: стресс-тестирование;
 - риск-ориентированный подход к формированию стратегии;
 - особенности разработки риск-ориентированных финансовых стратегий.
- Для заочной формы обучения контрольная работа проводится в форме компьютерного тестирования на базе ЦМКО.

Перечни сопоставленных с ожидаемыми результатами освоения дисциплины вопросов (задач):

Зачет. Семестр № 4

Вопросы для оценки результата освоения «Знать»:

- 1) Сущность риска как вероятностную категорию.
- 2) Неопределенность как специфическую черту риска.
- 3) Основные источники угроз и их классификацию.
- 4) Риск и доходность: сочетание и соотношение.
- 5) Основные методы оценки риска
- 6) Количественный и качественный подходы к оценке рисков.
- 7) Риск-менеджмент и его основные принципы.
- 8) Строение и функционирование системы риск-менеджмента.
- 9) Основные типы финансовых инструментов управления рисками.
- 10) Ключевые подходы к оценке стоимости компании с учетом рисков.
- 11) Главные источники финансирования риск-менеджмента в организациях.
- 12) Особенности соотношения риска и доходности в организации.
- 13) Сущность диверсификации как метод управления риском.
- 14) Хеджирование как метод управления риском.
- 15) Строение и функционирование системы риск-менеджмента в предприятиях транспортно-промышленного комплекса.

- 16) Особенности системы управления рисками в кредитной организации.
- 17) Современный алгоритм идентификации и оценки рисков в интересах формирования риск-ориентированной стратегии.
- 18) Особенности измерения риска долгосрочных инвестиционных проектов.
- 19) Принципы использования эквивалентных портфелей для оценки рискованных инвестиций и управления рисками в реальном секторе экономики.
- 20) Методику расчета ожидаемой доходности и риска портфеля.
- 21) Существующие проблемы принятия решений в условиях неопределенности.
- 22) Принципы информационного обеспечения системы управления рисками.
- 23) Место и роль рисков в экономической деятельности организации.
- 24) Особенности картографирования рисков и построение рискового профиля предприятия.
- 25) Особенности принятия решений в условиях неопределенности и риска.

Вопросы для оценки результата освоения «Уметь»:

- 1) Выявлять и ранжировать стейкхолдеры организации как источники риска.
- 2) Анализировать и идентифицировать ситуации принятия риска.
- 3) Доходчиво аргументировать выгоды и опасности риск-менеджмента.
- 4) Выделять ключевые факторы риска.
- 5) Дать характеристику этапам процесса оценки риска.
- 6) Описать современный алгоритм идентификации и оценки рисков в интересах формирования риск-ориентированной стратегии.
- 7) Осуществлять контент-анализ риск-ориентированной модели управления финансовой устойчивостью предприятий.
- 8) Применять логику финансового анализа к проблематике управления рисками.
- 9) Описать концептуальный базис моделирования риск-ориентированного финансового управления на микро- и мезоуровнях.
- 10) Идентифицировать роль и место рисков инвестирования в развитие нематериальных активов в общей рисковой нагрузке компании.
- 11) Составлять реестр выявленных рисков и проводить их ранжирование.
- 12) Раскрыть содержание внутренних и внешних методов управления рисками.
- 13) Классифицировать виды страхования финансовых рисков
- 14) Классифицировать кредитные и валютные риски.
- 15) Проводить сравнительную характеристику между фьючерсами, опционами и форвардными сделками.
- 16) Дать развернутое описание бэнчмаркинга для обеспечения адаптивности финансовой политики.
- 17) Оценить воздействие санкций на инновационно-финансовую стратегию российских компаний.
- 18) Показать специфику применения атакующей, защитной или смешанной стратегии принятия рискованных решений для бизнеса в реальном секторе

экономики.

- 19) Пояснить различия использования прямых и косвенных методов оценки риска.
- 20) Выделять особенности влияния диверсификации бизнеса на корпоративный риск.
- 21) Описать стратегию и тактику риск-менеджмента.
- 22) Раскрыть особенности инвестиционных рисков. Формирование инвестиционного портфеля с учетом риска.
- 23) Идентифицировать предпосылки и факторы возникновения рисков ситуаций.
- 24) Описать процесс диагностики финансового кризиса предприятия и провести анализ рисков при угрозе банкротства.
- 25) Раскрыть содержание страхования как инструмента управления рисками.

Вопросы для оценки результата освоения «Иметь навыки»:

- 1) Владения методами уклонения от риска, локализации и диссипации риска, компенсации риска и распределения риска.
- 2) Применения существующих моделей определения цен основных активов.
- 3) Владения методами управления различными финансовыми рисками.
- 4) Применения моделей и методов оценки странового риска, системы критериев рейтинговых оценок.
- 5) Использования приемов и методов оценки риска в анализе рынка недвижимости.
- 6) Раскрытия особенностей оценки риска бизнеса в сфере реальной экономики.
- 7) Идентификации оценки влияния внешних и внутренних факторов риска на развитие бизнеса и его будущие результаты.
- 8) Применения методов управления рисками на уровне конкретной фирмы.
- 9) Раскрытия особенностей обоснования и выбора стратегии рискованных решений.
- 10) Использования методов измерения риска.
- 11) Обоснования теоретических критериев выбора рискованных решений.
- 12) Реализации стратегий управления рисками с помощью диверсификации бизнеса.
- 13) Владения методами досрочного прекращения проектов.
- 14) Управления рисками путем распределения капитала между проектами с независимыми доходами.
- 15) Управления рисками в условиях финансового лизинга с помощью встроенных реальных опционов.
- 16) Поиска информации о финансовом аспекте риск-менеджмента.
- 17) Владения приемами и методами оценки риска в анализе рынка недвижимости.
- 18) Применения методикой расчета ожидаемой доходности и риска портфеля.

- 19) Управления рисками в условиях использования лизинга.
- 20) Измерения риска долгосрочных инвестиционных проектов.
- 21) Использования эквивалентных портфелей для оценки рискованных инвестиций и управления рисками в реальном секторе экономики.
- 22) Владения знаниями о современных теориях риска (портфельной, оценки стоимости финансовых активов, оценки стоимости опционов).
- 23) Применения практических методов количественной оценки риска.
- 24) Раскрытия общих принципов управления рисками.
- 25) Измерения риска портфеля и составления оптимального портфеля.

Экзамен. Семестр № 5

Вопросы для оценки результата освоения «Знать»:

- 1) Особенности системы управления рисками в кредитной организации.
- 2) Современный алгоритм идентификации и оценки рисков в интересах формирования риск-ориентированной стратегии.
- 3) Особенности измерения риска долгосрочных инвестиционных проектов.
- 4) Принципы использования эквивалентных портфелей для оценки рискованных инвестиций и управления рисками в реальном секторе экономики.
- 5) Методику расчета ожидаемой доходности и риска портфеля.
- 6) Существующие проблемы принятия решений в условиях неопределенности.
- 7) Принципы информационного обеспечения системы управления рисками.
- 8) Место и роль рисков в экономической деятельности организации.
- 9) Особенности картографирования рисков и построение рискового профиля предприятия.
- 10) Особенности принятия решений в условиях неопределенности и риска.
- 11) Сущность риска как вероятностную категорию.
- 12) Неопределенность как специфическую черту риска.
- 13) Основные источники угроз и их классификацию.
- 14) Риск и доходность: сочетание и соотношение.
- 15) Основные методы оценки риска
- 16). Количественный и качественный подходы к оценке рисков.
- 17) Риск-менеджмент и его основные принципы.
- 18) Строение и функционирование системы риск-менеджмента.
- 19) Основные типы финансовых инструментов управления рисками.
- 20) Ключевые подходы к оценке стоимости компании с учетом рисков.
- 21) Главные источники финансирования риск-менеджмента в организациях.
- 22) Особенности соотношения риска и доходности в организации.
- 23) Сущность диверсификации как метод управления риском.
- 24) Хеджирование как метод управления риском.
- 25) Строение и функционирование системы риск-менеджмента в предприятиях транспортно-промышленного комплекса.

Вопросы для оценки результата освоения «Уметь»:

- 1) Дать развернутое описание бэнчмаркинга для обеспечения адаптивности финансовой политики.
- 2) Оценить воздействие санкций на инновационно-финансовую стратегию российских компаний.
- 3) Показать специфику применения атакующей, защитной или смешанной стратегии принятия рискованных решений для бизнеса в реальном секторе экономики.
- 4) Пояснить различия использования прямых и косвенных методов оценки риска.
- 5) Выделять особенности влияния диверсификации бизнеса на корпоративный риск.
- 6) Описать стратегию и тактику риск-менеджмента.
- 7) Раскрыть особенности инвестиционных рисков. Формирование инвестиционного портфеля с учетом риска.
- 8) Идентифицировать предпосылки и факторы возникновения рискованных ситуаций.
- 9) Описать процесс диагностики финансового кризиса предприятия и провести анализ рисков при угрозе банкротства.
- 10) Раскрыть содержание страхования как инструмента управления рисками.
- 11) Выявлять и ранжировать стейкхолдеры организации как источники риска.
- 12) Анализировать и идентифицировать ситуации принятия риска.
- 13) Доходчиво аргументировать выгоды и опасности риск-менеджмента.
- 14) Выделять ключевые факторы риска.
- 15) Дать характеристику этапам процесса оценки риска.
- 16) Описать современный алгоритм идентификации и оценки рисков в интересах формирования риск-ориентированной стратегии.
- 17) Осуществлять контент-анализ риск-ориентированной модели управления финансовой устойчивостью предприятий.
- 18) Применять логику финансового анализа к проблематике управления рисками.
- 19) Описать концептуальный базис моделирования риск-ориентированного финансового управления на микро- и мезоуровнях.
- 20) Идентифицировать роль и место рисков инвестирования в развитие нематериальных активов в общей рискованной нагрузке компании.
- 21) Составлять реестр выявленных рисков и проводить их ранжирование.
- 22) Раскрыть содержание внутренних и внешних методов управления рисками.
- 23) Классифицировать виды страхования финансовых рисков
- 24) Классифицировать кредитные и валютные риски.
- 25) Проводить сравнительную характеристику между фьючерсами, опционами и форвардными сделками.

Вопросы для оценки результата освоения «Иметь навыки»:

- 1) Поиска информации о финансовом аспекте риск-менеджмента.
- 2) Владения приемами и методами оценки риска в анализе рынка недвижимости.
- 3) Применения методикой расчета ожидаемой доходности и риска портфеля.
- 4) Управления рисками в условиях использования лизинга.
- 5) Измерения риска долгосрочных инвестиционных проектов.
- 6) Использования эквивалентных портфелей для оценки рискованных инвестиций и управления рисками в реальном секторе экономики.
- 7) Владения знаниями о современных теориях риска (портфельной, оценки стоимости финансовых активов, оценки стоимости опционов).
- 8) Применения практических методов количественной оценки риска.
- 9) Раскрытия общих принципов управления рисками.
- 10) Измерения риска портфеля и составления оптимального портфеля.
- 11) Владения методами уклонения от риска, локализации и диссипации риска, компенсации риска и распределения риска.
- 12) Применения существующих моделей определения цен основных активов.
- 13) Владения методами управления различными финансовыми рисками.
- 14) Применения моделей и методов оценки странового риска, системы критериев рейтинговых оценок.
- 15) Использования приемов и методов оценки риска в анализе рынка недвижимости.
- 16) Раскрытия особенностей оценки риска бизнеса в сфере реальной экономики.
- 17) Идентификации оценки влияния внешних и внутренних факторов риска на развитие бизнеса и его будущие результаты.
- 18) Применения методов управления рисками на уровне конкретной фирмы.
- 19) Раскрытия особенностей обоснования и выбора стратегии рискованных решений.
- 20) Использования методов измерения риска.
- 21) Обоснования теоретических критериев выбора рискованных решений.
- 22) Реализации стратегий управления рисками с помощью диверсификации бизнеса.
- 23) Владения методами досрочного прекращения проектов.
- 24) Управления рисками путем распределения капитала между проектами с независимыми доходами.
- 25) Управления рисками в условиях финансового лизинга с помощью встроенных реальных опционов.

Иные контрольные материалы для автоматизированной технологии оценки имеются в Центре мониторинга качества образования

Методические материалы, определяющие процедуру оценивания знаний, умений, навыков, характеризующих этапы формирования компетенций

№ п/п	Библиографическое описание
1	Методические указания, определяющие процедуру оценивания знаний, умений, навыков, характеризующих этапы формирования компетенций. Ресурс ЦМКО РГУПС.

Для каждого результата обучения по дисциплине определены Показатели и критерии оценивания сформированности компетенций на различных этапах их формирования

Результат обучения	Компетенция	Этап формирования в процессе освоения ОП (семестр)	Этапы формирования компетенции при изучении дисциплины (раздел дисциплины)	Показатель сформированности компетенции	Критерий оценивания
Знает, Умеет, Имеет навыки	ПК-11	4	1, 2, 3, 4	Дуальная оценка на зачете	- полнота усвоения материала, - качество изложения материала, - правильность выполнения заданий, - аргументированность решений.
			1, 2, 3, 4	Процент верных на тестировании	- правильность выполнения заданий.
			1, 2, 3, 4	Выполненное практическое задание	- правильность выполнения заданий.
			1, 2, 3, 4	Выполненная лабораторная работа	- правильность выполнения заданий.
		5	5, 6, 7, 8	Балльная оценка на экзамене	- полнота усвоения материала, - качество изложения материала, - правильность выполнения заданий, - аргументированность решений.
			5, 6, 7, 8	Процент верных на тестировании	- правильность выполнения заданий.

Результат обучения	Компетенция	Этап формирования в процессе освоения ОП (семестр)	Этапы формирования компетенции при изучении дисциплины (раздел дисциплины)	Показатель сформированности компетенции	Критерий оценивания
			5, 6, 7, 8	Выполненное практическое задание	- правильность выполнения заданий.
			5, 6, 7, 8	Выполненная лабораторная работа	- правильность выполнения заданий.
			5, 6, 7, 8	Балльная оценка за курсовую работу	- качество изложения материала, - правильность выполнения заданий, - аргументированность решений.

Шкалы и процедуры оценивания

Значение оценки	Уровень освоения компетенции	Шкала оценивания (для аттестационной ведомости, зачетной книжки, документа об образовании)	Процедура оценивания
Балльная оценка - «отлично», «хорошо», «удовлетворительно». Дуальная оценка - «зачтено».	Пороговый, Базовый, Высокий	В соответствии со шкалой оценивания в разделе РПД «Описание шкал оценивания компетенций»	Экзамен (письменно-устный). Зачет (письменно-устный). Автоматизированное тестирование. Выполнение практического задания в аудитории. Выполнение лабораторной работы (подготовка отчета). Защита курсовой работы.
Балльная оценка - «неудовлетворительно». Дуальная оценка - «не зачтено».	Не достигнут		

ПЕРЕЧЕНЬ ОСНОВНОЙ И ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ УЧЕБНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Основная литература

№ п/п	Библиографическое описание
1	Андреева, О.В. Риск-ориентированные финансовые стратегии: учебное пособие / Ростов-н/Д: ФГБОУ ВО РГУПС. 2017.–263 с.

Дополнительная литература

№ п/п	Библиографическое описание
1	Финансы. Теоретический и научно-практический журнал. 2015.
2	Вопросы экономики. Теоретический и научно-практический журнал общеэкономического содержания. Учредители: Некommerческое партнерство «Редакция журнала «Вопросы экономики»; Институт экономики РАН. Издатель: НП «Редакция журнала «Вопросы экономики». 2017.
3	Деньги и кредит. Теоретический, научно-практический журнал. Учредитель – Центральный банк Российской Федерации. 2017.

Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины

№ п/п	Адрес в Интернете, наименование
1	http://rgups.ru/ . Ресурс ЭИОС РГУПС
2	http://www.iprbookshop.ru/ . Электронно-библиотечная система «IPRBooks»
3	http://www.knigafund.ru/ . Электронно-библиотечная система «Книгафонд»
4	http://library.miit.ru/miitb.php . Электронно-библиотечная система МИИТ
5	http://rgups.ru:8087/jirbis2/ . Электронно-библиотечная система РГУПС

Профессиональные базы данных и информационно-справочные системы

№ п/п	Адрес в Интернете, наименование
1	http://www.glossary.ru/ . Глоссарий.ру (служба тематических толковых словарей)
2	http://www.consultant.ru/ . КонсультантПлюс
3	http://www.cfin.ru/ . Официальный сайт «Корпоративный менеджмент»
4	http://www.finman.ru/ . Официальный сайт журнал «Финансовый менеджмент»
5	http://www.gaap.ru/ . Официальный сайт информационно-деловой журнал «ГААР»
6	http://www.gks.ru/ . Официальный сайт «Федеральная служба государственной статистики»
7	http://www.rbc.ru/ . Информационного агентства «Росбизнесконсалтинг»

Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

№ п/п	Библиографическое описание
1	Андреева, О.В. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины «Риск-ориентированные финансовые стратегии» / Ростов-н/Д: ФГБОУ ВО РГУПС, 2017.

Учебное издание

Андреева Ольга Владимировна

**МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ
ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ
«РИСК-ОРИЕНТИРОВАННЫЕ ФИНАНСОВЫЕ СТРАТЕГИИ»**

Печатается в авторской редакции
Технический редактор Н.С. Федорова

Подписано в печать 29.12.17. Формат 60×84/16.
Бумага газетная. Ризография. Усл. печ. л. 1,86.
Тираж экз. Изд. № 901819. Заказ .

Редакционно-издательский центр ФГБОУ ВО РГУПС.

Адрес университета: 344038, г. Ростов н/Д, пл. Ростовского Стрелкового
Полка Народного Ополчения, д. 2.