

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Волхонов Михаил Станиславович

Должность: Врио ректора

Дата подписания: 24.09.2023 22:22:28

Уникальный программный ключ:

b2dc754702040c21bec588577a1b985ee223ea771539643aad0272d0040c6c81

МИНИСТЕРСТВО СЕЛЬСКОГО ХОЗЯЙСТВА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ  
ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ

«КОСТРОМСКАЯ ГОСУДАРСТВЕННАЯ СЕЛЬСКОХОЗЯЙСТВЕННАЯ АКАДЕМИЯ»

Согласовано:  
Председатель методической комиссии  
экономического факультета

\_\_\_\_\_ / Королева Е.В. /

«07» июня 2023 года

Утверждаю:  
Декан экономического факультета

\_\_\_\_\_ / Середа Н.А. /

«14» июня 2023 года

## АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

### РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ

Направление подготовки /специальность/	<u>38.04.01 Экономика</u>
Направленность (профиль)	<u>Корпоративные финансы</u>
Квалификация выпускника	<u>магистр</u>
Форма обучения	<u>очно-заочная</u>
Срок освоения ОПОП ВО	<u>2 года 4 месяца</u>

### 1. Цель и задачи освоения дисциплины

Целью освоения дисциплины «Риск-менеджмент» является: обучение студентов теоретическим основам и прикладным аспектам в области управления рисками в условиях неопределенности.

Задачи дисциплины:

- изучить теоретические и методические аспекты риск-менеджмента экономического субъекта;
- сформировать у обучающегося мышление и навыки, необходимые для осуществления риск-менеджмента на уровне экономического субъекта;
- сформировать навыки практической работы по осуществлению риск-менеджмента и разработке практических рекомендаций, направленных на снижения уровня финансовых рисков, повышения эффективности функционирования и улучшение финансового состояния организации.

### 2. Место дисциплины в структуре ОПОП ВО

2.1 Дисциплина Б1.В.06 Риск-менеджмент относится к части Блока 1 «Дисциплины (модули) ОПОП ВО, формируемой участниками образовательных отношений.

2.2. Для изучения данной дисциплины (модуля) необходимы знания, умения и навыки, формируемые предшествующими дисциплинами:

- Корпоративные финансы;
- Финансовый менеджмент;

2.3. Перечень последующих дисциплин, для которых необходимы знания, умения и навыки, формируемые данной дисциплиной:

- Итоговая аттестация.

### 3. Требования к результатам освоения дисциплины

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование и развитие компетенций:

ПКос-2, ПКос-3

Категория компетенции	Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции
Профессиональные компетенции	ПКос-2 Способен разрабатывать финансовый план и целевой инвестиционный портфель	ИД-1 <sub>ПКос-2</sub> Осуществляет финансовый анализ и финансовое планирование, мониторинг выполнения финансового плана ИД-2 <sub>ПКос-2</sub> Моделирует параметры целевого инвестиционного портфеля, разрабатывает рекомендации по управлению инвестициями
	ПКос-3 Способен к планированию, координированию и нормативному обеспечению интегрированной комплексной деятельности подразделений по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации	ИД-1 <sub>ПКос-3</sub> Разрабатывает корпоративные нормативные документы деятельности организации, подразделений и отдельных работников по управлению рисками ИД-2 <sub>ПКос-3</sub> Определяет цели и задачи подразделений в соответствии со стратегическими целями организации по управлению рисками ИД-3 <sub>ПКос-3</sub> Формирует оперативный и тактический план работ по управлению рисками;

		внедряет систему управления рисками на уровне организации, подразделения
--	--	--

В результате освоения дисциплины студент должен:

Знать:

- Основные виды рисков, методы их оценки;
- Возможности и условия для применения и выбора методов минимизации рисков;
- Принципы соотношения риска и доходности;
- Понятия безрискового актива;
- Способы управления финансовыми рисками;
- Принципы целеполагания, организационного планирования и прогнозирования;
- Национальные и международные стандарты, лучшие практики по построению систем управления рисками;
- Законодательство Российской Федерации и отраслевые стандарты по управлению рисками;
- Локальные нормативные акты по управлению рисками в организации;
- Принципы теории управления изменениями;
- Принципы построения систем управления рисками;
- Компоненты системы управления рисками и их взаимосвязь;
- Полномочия и обязательства менеджмента по реализации плана управления рисками;
- Этапы разработки систем управления рисками;
- Стратегические и оперативные цели и задачи системы управления рисками в организации.

Уметь:

- Применять количественные и качественные подходы к управлению рисками;
- Рассчитать экономический эффект и эффективность размещения капитала с учетом рисков;
- Оценивать затраты на проведение финансовых операций;
- Получать, интерпретировать и документировать результаты исследований;
- Использовать расчетные таблицы и калькуляторы;
- Внедрять системы управления рисками на уровне организации, подразделения
- Анализировать изменения корпоративной нормативной базы по вопросам управления рисками;
- Разрабатывать регламентирующие документы по управлению рисками;
- Применять термины и принципы риск-менеджмента;
- Описывать бизнес-процессы с учетом рисков;
- Вырабатывать рекомендации по принятию решений в сфере управления рисками в рамках организации (подразделения по управлению рисками).

Владеть:

- Навыками составления перечня рекомендаций по управлению инвестиционным риском;
- Приемами выявления качественных и количественных свойств рисков в предполагаемых к использованию финансовых продуктах.
- Навыками проведения стресс-тестов и сценарного анализа;
- Навыками определения целей и задач подразделения (по управлению рисками) в соответствии со стратегическими целями организации (декомпозиция стратегических целей организации в задачи подразделения) на основании корпоративных нормативных документов по управлению рисками и требований вышестоящего руководства;
- Методами реализации плана построения системы управления рисками.

#### **4. Структура дисциплины**

Общая трудоемкость дисциплины составляет 4 зачетных единиц, 144 часа.

Форма промежуточной аттестации – экзамен.