

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Волхонов Михаил Станиславович

Должность: Врио ректора

Дата подписания: 02.06.2023 17:49:47

Уникальный программный ключ:

b2dc75470204bc2bfec58d577a1b983ee223ea27559d45aa8c272df0610c6c81

МИНИСТЕРСТВО СЕЛЬСКОГО ХОЗЯЙСТВА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

ДЕПАРТАМЕНТ НАУЧНО-ТЕХНОЛОГИЧЕСКОЙ ПОЛИТИКИ И ОБРАЗОВАНИЯ

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ
ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ

«КОСТРОМСКАЯ ГОСУДАРСТВЕННАЯ СЕЛЬСКОХОЗЯЙСТВЕННАЯ АКАДЕМИЯ»

Согласовано:

Председатель методической комиссии
экономического факультета

_____/Королева Е.В./

«09» декабря 2020года

Утверждаю:

Декан экономического факультета

_____/Середа Н.А./

«16» декабря 2020 года

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ

Направление подготовки
/специальность/

38.04.01 Экономика

Направленность (профиль)

Корпоративные финансы

Квалификация выпускника

магистр

Форма обучения

очная

Срок освоения ОПОП ВО

2 года 4 месяца

Караваево 2020

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:

- изучение теории, методологии и методов исследования рисков и управления рисками в инновационной деятельности и развитие аналитических способностей студентов;
- формирование умения разрабатывать управленческие решения на основе отбора информационных источников, выбора подходов, методов и моделей исследования, учитывающих риски инновационной деятельности;
- формирование навыков принятия сложных управленческих решений в условиях неопределенности, логического мышления и системного видения инновационной деятельности, необходимых при проведении исследований риска и неопределенности внешней и внутренней бизнес-среды 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:

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 _{ПКос-2} Осуществляет финансовый анализ и финансовое планирование, мониторинг выполнения финансового плана ИД-2 _{ПКос-2} 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 _{ПКос-3} Осуществляет нормативное обеспечение деятельности организации по управлению рисками ИД-2 _{ПКос-3} Планирует деятельность по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации ИД-3 _{ПКос-3} Организует и координирует интегрированную комплексную деятельность подразделений по управлению рисками

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.

Вид учебной работы		Всего часов, 4 семестр
Контактная работа (всего)		36,5
В том числе:		
Лекции (Л)		10
Практические занятия (ПЗ), Семинары (С)		26
Консультации (К)		0,5
Самостоятельная работа студента (СРС) (всего)		107,5
В том числе:		
Подготовка к практическим занятиям		20
Самостоятельное изучение учебного материала		51,5
Вид промежуточной аттестации	зачет (З)	
	экзамен (Э)	36*
Общая трудоемкость / контактная работа	часов	144/36,5
	зач. ед.	4/1,0

* - часы используются для подготовки к контрольным испытаниям в течение семестра

5. Содержание дисциплины

5.1. Разделы дисциплины, виды учебной деятельности и формы контроля

№ п/ п	№ семе стра	Наименование раздела (темы) дисциплины (модуля)	Вид учебной деятельности, включая самостоятельную работу студентов (в часах)					всего	
			Л	Пр /С/ Ла б	К, КР (КП)	СР			
1	2	3	4	5	6	7	8	9	
1.	4	Тема 1 «Введение в риск-менеджмент» Риск-менеджмент как система управления рисками организации. Финансовая среда организаций.	2	4		18	24	Тестирование	
2.	4	Тема 2 «Сущность и классификация рисков» Сущность и функции рисков организаций. Теории рисков организации. Классификация рисков организаций. Политические риски. Производственные риски. Инновационные риски. Финансовые риски.	2	4		18	24	Контрольная работа Тестирование	

3.	4	Тема 3 «Методы оценки рисков» Предпринимательские потери и зоны риска. Система показателей оценки риска. Зависимость доходности и риска в предпринимательстве. Абсолютные показатели оценки риска. Относительные показатели оценки риска. Вероятностные показатели оценки риска. Статистические показатели оценки риска. Экспертные оценки риска.	2	4		18	24	Контрольная работа Тестирование
4.	4	Тема 4 «Управление операционными рисками» Стратегия управления рисками организации. Методы минимизации потерь. Методы возмещения потерь. Риск банкротства организации	2	4		18	24	Контрольная работа Тестирование
5.	4	Тема 5 «Управление инвестиционными рисками» Оценка рисков инвестиционных проектов. Классификация инвестиционных рисков. Система управления инвестиционными рисками.	1	6		18	25	Контрольная работа Тестирование
6.	4	Тема 6 «Управление кредитными рисками» Управление кредитным риском деятельности банка. Риски ликвидности. Валютные риски. Депозитные риски	1	4		17,5	22,5	Контрольная работа Тестирование
7.	4	Консультации			0,5		0,5	Консультирование
		ИТОГО:	10	26	0,5	107,5	144	

5.2. Практические и семинарские занятия, лабораторные работы

№ п/п	№ семестра	Наименование раздела (темы) дисциплины (модуля)	Наименование лабораторных (практических, семинарских) работ	Всего часов
1	2	3	4	5
1	4	Введение в риск-менеджмент	1. Риск-менеджмент как система управления рисками организации 1. Финансовая среда деятельности организации. Изучение факторов микросреды	4

			<p>организации: конкуренты, поставщики, посредники, покупатели, контактные аудитории.</p> <p>2. Изучение факторов макросреды: природные, научно-технические, политические, экономические, демографические, культурные.</p>	
2	4	Сущность и классификация рисков	<p>1. Изучение сущности и функций рисков организации.</p> <p>2. Классическая, неоклассическая и современная школа рисков организации</p> <p>3. Классификация рисков организаций.</p> <p>4. Политические риски.</p> <p>5. Производственные риски.</p> <p>6. Инновационные риски.</p> <p>7. Финансовые риски.</p>	4
3	4	Методы оценки рисков	<p>Изучить:</p> <p>1. Предпринимательские потери и зоны риска: безрисковая зона, зона допустимого риска, зона критического риска, зона катастрофического риска.</p> <p>2. Система показателей оценки риска. Зависимость доходности и риска в предпринимательстве.</p> <p>3. Абсолютные показатели оценки риска.</p> <p>4. Относительные показатели оценки риска.</p> <p>5. Вероятностные показатели оценки риска.</p> <p>6. Статистические показатели оценки риска.</p> <p>7. Экспертные оценки риска.</p>	4
4	4	Управление операционными рисками	<p>Изучить:</p> <p>1. Стратегии управления рисками организации.</p> <p>2. Методы минимизации потерь.</p> <p>3. Методы возмещения потерь.</p> <p>4. Признаки несостоятельности, банкротства организации.</p> <p>5. Отечественные и зарубежные методы оценки возможности банкротства предприятия.</p> <p>6. Процедуры банкротства и финансового оздоровления организации (наблюдение, внешнее управление, конкурсное производство, мировое соглашение).</p> <p>7. Досудебные меры по предупреждению банкротства организации.</p>	4
5	4	Управление инвестиционными рисками	<p>Изучить:</p> <p>1. Оценка рисков инвестиционных проектов. Классификация инвестиционных рисков.</p> <p>2. Система управления инвестиционными рисками.</p>	6
6	4	Управление кредитными	<p>Изучить:</p> <p>1. Управление кредитным риском</p>	4

	рисками	деятельности банка. Оценка кредитного портфеля. 2. Риски ликвидности. 3. Валютные риски. 4. Депозитные риски	
	ИТОГО:		26

5.3. Примерная тематика курсовых работ:

Курсовая работа не предусмотрена

5.4. Самостоятельная работа студента

№ п/п	№ семестра	Наименование раздела учебной дисциплины (модуля)	Виды СРС	Всего часов
1	2	3	4	5
1.	4	Введение в риск-менеджмент	Самостоятельное изучение материала Подготовка к контрольным испытаниям.	18
2.	4	Сущность и классификация рисков	Подготовка к лекциям и практическим занятиям. Выполнение домашних заданий. Подготовка к контрольным испытаниям.	18
3.	4	Методы оценки рисков	Подготовка к лекциям и практическим занятиям. Выполнение домашних заданий. Подготовка к контрольным испытаниям.	18
4.	4	Управление операционными рисками	Подготовка к лекциям и практическим занятиям. Выполнение домашних заданий. Подготовка к контрольным испытаниям.	18
5.	4	Управление инвестиционными рисками	Подготовка к лекциям и практическим занятиям. Выполнение домашних заданий. Подготовка к контрольным испытаниям.	18
6.	4	Управление кредитными рисками	Подготовка к лекциям и практическим занятиям. Выполнение домашних заданий. Подготовка к контрольным испытаниям.	17,5
ИТОГО часов в семестре:				107,5

6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

6.1. Рекомендуемая литература

№ п/п	Автор, название, место издания, издательство, год издания учебной и учебно-методической литературы	Количество экземпляров
1	1.Шапкин, А.С. Теория риска и моделирование рисков ситуаций [Электронный ресурс] : учебник для бакалавров / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 6-е изд. - Электрон. дан. - М. : Дашков и К, 2017. - 880 с. - (Учебные издания для бакалавриата). - Режим доступа: https://e.lanbook.com/reader/book/93446/ , требуется регистрация. - Яз. рус. - Загл. с экрана. - ISBN 978-5-394-02170-1.	Неограниченный доступ
2	2.Бондаренко, О.Г. Управление коммерческим риском [Электронный ресурс] : учебное пособие для бакалавров / О. Г. Бондаренко, В. Т. Гришина. - Электрон. дан. - М. : Дашков и К, 2018. - 147 с. - (Учебные издания для бакалавров). - Режим доступа: https://e.lanbook.com/reader/book/110755/#2 , требуется регистрация. - Загл. с экрана. - Яз. рус. - ISBN 978-5-394-02935-6.	Неограниченный доступ
3	3.Балдин, К.В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия [Электронный ресурс] : учебное пособие для студентов вузов / К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов. - 3-е изд. - Электрон. дан. - Москва : Дашков и К°, 2017. - 418 с. : ил. - (Издательско-торговая корпорация "Дашков и К°"). - Режим доступа: https://e.lanbook.com/reader/book/93406/ , требуется регистрация. - Яз. рус. - Загл. с экрана. - ISBN 978-5-394-02256-2.	Неограниченный доступ
4	4.Новиков, А.И. Теория принятия решений и управление рисками в финансовой и налоговой сферах [Электронный ресурс] : учебное пособие для студентов вузов / А. И. Новиков, Т. И. Солодкая. - Электрон. дан. - М. : Дашков и К°, 2017. - 288 с. - (Учебные издания для бакалавров). - Режим доступа: https://e.lanbook.com/reader/book/93422 , требуется регистрация. - Яз. рус. - Загл. с экрана. - Яз. рус. - ISBN 978-5-394-01380-5.	Неограниченный доступ
5	5.Шапкин, А.С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций [Электронный ресурс] / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 9-е изд. - Электрон. дан. - М. : Дашков и К, 2016. - 544 с. : ил. - Режим доступа: https://e.lanbook.com/reader/book/93337/ , требуется регистрация. - Яз. рус. - Загл. с экрана. - ISBN 978-5-394-02150-3.	Неограниченный доступ

6.2. Лицензионное программное обеспечение

Наименование программного обеспечения	Сведения о правообладателе (лицензиат, номер лицензии, дата выдачи, срок действия) и заключенном с ним договоре
Windows Prof 7 Academic Open License	Майкрософт, 47105956, 30.06.2010, постоянная
Microsoft Office 2010 Russian Academic Open License	Майкрософт, 47105956, 30.06.2010, постоянная
Microsoft Windows SL 8.1 Russian Academic Open License	Майкрософт, 64407027, 25.11.2014, постоянная
Microsoft Office 2013 Russian Academic Open License	Майкрософт, 64407027, 25.11.2014, постоянная
Microsoft Exchange Standard 2007 Academic Device CAL	Майкрософт, 44794865, 13.11.2008, постоянная
Microsoft Windows Server Academic Device CALЭ	Майкрософт, 44794865, 13.11.2008, постоянная
Microsoft SQL Server Standard Edition Academic	Майкрософт, 44794865, 13.11.2008, постоянная
Microsoft Exchange Server Standard Edition Academic	Майкрософт, 44794865, 13.11.2008, постоянная
Microsoft Windows Terminal Svcs Device CAL	Майкрософт, 44794865, 13.11.2008, постоянная
Microsoft Windows Server Standard 2008 Academic	Майкрософт, 44794865, 13.11.2008, постоянная
Microsoft Windows Server Standard 2008 R2 Academic	Майкрософт, 48946846, 24.08.2011, постоянная
Microsoft Forefront TMG Standard 2010	Майкрософт, 48946846, 24.08.2011, постоянная
Microsoft Windows Server Standard 2012 Academic	Майкрософт, 61149292, 15.11.2012, постоянная
SunRavBookOffice	SunRavSoftware, 25.04.2012, постоянная
SunRavTestOfficePro	SunRavSoftware, 25.04.2012, постоянная
Программное обеспечение «Антиплагиат»	АО «Антиплагиат», лицензионный договор №1553 от 25.09.2019, 1 год
Kaspersky Endpoint Security для бизнеса – Стандартный Russian Edition. 250-499Node 1 year Educational Renewal License	ООО «ДримСофт», лицензионный договор №44 от 14.02.2020, 1 год

7. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Наименование специальных* помещений и помещений для самостоятельной работы	Оснащенность специальных помещений и помещений для самостоятельной работы	Перечень лицензионного программного обеспечения
Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	<p>Аудитория 409э</p> <p>Лекционная поточная аудитория с наборами демонстрационного оборудования и учебно-наглядных пособий, оснащенная специализированной мебелью и техническими средствами обучения.</p> <p>Компьютер: Intel(R) Pentium(R) CPU G620 @ 2.60GHz, проектор Mitsubishi WD720U с выходом в Интернет и ЭИОС ФГБОУ ВО Костромской ГСХА</p>	<p>Microsoft Windows SL 8.1 Russian Academic Open License 64407027, Microsoft Office 2010 Russian Academic Open License 47105956, Kaspersky Endpoint Security Standart Edition Educational</p>
Учебные аудитории для проведения лабораторно-практических занятий и занятий семинарского типа	<p>Аудитория 311э</p> <p>оснащенная специализированной мебелью и техническими средствами обучения</p> <p>Компьютер: Intel(R) Pentium(R) CPU G620 @ 2.60GHz с выходом в Интернет и ЭИОС ФГБОУ ВО Костромской ГСХА</p>	<p>Microsoft Windows SL 8.1 Russian Academic Open License 64407027, Microsoft Office 2010 Russian Academic Open License 47105956, Kaspersky Endpoint Security Standart Edition Educational</p>
Учебные аудитории для курсового проектирования и самостоятельной работы	<p>Аудитория 220э</p> <p>оснащенная специализированной мебелью и техническими средствами обучения</p> <p>Компьютер: Intel(R) Core(TM) i5-2400 CPU @ 3.10GHz 8 шт. с выходом в Интернет и ЭИОС ФГБОУ ВО Костромской ГСХА</p>	<p>Microsoft Windows SL 8.1 Russian Academic Open License 64407027, Microsoft Office 2010 Russian Academic Open License 47105956, Kaspersky Endpoint Security Standart Edition Educational, SunRavTestOfficePro, Программное обеспечение «Антиплагиат»</p>
	<p>Аудитория 257</p> <p>оснащенная специализированной мебелью и техническими средствами обучения. Бездисковые терминальные станции 12 шт. Intel(R) Pentium(R)</p>	<p>Microsoft Windows SL 8.1 Russian Academic Open License 64407027, Microsoft Office 2010 Russian Academic Open</p>

	CPU G4600 @ 3.60GHz с выходом в Интернет и ЭИОС ФГБОУ ВО Костромской ГСХА	License 47105956, Kaspersky Endpoint Security Standart Edition Educational
	Лаборатория информационно-аналитических ресурсов Аудитория 300э, оснащенная специализированной мебелью и техническими средствами обучения. Монитор Samsung 510NSKS 9LCD.1024*768); Системный блок Ce12GHz/1024Mb/160Gb/FDD/DVD-RW с выходом в Интернет и ЭИОС ФГБОУ ВО Костромской ГСХА Информационная база: Статистические издания Росстата, Костромастата; годовая отчетность сельскохозяйственных товаропроизводителей Костромской области; периодические издания Количество парт:16 шт. Количество стульев:32 шт.	Microsoft Windows SL 8.1 Russian Academic Open License 64407027, Microsoft Office 2010 Russian Academic Open License 47105956, Kaspersky Endpoint Security Standart Edition Educational, Доступ к ЭБС «Лань», КонсультантПлюс
Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации	Аудитория 213э оснащенная специализированной мебелью Тематические стенды	
Помещения для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования	Аудитория 440 Сервер RStyle , Сервер DEPO, Сервер IntelP4308, Компьютер i5/8G/1TB, Компьютер i5/8/500G, Компьютер i5/8/500G, Компьютер E6850/4/500G, Компьютер i5/4/500G	Microsoft Windows Server Standard 2008 Academic 44794865, Microsoft Windows Server Standard 2008 R2 Academic 48946846, Microsoft SQL Server Standard Edition Academic 44794865, Microsoft Office 2013 Russian Academic Open License, Windows Prof 7 Academic Open License 64407027,47105956

	<p style="text-align: center;">Аудитория 117 Компьютер i7/4/500, Компьютер Celeron 2.8/512/360, Паяльная станция, осциллограф, мультиметр, микроскоп</p>	<p style="text-align: center;">Microsoft Office 2013 Russian Academic Open License, Windows Prof 7 Academic Open License 64407027,47105956</p>
--	--	--

*Специальные помещения – аудитории для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, а также помещения для самостоятельной работы.

Программа дисциплины составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки 38.04.01 Экономика, направленность (профиль) «Корпоративные финансы»

Составитель (и):

Доцент кафедры «Финансы и кредит»

Дели А.С.

Заведующий кафедрой «Финансы и кредит»

Исина Н.Ю.