

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:

ФИО: Волхонов Михаил Станиславович

Должность: Врио ректора

Дата подписания: 11.09.2024 17:19:35

Уникальный программный ключ:

b2dc75470204bc2bfec58d577a1b983ee223ea27559d45aa8c272df0610c6c81

МИНИСТЕРСТВО СЕЛЬСКОГО ХОЗЯЙСТВА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение

высшего образования

"Костромская государственная сельскохозяйственная академия"

(ФГБОУ ВО Костромская ГСХА)

СОГЛАСОВАНО:

Председатель методической
комиссии

Елена
Владимировна
Королёва

Подписано цифровой
подписью: Елена Владимировна
Королёва
Дата: 2024.06.05 12:44:28 +03'00'

УТВЕРЖДАЮ

Проректор по научно-
исследовательской работе/Декан

Надежда
Александровна
Середа

Подписано цифровой подписью:
Надежда Александровна Середа
Дата: 2024.06.11 12:51:44 +03'00'

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)

Риск-менеджмент

Закреплена за кафедрой	Финансы и кредит
Учебный план	oz38.04.01_магистр_экономика_2024-2025.plx Направление подготовки 38.04.01 Экономика, направленность (профиль) "Корпоративные финансы"
Квалификация	магистр
Форма обучения	очно-заочная
Программу составил(и):	доцент, кандидат экономических наук, доцент, Дели Анна Сергеевна

1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ	
Цель	обучение студентов теоретическим основам и прикладным аспектам в области управления рисками в условиях неопределенности
Задачи:	- 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
2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП	
Цикл (раздел) ООП: Б1.В1675608 эффективности функционирования и улучшение финансового состояния организации.	
2.1	Требования к предварительной подготовке обучающегося:
2.1.1	Корпоративные финансы
2.1.2	Инвестиции
2.1.3	Финансовый менеджмент
2.2	Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:
2.2.1	Подготовка к процедуре защиты и процедура защита выпускной квалификационной работы

Распределение часов дисциплины по семестрам				
Семестр (<Курс>.<Семестр р на курсе>)	4 (2.2)		Итого	
Неделя	17 2/6			
Вид занятий	УП	РП	УП	РП
Лекции	10	10	10	10
Практические	26	26	26	26
Консультации	0,5	0,5	0,5	0,5
Итого ауд.	36	36	36	36
Контактная работа	36,5	36,5	36,5	36,5
Сам. работа	107,5	107,5	107,5	107,5
Итого	144	144	144	144

4. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)
ПКос-2: Способен разрабатывать финансовый план и целевой инвестиционный портфель
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.

ПКос-3: Способен к планированию, координированию и нормативному обеспечению интегрированной комплексной деятельности подразделений по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации

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.

В результате освоения дисциплины обучающийся должен**3.1 Знать:**

<ul style="list-style-type: none"> - 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.
<ul style="list-style-type: none"> - 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.
<p>3.2 Уметь:</p>
<ul style="list-style-type: none"> - 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).
<ul style="list-style-type: none"> - 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).
<p>3.3 Владеть:</p>
<ul style="list-style-type: none"> - 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.

- 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.