

Документ подписан простой электронной подписью
МИНИСТЕРСТВО СЕ
Информация о владельце:
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВО
ФИО: Волхонов Михаил Станиславович
Должность: Ректор
Дата подписания: 10.07.2018 г.
«КОСТРОМСКАЯ ГОСУДАРСТВЕННАЯ АКАДЕМИЯ»
Уникальный программный ключ:
40a6db1879d6a9ee29ec8e0ffbf2f95e4614a0998

БСКОГО ХОЗЯЙСТВА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ
ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
СТВЕННАЯ СЕЛЬСКОХОЗЯЙСТВЕННАЯ АКАДЕМИЯ»

Экономический факультет

СОГЛАСОВАНО:

Председатель методической комиссии

Елена
Владимировна
Королёва

Подписано цифровой
подписью: Елена
Владимировна Королёва
Дата: 2025.06.04 11:18:31
+03'00'

УТВЕРЖДАЮ:
Проректор по научно-исследовательской работе/Декан

Надежда
Александровна
Середа

Подписано цифровой
подписью: Надежда
Александровна Середа
Дата: 2025.06.11 11:19:00
+03'00'

Риск-менеджмент

Направление подготовки /
Специальность 38.04.01 Экономика

Направленность (профиль) / Специализация

Квалификация выпускника

Форма обучения очно-заочная

Срок освоения ОПОП ВО 2 года,4 месяцев

Общая 4 З.ЕД.

Часов по учебному

в том числе: 144

аудиторные занятия

самостоятельная работа 107,5

Программу составил(и):

ФИО	Уч.звание	Степень	Должность	Кафедра	Подпись
Дели Анна Сергеевна	доцент	кандидат экономических наук	доцент	ФиК	

Рабочая программа дисциплины

Риск-менеджмент

разработана в соответствии с ФГОС ВО:

Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - магистратура по направлению подготовки 38.04.01 Экономика (приказ Минобрнауки России от 11.08.2020 г. № 939)

составлена на основании учебного плана:

Направление подготовки 38.04.01 Экономика, направленность (профиль) "Корпоративные финансы"

утвержденногого учёным советом вуза от 19.02.2025 протокол № 2.

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры

«Финансы и кредит»

Протокол от 23.04.2025 г. № 8

Заведующий кафедрой Исина Наталья Юрьевна

Рассмотрено на заседании методической комиссии. Экономический факультет, протокол №3 от 04.06.2025

1. ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Цели:

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 практических рекомендаций, направленных на снижения уровня финансовых рисков, повышения эффективности функционирования и улучшение финансового состояния организации.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ

Цикл (раздел) ОП:	Б1.В
-------------------	------

2.1.0 Требования к предварительной подготовке обучающегося:

Корпоративные финансы

Финансовый менеджмент

Корпоративное страхование

Информационные технологии и программные средства в экономике

Управление проектами

Управление персоналом организации

Финансовый анализ

Инвестиции

Банковские технологии

Финансовое моделирование бизнес-процессов

Организация предпринимательской деятельности

Финансовое обеспечение внешнеэкономической деятельности организации

Оценка и управление стоимостью бизнеса

2.2.0 Дисциплины (модули) и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля)

Производственная практика, преддипломная практика

Подготовка к процедуре защиты и процедура защиты выпускной квалификационной работы

Подготовка к сдаче и сдача итогового экзамена

Производственная практика, научно-исследовательская работа

3. ФОРМИРУЕМЫЕ КОМПЕТЕНЦИИ И ИНДИКАТОРЫ ИХ ДОСТИЖЕНИЯ

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.

Распределение часов дисциплины по семестрам				
Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	4 (2.2)		Итого	
Недель	17 3/6			
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

4.1. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Код занятия	Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр / Курс	Часов	Компетенции	Литература и эл. ресурсы	Примечание
	Раздел 1. Введение в риск-менеджмент					
1.1	Введение в риск-менеджмент /Тема/	4	0			
1.2	Введение в риск-менеджмент /Лек/	4	1	ПКос-2 ПКос -3	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Э1	
1.3	Введение в риск-менеджмент /Пр/	4	4	ПКос-2 ПКос -3	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Э1	
1.4	Введение в риск-менеджмент /Ср/	4	18	ПКос-2 ПКос -3	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Э1	
	Раздел 2. Сущность и классификация рисков					
2.1	Сущность и классификация рисков /Тема/	4	0			
2.2	Сущность и классификация рисков /Лек/	4	1	ПКос-2 ПКос -3	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Э1	
2.3	Сущность и классификация рисков /Пр/	4	4	ПКос-2 ПКос -3	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Э1	
2.4	Сущность и классификация рисков /Ср/	4	24	ПКос-2 ПКос -3	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Э1	
	Раздел 3. Методы оценки рисков					
3.1	Методы оценки рисков /Тема/	4	0			
3.2	Методы оценки рисков /Пр/	4	4	ПКос-2 ПКос -3	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Э1	

3.3	Методы оценки рисков /Cр/	4	18	ПКос-2 ПКос -3	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Э1	
	Раздел 4. Управление операционными рисками					
4.1	Управление операционными рисками /Тема/	4	0			
4.2	Управление операционными рисками /Лек/	4	2	ПКос-2 ПКос -3	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Э1	
4.3	Управление операционными рисками /Пр/	4	4	ПКос-2 ПКос -3	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Э1	
4.4	Управление операционными рисками /Cр/	4	18	ПКос-2 ПКос -3	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Э1	
	Раздел 5. Управление инвестиционными рисками					
5.1	Управление инвестиционными рисками /Тема/	4	0			
5.2	Управление инвестиционными рисками /Лек/	4	2	ПКос-2 ПКос -3	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Э1	
5.3	Управление инвестиционными рисками /Пр/	4	6	ПКос-2 ПКос -3	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Э1	
5.4	Управление инвестиционными рисками /Cр/	4	18	ПКос-2 ПКос -3	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Э1	
	Раздел 6. Управление кредитными рисками					
6.1	Управление кредитными рисками /Тема/	4	0			
6.2	Управление кредитными рисками /Лек/	4	4	ПКос-2 ПКос -3	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Э1	
6.3	Управление кредитными рисками /Пр/	4	4	ПКос-2 ПКос -3	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Э1	
6.4	Управление кредитными рисками /Cр/	4	11,5	ПКос-2 ПКос -3	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Э1	
	Раздел 7. Консультации					
7.1	Управление кредитными рисками /Тема/	4	0			
7.2	Управление кредитными рисками /Конс/	4	0,5	ПКос-2 ПКос -3	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Э1	

5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Представлен отдельным документом

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

6.1. Рекомендуемая литература

6.1.1. Основная литература

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л1.1		Рациональная организация кормопроизводства: сб. науч.-исслед. работ	Москва, 1981
Л1.2	Шапкин А. С., Шапкин В. А.	Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций: учебное пособие	Москва: Дашков и К°, 2023
Л1.3	Шапкин А. С., Шапкин В. А.	Теория риска и моделирование рисковых ситуаций: учебник для бакалавров	Москва: Дашков и К, 2023
Л1.4	Емельянов С. М.	Связи с общественностью: управление рисками и кризисными коммуникациями: учебное пособие для вузов	Санкт-Петербург: Лань, 2024
Л1.5	Котов В. И.	Инвестиционные проекты. Риск-анализ и оценка эффективности: учебное пособие для вузов	Санкт-Петербург: Лань, 2024

6.2. Электронные учебные издания и электронные образовательные ресурсы

Э1	Риск-менеджмент
----	-----------------

6.3.1 Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в том числе отечественного производства

6.3.1.1	Windows 7 Prof, Microsoft Office 2003 Std Microsoft Open License 64407027,47105956
6.3.1.2	Microsoft Office 2010 Russian Academic Open License
6.3.1.3	SunRav TestOfficePro
6.3.1.4	Kaspersky Endpoint Security для бизнеса – СтандартныйRussian Edition. 250-499
6.3.1.5	Информационная система поддержки образовательного процесса

6.3.2 Перечень профессиональных баз данных и информационных справочных систем

6.3.2.1	Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU
6.3.2.2	Электронно-библиотечная система издательства «Лань»
6.3.2.3	Единое окно доступа к образовательным ресурсам
6.3.2.4	Реферативная база данных AGRIS
6.3.2.5	Электронная библиотека академии

7.ПЕРЕЧЕНЬ ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫХ ТЕХНОЛОГИЙ

Название	Описание
Технология модульного обучения, технология поэтапного формирования компетенций	Обучение на основе выделения структурной единицы технологии обучения - модуля, который предстает логически завершенной частью содержания учебной дисциплины и включает в себя познавательные и профессиональные аспекты, усвоение которых оценивается с помощью соответствующей формы контроля знаний, умений, навыков. В результате овладения обучающимся модулем формируются логически связанные знания, умения, навыки. Объединение тем в модуль определяется общностью целей и задач, в то же время модуль должен соответствовать целям и задачам формирования планируемых компетенций и быть частью целостного процесса их формирования.
Технология проблемного обучения	Формирование проблемного восприятия учебной задачи и создание условий для поиска разрешения проблемы студентами. Опора на восприятие изучаемого материала как «через призму проблем», активизирующее психические познавательные процессы, на формирование умений находить способы разрешения проблем.
Технология личностно-ориентированного (развивающего) обучения	Обучение в рамках личностного подхода, при котором развитие личности рассматривается как цель, результат и главный критерий эффективности процесса обучения.

Технология информационно-коммуникативного обучения.	Обучение с опорой на работу обучающегося с информацией в условиях реализации адаптивных схем коммуникации педагога и обучающегося.
Технология объяснительно-иллюстративного обучения	Объяснение с использованием иллюстраций, которое создает условия для репродуктивного усвоения учащимися знаний, умений и навыков. Обучение на основе реализации принципа наглядности с опорой на поэтапное формирование образного мышления.
Технология развития критического мышления.	Обучение на основе использования способов развития критического мышления, развитие критического мышления предстает как цель и результат обучения.

8. МТО (оборудование и технические средства обучения)

№ ауд.	Назначение	Оборудование и ПО	Адрес	Вид
212з	Учебные аудитории для проведения лабораторно-практических занятий и занятий семинарского типа	IntelPentiumSandyBridgeGb620/2 gB/250gB/DVD-RW/VGAPalitNV, LED-4K UHD телевизор 51-55*Haier 55 Smart TV AX Pro, 13 шт. парт, 25 шт. стульев, доска, 1 стенд	Учебно-лабораторный корпус экономического факультета Российской Федерации, Костромская область, Костромской муниципальный район, Караваевское сельское поселение, п. Караваево, ул. Учебный городок, д. 47	Пр
212з	Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	IntelPentiumSandyBridgeGb620/2 gB/250gB/DVD-RW/VGAPalitNV, LED-4K UHD телевизор 51-55*Haier 55 Smart TV AX Pro, 13 шт. парт, 25 шт. стульев, доска, 1 стенд	Учебно-лабораторный корпус экономического факультета Российской Федерации, Костромская область, Костромской муниципальный район, Караваевское сельское поселение, п. Караваево, ул. Учебный городок, д. 47	Лек
311з	Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации	Доска, 19 шт. парт, 41 шт. стульев, 4 стенда	Учебно-лабораторный корпус экономического факультета Российской Федерации, Костромская область, Костромской муниципальный район, Караваевское сельское поселение, п. Караваево, ул. Учебный городок, д. 47	Конс
220з	Учебные аудитории для проведения лабораторно-практических занятий и занятий семинарского типа	Компьютер DEPO Racex 140 SSE i5_2400/4GDDR 1333/T750G/DVD-RW/450W/CAR3WS 9 ед. Монитор 19" SamsungB 1930 NWNKF 9 шт. Столы ученические 14 шт., стулья ученические 24шт.	Учебно-лабораторный корпус экономического факультета Российской Федерации, Костромская область, Костромской муниципальный район, Караваевское сельское поселение, п. Караваево, ул. Учебный городок, д. 47	Сп