ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ
Кафедра финансов и статистики

Рег. № ЭКф. 04-14
«18» мая 2017г.

УТВЕРЖДАЮ:
Декан Экономического факультета
Шелковников Сергей Александрович
(ФИО)
16.05.17
(подпись)

ФГОС 2015 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Б1.В.ОД.11
Риск-менеджмент

38.04.01 Экономика
Код и наименование направления подготовки
(где 3-4 цифра соответствуют уровню образования: 01 – подготовка по рабочим профессиям (СПО); 02- подготовка специалистов среднего звена (СПО); 03 – бакалавриат; 04- магистратура; 05 – специалитет; 06 – аспирантура)

профиль: Финансовый менеджмент
основной вид деятельности: научно-исследовательская
дополнительный вид деятельности: организационно-управленческая
(профиль и виды деятельности)

Курс: 2,2 Семестр: 3,3

Экономический факультет очная, заочная
очная, заочная, очно-заочная

Объем дисциплины (модуля)

Вид занятий	Объем занятий [зачетных ед./часов]		Семестр
	Очная	заочная	
Общая трудоемкость по учебному плану	2 / 72	2/72	3, 3
В том числе,			
Контактная работа	22	14	
Лекции	12	6	
Практические (семинарские) занятия	10	8	
Самостоятельная работа, всего	50	48	
В том числе:			
Контрольная работа / реферат	Р.	Р.	3, 3
Форма контроля			
Экзамен (зачет)	Зачет	Зачет	3, 3

Новосибирск 2017

Рабочая программа составлена на основании требований Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования к содержанию и уровню подготовки выпускников по направлению подготовки *38.04.01 Экономика (уровень магистратуры)*, утвержденного приказом Минобрнауки России от 30.03.2015 № 321

Программу разработал(и):

Канд. экон. наук, доцент кафедры финансов и статистики		И.А. Севастеева
(должность)	подпись	ФИО

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю) соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

1.1 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине

В результате изучения дисциплины обучающийся должен (табл. 1):

знать:

сущность, цель, задачи, принципы, функции и механизм управления рисками, обеспечивающего конкурентоспособность компании.

уметь:

использовать основные методы управления рисками для принятия управленческих решений по реализации конкретных проектов и решений, применять основные принципы и стандарты управления рисками во внедрении технологических инноваций.

владеть:

анализом и разработкой системы риск-менеджмента; проводить оценку вариативных инвестиционных и инновационных проектов; оптимизировать управленческие решения с учетом их экономической результативности.

1.2 Планируемые результаты освоения образовательной программы

Дисциплина «Риск-менеджмент» в соответствии с требованиями ФГОС ВО направлена на формирование следующих общепрофессиональных (ОПК) и профессиональные (ПК) компетенций магистра:

Общепрофессиональные компетенции (ОПК):

1. Способностью принимать организационно-управленческие решения – (ОПК-3).

Профессиональные компетенции (ПК):

1. Способностью разрабатывать варианты управленческих решений и обосновывать их выбор на основе критериев социально-экономической эффективности (ПК-12).

Таблица 1. Связь результатов обучения с приобретаемыми компетенциями

№ п/п	Результаты освоения дисциплины: знания, умения, навыки	Формируемые компетенции (ОПК, ПК)
1	**Знать:** сущность, цель, задачи, принципы, функции и механизм управления рисками, обеспечивающего конкурентоспособность компании.	ОПК-3 ПК-12
2.	**Уметь:** использовать основные методы управления рисками для принятия управленческих решений по реализации конкретных проектов и решений, применять основные принципы и стандарты управления рисками во внедрении технологических инноваций	ОПК-3 ПК-12

3	**Владеть:** анализом и разработкой системы риск-менеджмента; проводить оценку вариативных инвестиционных и инновационных проектов; оптимизировать управленческие решения с учетом их экономической результативности.	ОПК-3 ПК-12

2. Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Дисциплина Б1.В.ОД.11 «Риск-менеджмент» относится к обязательным дисциплинам вариативной части.

Необходимый уровень качества подготовки специалиста является системно-образующим фактором в динамической системе учебного процесса по ОПОП и предполагает логическую последовательность изучения дисциплин:

Предшествующие дисциплины:

- Математические моделирование в финансовом управлении.

Последующие дисциплины:

- Страхование (в финансовой сфере)

3. Содержание дисциплины (модуля)

Распределение часов по темам и видам занятий представлено в таблице 2 по каждой форме обучения.

Таблица 2.1 Очная форма

№№		Лекции, (Л).	Вид занятия (ПЗ)	Самостоятельная работа, (СР)	Всего по теме, час.	Компетенции (ОПК, ПК)
Раздел 1. Риск-менеджмент. Понятийные основы и стратегия управления риском						
1.1.	Основы управления рисками.	2	-	4	6	ПК-12 ОПК-3
1.2.	Планирование реагирование на риски	-	1	4	5	ПК-12 ОПК-3
1.3.	Стратегии решений для минимизации рисков	2	1	4	7	ПК-12 ОПК-3
Раздел 2. Методы оценки, анализа и прогнозирования риска						
2.1.	Выявление рисков	0,5	1	4	5,5	ПК-12 ОПК-3
2.2.	Методы теории игр	0,5	1	4	5,5	ПК-12 ОПК-3
2.3.	Анализ чувствительности проекта	1	-	4	5	ПК-12 ОПК-3
2.4.	Методы минимизации рисков	2	2	2	6	ПК-12 ОПК-3
Раздел 3. Управление рисками						
3.1.	Мониторинг и контроль рисков	2	2	3	7	ОПК-3 ПК-12

3.2	Оценка экономического эффекта от управления рисками	2	2	3	7	ОПК-3 ПК-12
	Реферат			**9**	**9**	
	Зачет	**-**	**-**	**9**	**9**	
	ИТОГО	**12**	**10**	**50**	**72**	

Таблица 2.2 Заочная форма

№№		**Лекции, (Л).**	**Вид занятия (ЛР, ПЗ)**	**Самостоятельная работа, (СР)**	**Всего по теме, час.**	**Компетенции (ОПК, ПК)**
Раздел 1. Риск-менеджмент. Понятийные основы и стратегия управления риском						
1.1.	Основы управления рисками.	1	-	1	2	ПК-12 ОПК-3
1.2.	Планирование реагирование на риски	-	1	6	7	ПК-12 ОПК-3
1.3.	Методы оценки, анализа и прогнозирования риска	1	1	5	7	ПК-12 ОПК-3
Раздел 2. Стратегии решений для минимизации рисков						
2.1.	Выявление рисков	0,5	1	6	7,5	ПК-12 ОПК-3
2.2.	Методы теории игр	0,5	1	5	6,5	ПК-12 ОПК-3
2.3.	Анализ чувствительности проекта	1	-	6	7	ПК-12 ОПК-3
2.4.	Методы минимизации рисков	1	1	5	7	ПК-12 ОПК-3
Раздел 3. Управление рисками						
3.1.	Мониторинг и контроль рисков	1	1	5	7	ПК-12 ОПК-3
3.2	Оценка экономического эффекта от управления рисками	-	2	6	8	ПК-12 ОПК-3
	Реферат			**9**	**9**	
	Зачет			**4**	**4**	
	ИТОГО	**6**	**8**	**58**	**72**	

Учебная деятельность состоит из лекций, практических занятий, самостоятельной работы и реферата.

Содержание отдельных разделов и тем

Раздел 1. Риск-менеджмент. Понятийные основы и стратегия управления риском

Тема 1.1 Основы управления рисками

Неопределенность. Риск. Вероятность рисков. Случай, вероятность и воздействие. Объективный и субъективный методы определения вероятности нежелательных событий. Дерево рисков (структура разбиения рисков) проекта. Внешние факторы риска. Внутренние факторы риска.

Тема 1.2 Планирование реагирование на риски

Сущность статистических методов и моделей определения и оценки рисков предприятия.

Тема 1.3 Методы оценки, анализа и прогнозирования риска

Матрица оценки вероятности и последствий.

Раздел 2. Стратегии решений для минимизации рисков Тема 2.1 Стратегии решений в условиях риска

Сущность аналитических методов и моделей определения и оценки рисков предприятия. Игровые модели.

Структурная схема организации (OBS).

Организационное планирование.

Тема 2.2 Выявление рисков

Система управления рисками и отчетность.

Эффективность инвестиционного проекта.

Тема 2.3 Методы теории игр

Общие принципы управления риском. Стратегии управления риском.

Тема 2.4 Анализ чувствительности проекта

Общая характеристика количественного анализа рисков. Результат количественного анализа рисков. Вероятностный и статистический анализ: алгоритм, пример расчета.

Раздел 3. Управление рисками

Тема 3.1 Мониторинг и контроль рисков

Основные методы минимизации рисков: диверсификация, или распределение рисков; резервирование средств; страхование.

Тема 3.3 Оценка экономического эффекта от управления рисками

Управление кредитными рисками. Понятие и определение кредитного риска.

4. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины (модуля)

4.1 Список основной литературы

1. Риск-менеджмент инвестиционного проекта: Учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / Под ред. Грачева М.В. - М.:ЮНИТИ-ДАНА, 2015. - 544 с
2. Уродовских В.Н. Управление рисками предприятия: учебное пособие /Уродовский В.Н.- М.: ИНФРА-М, 2017. – 168 с.

4.2. Список дополнительной литературы

3. Банковский риск-менеджмент: учебное пособие / П.П. Ковалев. - 2-е изд., перераб. и доп. - М.: КУРС: НИЦ ИНФРА-М, 2013. - 320 с.
4. Домащенко Д.В. Современные подходы к корпоративному риск-менеджменту: методы и инструменты / Домащенко Д.В., Финогенова Ю.Ю. - М.:Магистр, НИЦ ИНФРА-М, 2016. - 304 с.
5. Уродовских В.Н. Управление рисками предприятия: учебное пособие. – М.: Вузовский учебник: ИНФРА-М, 2010. – 168 с.
6. Соколов Д.В. Базисная система риск-менеджмент организаций реального сектора экономики: Монография / Д.В. Соколов, А.В. Барчуков. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2013. - 126 с.

4.3. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

Таблица 3. Перечень информационных ресурсов

№ п/п	Наименование	Адрес
1.	Официальный сайт Министерства финансов РФ	http://www.minfin.ru
2	Официальный сайт Министерства финансов и налоговой политики Новосибирской области	http://www.mfnso.nso.ru

4.4. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модулю) и самостоятельной работы

1. **Риск-менеджмент:** метод. указания для практических занятий, самостоятельной работы и по выполнению рефератов / Новосиб. гос. аграр. ун-т. эконом. фак.; сост.: И.А. Севастеева – Новосибирск, 2017. – 23 с.

4.5. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем, наглядных пособий

Таблица 4. Перечень лицензионного программного обеспечения

№ п/п	Наименование	Кол-во ключей	Тип лицензии или правообладатель
1.	Microsoft Windows 7 Prof	1	Microsoft
2.	Microsoft Windows Server 2003	20	Microsoft
3.	Microsoft Office Prof 2007	21	Microsoft
4.	Браузер Mozilla FireFox	21	Mozilla Public License

Таблица 5. Перечень плакатов (по темам), карт, стендов, макетов, презентаций, фильмов и т.д.

№ п/п	Тип	Наименование	Примечание
1	Презентация	Хеджирование	20 слайдов
2	Презентация	Избежание и лимитирование риска	20 слайдов

5. Описание материально-технической базы

Таблица 6. Перечень используемых помещений:

№ аудитории	Тип аудитории	Перечень оборудования
НК-428	Учебная аудитория для занятий семинарского типа, проведения промежуточной аттестации	Учебная доска, видеопроектор переносной, ноутбук переносной, учебная мебель
НК-414	Учебная аудитория для занятий лекционного типа	Видеопроектор, проекционный экран, доска учебная, ноутбук переносной, учебная мебель
НК-431	Помещение для самостоятельной работы	Переносной проектор, переносной проекционный экран, доска учебная, ноутбук переносной, 20 персональных компьютеров терминального класса, учебная мебель

6. Используемые интерактивные формы и методы обучения по дисциплине

Таблица 7. Активные и интерактивные формы и методы обучения

№ п/п	Тема	Количество часов	Вид учебных занятий	Используемые интерактивные образовательные технологии	Формируемые компетенции
1	Стратегии решений для минимизации рисков	3	Л, ПЗ	Лекция-информация, тестирование	ПК-12 ОПК-3
2	Методы минимизации рисков	2	ПЗ	Круглый стол	ПК-12 ОПК-3
3	Методы минимизации рисков	2	Л	Лекция-визуализация	ПК-12 ОПК-3
4	Анализ чувствительности проекта	1	Л	Лекция-визуализация	ПК-12 ОПК-3
	ИТОГО	8			

7. Порядок аттестации студентов по дисциплине

Для аттестации студентов по дисциплине используется традиционная система оценки знаний.

Форма аттестации – зачет.

При невыполнении обучающимся заданий по дисциплине и / или наличии пропусков более 50% занятий по дисциплине обучающийся к сдаче зачета не допускается.

«Зачтено» выставляется обучающемуся, который твердо усвоил программный материал, грамотно и по существу, без существенных неточностей отвечает на вопросы, владеет необходимыми навыками и приемами выполнения практических заданий.

«Не зачтено» выставляется обучающемуся, который не знает значительной части программного материала, допускает принципиальные ошибки, неуверенно, с большими затруднениями выполняет практические задания.

8. Согласование рабочей программы

Соответствует рабочему учебному плану, утвержденному Ученым советом ФГБОУ ВО Новосибирского ГАУ, протокол от «24» апреля 2017 г. №5

Рабочая программа обсуждена и утверждена
на заседании кафедры
протокол от «12» мая 2017 г. № 10

Заведующий кафедрой		Шелковников С.А.
(должность)	подпись	ФИО

Председатель методической комиссии, канд. экон. наук		Утешева И.О.
(должность)	подпись	ФИО