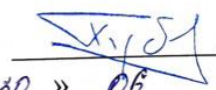


УТВЕРЖДАЮ
Директор филиала

 Т.А.Хубаев
«30» 06 2022 г.

Приложение к рабочей программе дисциплины

Риск-менеджмент

Направление подготовки 38.03.02 Менеджмент
образовательная программа «Финансовый менеджмент»,
профиль «Финансовый менеджмент»

2022
(год утверждения программы)

Одобрено кафедрой «Менеджмент»

Протокол от «28» 06 2022 г. № 12

СОДЕРЖАНИЕ

| | |
|--|----|
| 1. Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы (перечень компетенций) с указанием индикаторов их достижения и планируемых результатов обучения по дисциплине | 3 |
| 2. Место дисциплины в структуре образовательной программы | 4 |
| 3. Объем дисциплины в зачетных единицах и академических часах с выделением объема аудиторной (лекции, семинары) и самостоятельной работы обучающихся (в семестре, в сессию) | 4 |
| 4. Учебно-тематический план..... | 5 |
| 5. Содержание практических и семинарских занятий..... | 6 |
| 6. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины | 9 |
| 7. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины | 11 |
| 8. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине | 11 |
| 9. Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине | 12 |

1.Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы (перечень компетенций) с указанием индикаторов их достижения и планируемых результатов обучения по дисциплине

| Код компетенции | Наименование компетенции | Индикаторы достижения компетенции ¹ | Результаты обучения (умения и знания), соотнесенные с индикаторами достижения компетенции |
|-----------------|--|---|--|
| ПКН-11 | Способность анализировать рыночные и специфические риски при решении задач управления организацией | 1. Использует знания инструментария риск-менеджмента для выявления факторов риска внешней и внутренней среды организации и обоснования измерения риска. 2. Проводит идентификацию рисков по функциям и направления деятельности организации. 3. Использует механизмы выявления причин, условий возникновения рисков с использованием методов количественной и качественной оценки рисков. | Знать понятие риска и неопределённости; основные подходы к классификации рисков; основные отечественные и зарубежные концепции менеджмента рисков; принципы управления рисками; методы нейтрализации риска. Уметь идентифицировать риски; использовать методы количественного и качественного анализа рисков; управлять предпринимательскими рисками; организовывать работу исполнителей для выполнения работ, в области менеджмента рисков |
| ПКП-3 | Способность разрабатывать финансовую стратегию организации, долгосрочную и краткосрочную финансовую политику, а также принимать эффективные управленческие решения, обеспечивающие достижение стоящих перед организацией целей | 1. Обладает навыками разработки финансовой стратегии и политики. 2. Использует современные методы и средства для принятия эффективных финансовых решений. | Знать порядок разработки календарных планов пересмотра норм организационно-технических мероприятий по повышению производительности труда, планов организации труда, заданий по снижению трудоемкости изделий уметь выполнять технические расчеты, графические и вычислительные работы при формировании организационно-экономических разделов технической документации для освоения технологических процессов, подготовки производства и серийного выпуска инновационной продукции |

¹ Заполняется при реализации актуализированных ОС ВО ФУ и ФГОС ВО3++

| | | | |
|-------|--|--|--|
| ПКП-5 | Способность реализовывать инвестиционные решения, осуществлять формирование и управление портфелем финансовых и реальных активов организации в целях максимизации ее стоимости | 1. Владеет методами оценки инвестиций и активов организации 2. Применяет современные методы и модели управления инвестициями в целях максимизации стоимости бизнеса | знать: – методы и методики оценки эффективности принимаемых финансовых решений в области инвестиционной деятельности уметь: – выбирать и обосновывать методы оценки и управления реальными и финансовыми инвестициями; знать: современные методы оценки эффективности и финансовой реализуемости инвестиционных проектов в условиях риска и неопределенности; основные подходы и методики управления рисками инвестиционных проектов; уметь: применять современные методы оценки эффективности и финансовой реализуемости инвестиционных проектов в условиях риска и неопределенности; разрабатывать и применять систему управления проектными рисками. |
|-------|--|--|--|

2. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Риск-менеджмент» является дисциплиной части, формируемой участниками образовательных отношений, и входит в цикл Профиля (элективный), Профиль «Финансовый менеджмент» образовательной программы, разработанной для студентов направления подготовки 38.03.02- «Менеджмент», профиль «Финансовый менеджмент».

3. Объем дисциплины в зачетных единицах и академических часах с выделением объема аудиторной (лекции, семинары) и самостоятельной работы обучающихся

| Вид учебной работы по дисциплине | Всего (в з/е и часах) | Семестр 7 |
|--|-----------------------|------------|
| Общая трудоемкость дисциплины | 4 з.е./144 | 4 з.е./144 |
| Контактная работа - Аудиторные занятия | 50 | 50 |

| | | |
|--------------------------------|--------------------|-------------|
| Лекции | 16 | 16 |
| Семинары, практические занятия | 34 | 34 |
| Самостоятельная работа | 94 | 94 |
| вид текущего контроля | Контрольная работа | Контрольная |
| Вид промежуточной аттестации | экзамен | экзамен |

4. Учебно-тематический план

| № п/ п | Наименование тем (разделов) дисциплины | Трудоёмкость в часах | | | | | Формы текущего контроля успеваемо сти |
|--------------|--|----------------------|---------------------------------|--------|--|--|--|
| | | Всего | Контактная-Аудиторная работа | | | Самост оя-тельн ая работ а | |
| | | | Общая, в т.ч.: | Лекции | Семинары , практи- ческие занятия | | |
| 1 | Тема 1. Риск и неопределенность | 20 | 6 | 2 | 4 | 14 | Опрос. Учебная дискуссия. |
| 2 | Тема 2. Риски и их классификация | 20 | 6 | 2 | 4 | 14 | Опрос. Работа в малых группах. Решение практическ их заданий |
| 3 | Тема 3. Управление риском | 22 | 8 | 2 | 6 | 14 | Опрос. Учебная дискуссия |
| 4 | Тема 4. Оценка рисков | 24 | 10 | 4 | 6 | 14 | Опрос. Работа в малых группах. Решение практическ их заданий |

| | | | | | | | |
|----|---|-----|----|----|----|----|---|
| 5 | Тема 5. Методы обработки риска | 20 | 6 | 2 | 4 | 14 | Опрос. Учебная дискуссия |
| 6 | Тема 6. Мониторинг и управление рисками | 22 | 8 | 2 | 6 | 14 | Опрос. Работа в малых группах. Решение практических заданий |
| 7 | Тема 7. Принятие управленческих решений в условиях определенности, риска и неопределенности | 16 | 6 | 2 | 4 | 10 | Опрос. Учебная дискуссия. Подготовка к контрольной работе |
| | в целом по дисциплине | 144 | 50 | 16 | 34 | 94 | согласно учебному плану: контрольная работа |
| 24 | Итого % | 100 | 34 | 47 | 53 | 66 | |

5.Содержание практических и семинарских занятий

| Наименование тем (разделов) дисциплины | Перечень вопросов для обсуждения на семинарах, практических занятиях, рекомендуемые источники из разделов 6,7 (указывается раздел и порядковый номер источника) | Формы проведения занятия |
|--|--|---|
| Тема 1. Риск и неопределенность | <ol style="list-style-type: none"> 1. Понятие риска, его основные элементы и черты. 2. Экономические риски. 3. Целевые результаты проявления рискованной деятельности. 4. Общие принципы классификации рисков. 5. Характеристика рисков в различных сферах предпринимательской деятельности. <p>Рекомендуемая литература: 6:1,2,3,4,5,6,7,8 7:1,2,3,4,5,6.</p> | <p>Фронтальный опрос студентов по теме занятия.</p> <p>Изложение самостоятельно подготовленного материала с помощью мультимедийной презентации, обсуждение результатов.</p> <p>Решение кейсов.</p> <p>Тестирование.</p> |

| | | |
|---|---|---|
| <p>Тема 2. Риски и их классификация</p> | <p>1. Основные признаки классификации рисков. 2. Чистые и спекулятивные риски. 3. Производственные риски и причины их возникновения. 4. Транспортные риски и их сущность. 5. Операционные и технические риски. 6. Предпринимательские риски и их особенности. 7. Финансовые риски. Расчет финансовых рисков. 8. Прочие виды рисков. Рекомендуемая литература: 6: 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8 7: 1, 2, 3, 4, 5, 6.</p> | <p>Фронтальный опрос студентов по теме занятия. Изложение самостоятельно подготовленного материала с помощью мультимедийной презентации, обсуждение результатов. Решение кейсов. Тестирование.</p> |
| <p>Тема 3. Управление риском</p> | <p>1. Эволюция отношения к риску. 2. Современные концепции риск-менеджмента и понятие менеджмента-риска. 3. Фрагментированная и модель управления рисками. Переход от фрагментированной к интегрированной модели управления рисками. Сравнение фрагментированной и интегрированной моделей управления рисками 4. Характеристики системы управления рисками на разных этапах жизненного цикла организации. 5. Процесс управления рисками. Общая схема управления рисками. Логическая схема построения и работы системы управления рисками. 6. Схема управления рисками (процесс РМ) по версии Федерации европейских ассоциаций риск-менеджеров (FERMA). 7. Схема итеративного процесса оценки риска и уменьшения риска, возникающего при использовании продукции, процессов или услуг (ГОСТ Р 51898-2002 «Аспекты безопасности. Правила включения в стандарты»)). Рекомендуемая литература: 6: 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8 7: 1, 2, 3, 4, 5, 6.</p> | <p>Фронтальный опрос студентов по теме занятия. Изложение самостоятельно подготовленного материала с помощью мультимедийной презентации, обсуждение результатов. Решение кейсов. Тестирование.</p> |

| | | |
|---------------------------------------|---|--|
| <p>Тема 4. Оценка рисков</p> | <ol style="list-style-type: none"> 1. Процесс «Оценка риска». Риск и его идентификация. Составления перечня и описания элементов риска. 2. Описание риска. Понятия источника риска и события. 3. Подходы к идентификации рисков. Организация процесса идентификации рисков 4. Внутренние и внешние источники информации для идентификации рисков. Классификация источников. 5. Реестр рисков. Создание реестра рисков организации. 6. Изучение ключевых рисков организации и их основных факторов на примере конкретных обществ (ПАО, АО, ООО), в соответствии с рассмотренной классификацией с краткой общей характеристикой организации. <p>Рекомендуемая литература: 6: 1,2,3,4,5,6,7,8 7: 1,2,3,4,5,6.</p> | <p>Фронтальный опрос студентов по теме занятия. Изложение самостоятельно подготовленного материала с помощью мультимедийной презентации, обсуждение результатов. Решение кейсов. Тестирование.</p> |
| <p>Тема 5. Методы обработки риска</p> | <ol style="list-style-type: none"> 1. Измерение – количественная оценка риска. Дискретные и непрерывные модели риска. 2. Законы распределения случайных величин, используемые при оценке рисков. 3. Изучения равномерного закона распределения и его свойств на основе табличного процессора MS Excel 4. Изучения нормального закона распределения и его свойств на основе табличного процессора MS Excel. 5. Изучение биномиального закона распределения и его свойств на основе табличного процессора MS Excel. 6. Расчет практико-ориентированного задания по имитационному моделированию рисков проекта <p>Рекомендуемая литература: 6: 1,2,3,4,5,6,7,8 7: 1,2,3,4,5,6.</p> | <p>Фронтальный опрос студентов по теме занятия. Изложение самостоятельно подготовленного материала с помощью мультимедийной презентации, обсуждение результатов. Решение кейсов. Тестирование.</p> |

| | | |
|---|--|---|
| Тема 6. Мониторинг и управление рисками | <p>1. Интегрированная система формирования информационной базы в менеджменте риска.</p> <p>2. Уровни "управляемого интереса" в сложном сочетании рискованной деятельности.</p> <p>3. Концептуальные подходы менеджмента риска по обеспечению рационального хозяйствования.</p> <p>4. Модели комплексной оценки и прогнозирования риска финансовой несостоятельности предприятия.</p> <p>5. Факторы и модели оценки риска финансовой несостоятельности предприятия.</p> <p>6. Модели комплексной балльной оценки риска финансовой несостоятельности предприятия.</p> <p>Рекомендуемая литература: 6:1,2,3,4,5,6,7,8 7:1,2,3,4,5,6.</p> | <p>Фронтальный опрос студентов по теме занятия.</p> <p>Изложение самостоятельно подготовленного материала с помощью мультимедийной презентации, обсуждение результатов.</p> <p>Решение кейсов.</p> <p>Тестирование.</p> |
| Тема 7. Принятие управленческих решений в условиях определенности, риска и неопределенности | <p>1. Решение задач принятия решений без использования численных значений вероятностей исходов, с использованием вероятностей и по методу Парето.</p> <p>2. Графическое отображение процесса принятия решений - дерево управленческих решений.</p> <p>3. Расчет показателя VAR на основе табличного процессора MS Excel.</p> <p>Рекомендуемая литература: 6:1,2,3,4,5,6,7,8 7:1,2,3,4,5,6.</p> | <p>Фронтальный опрос студентов по теме занятия.</p> <p>Решение кейсов и практических задач.</p> <p>Тестирование.</p> |

6.Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

Нормативные акты

- 1 Федеральный закон от 22. 04. 1996 N 39-ФЗ "О рынке ценных бумаг"
- 2 Федеральный Закон № 86-ФЗ от 10 июля 2002 г. «О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)». Режим доступа: <http://www.consultant.ru>.
- 3 Федеральный Закон № 395-1 от 2 декабря 1990 г. «О банках и банковской деятельности». Режим доступа: <http://www.consultant.ru>.

4 Федеральный закон от 29.11.2001 N 156-ФЗ "Об инвестиционных фондах".
Принят Государственной Думой.

Основная литература

5. Основы риск-менеджмента: / Д. Гэлаи, М. Кроуи, В. Б. Минасян, Р. Марк. — Москва: Юрайт, 2020. — 390 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02578-1. — URL: <https://ez.el.fa.ru:2428/bcode/449729> – Режим доступа: Электронно-библиотечная система Юрайт. – Текст: электронный.

6. Вяткин, В.Н. Риск - менеджмент: учебник / В.Н. Вяткин, В.А. Гамза, Ф.В. Маевский. – 2-е изд., перераб. и доп. - Москва: Юрайт, 2020.- 365 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-3502-8. — URL: <https://ez.el.fa.ru:2428/bcode/469020> – Режим доступа: Электронно-библиотечная система Юрайт. – Текст: электронный.

Дополнительная литература

7. Пименов, Н. А. Управление финансовыми рисками в системе экономической безопасности: учебник и практикум для вузов / Н. А. Пименов. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва: Юрайт, 2021. — 326 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-04539-0. — URL: <https://ez.el.fa.ru:2428/bcode/468945> (дата обращения: 11.05.2022). – Режим доступа: Электронно-библиотечная система Юрайт. – Текст: электронный.

8. Финансовый менеджмент: учебник для академического бакалавриата / Г. Б. Поляк [и др.] ; ответственный редактор Г. Б. Поляк. — 4-е изд., перераб. и доп. — Москва : Юрайт, 2019. — 456 с. — (Авторский учебник). — ISBN 978-5-9916-4395-5. — URL: — Режим доступа: Электронно-библиотечная система Юрайт. – Текст: электронный.

6. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины

1. Электронно-библиотечная система BOOK.RU <http://www.book.ru>
2. Электронно-библиотечная система Znanium <http://www.znanium.com>

3. Электронно-библиотечная система «Университетская библиотека ОНЛАЙН» <http://biblioclub.ru/>

4. Электронно-библиотечная система издательства «ЮРАЙТ» <https://www.biblio-online.ru>

5. Электронная библиотека издательского дома «Гребенников» <https://grebennikon.ru>

6. Электронно-библиотечная система издательства «Лань» <https://e.lanbook.com>

7. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень необходимого программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости)

7.1 Комплект лицензионного программного обеспечения:

1) Антивирусная защита Kaspersky Security для виртуальных и облачных сред;

2) Windows, Microsoft Office.

7.2 Современные профессиональные базы данных, и информационные справочные системы

1. Информационно-правовая система «Гарант»: <https://www.garant.ru>

2. Электронная энциклопедия: <http://ru.wikipedia.org/wiki/Wiki>

3. Большая Российская энциклопедия: <https://bigenc.ru/>

7.3 Сертифицированные программные и аппаратные средства защиты информации

Не используются

8.Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине

362002, Республика Северная Осетия-Алания, г. Владикавказ, ул. Молодежная, д. 7, аудитория № 52.

Специализированная мебель:

Стол одно-тумбовый – 1 шт.

Стол (двухместный) – 17 шт.

Стул – 34 шт.

Шкаф под документы с угловым сегментом – 1 шт.

Шкаф под документы – 3 шт.

Кафедра – 1 шт.

Доска настенная – 1 шт.

Технические средства обучения:

Компьютер в сборе – 1 шт.

Мультимедиа-проектор – 1 шт.

Экран настенный – 1 шт.

Перечень лицензионного программного обеспечения:

1) Программы для ЭВМ Kaspersky Security для виртуальных и облачных сред;

2) Windows, Microsoft Office.

Учебная аудитория оснащена компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду Финансового университета.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся:

362002, Республика Северная Осетия-Алания, г. Владикавказ, ул. Молодежная, д.7, аудитория № 72.

Специализированная мебель:

Стол (учительский) – 1 шт.

Стол (двухместный) – 6 шт.

Стол компьютерный – 10 шт.

Стул – 27 шт.

Доска настенная – 1 шт.

Шкаф для документов – 1 шт.

Технические средства обучения:

Компьютер в сборе – 10 шт.

Мультимедиа-проектор – 1 шт.

Экран настенный – 1 шт.

Перечень лицензионного программного обеспечения:

1) Программы для ЭВМ Kaspersky Security для виртуальных и облачных сред

2) Windows, Microsoft Office

362002, Республика Северная Осетия-Алания, г. Владикавказ, ул. Молодежная, д.7, кабинет № 55. Читальный зал:

Специализированная мебель:

Стол – 20 шт.

Стул – 40 шт.

Шкаф для книг – 4 шт.

Стеллаж книжный – 13 шт.

Стеллаж выставочный – 4 шт.

Технические средства обучения:

Компьютер в сборе – 6 шт.

Телевизор – 1 шт.

Перечень лицензионного программного обеспечения:

1) Программы для ЭВМ Kaspersky Security для виртуальных и облачных сред

2) Windows, Microsoft Office

Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду Финансового университета.

>

