

МИНОБРНАУКИ РОССИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Волгоградский государственный социально-педагогический университет»
Институт технологии, экономики и сервиса
Кафедра технологии, экономики образования и сервиса



«УТВЕРЖДАЮ»

Проректор по учебной работе

Ю. А. Жадаев

2020 г.

Риск-менеджмент

Программа учебной дисциплины

Направление 38.03.01 «Экономика»

Профиль «Бухгалтерский учет, анализ и аудит»

заочная форма обучения

Волгоград
2020

Обсуждена на заседании кафедры технологии, экономики образования и сервиса
« 27 » 02 2020 г., протокол № 6

Заведующий кафедрой _____ « 27 » 02 2020 г.
(подпись) (зав. кафедрой) (дата)

Рассмотрена и одобрена на заседании учёного совета института технологии, экономики и сервиса « 27 » 02 2020 г. , протокол № 5

Председатель учёного совета _____ « 27 » 02 2020 г.
(подпись) (дата)

Утверждена на заседании учёного совета ФГБОУ ВО «ВГСПУ»
« 02 » 03 2020 г. , протокол № 6

Отметки о внесении изменений в программу:

Лист изменений № _____
(подпись) (руководитель ОПОП) (дата)

Лист изменений № _____
(подпись) (руководитель ОПОП) (дата)

Лист изменений № _____
(подпись) (руководитель ОПОП) (дата)

Разработчики:

Насонова Людмила Ивановна, кандидат экономических наук, доцент кафедры технологии, экономики образования и сервиса ФГБОУ ВО «ВГСПУ».

Программа дисциплины «Риск-менеджмент» соответствует требованиям ФГОС ВО по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика» (утверждён приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от 12 ноября 2015 г. № 1327) и базовому учебному плану по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика» (профиль «Бухгалтерский учет, анализ и аудит»), утверждённому Учёным советом ФГБОУ ВО «ВГСПУ» (от 02 марта 2020г., протокол № 6).

1. Цель освоения дисциплины

Формирование представлений о методах систематизации и обобщения информации о рисках деятельности организации.

2. Место дисциплины в структуре ОПОП

Дисциплина «Риск-менеджмент» относится к вариативной части блока дисциплин. Профильной для данной дисциплины является организационно-управленческая профессиональная деятельность.

Для освоения дисциплины «Риск-менеджмент» обучающиеся используют знания, умения, способы деятельности и установки, сформированные в ходе изучения дисциплин «Ведение в специальность», «Маркетинг», «Статистика», «Финансы», «Эконометрика», «Экономика организации», «Деньги, кредит, банки», «Информационные системы в управлении», «Концепции современного естествознания», «Методы оптимальных решений», «Предпринимательское право», «Теория организации», «Элективные дисциплины по физической культуре и спорту».

Освоение данной дисциплины является необходимой основой для последующего изучения дисциплин «Ведение в специальность», «История экономических учений», «Менеджмент», «Основы страхового дела», «Статистика», «Философия», «Финансовые рынки», «Финансовый менеджмент», «Финансы», «Эконометрика», «Экономика управления персоналом», «Бизнес-анализ», «Государственное регулирование экономики», «Деньги, кредит, банки», «Конфликтология», «Налоговый контроль и администрирование», «Налоговый учет и отчетность», «Судебно-бухгалтерская экспертиза», «Тайм-менеджмент», «Управление человеческими ресурсами», «Финансовое право», «Элективные дисциплины по физической культуре и спорту», прохождения практик «Практика по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности», «Преддипломная практика».

3. Планируемые результаты обучения

В результате освоения дисциплины выпускник должен обладать следующими компетенциями:

– способностью организовать деятельность малой группы, созданной для реализации конкретного экономического проекта (ПК-9);

– способностью использовать для решения коммуникативных задач современные технические средства и информационные технологии (ПК-10).

В результате изучения дисциплины обучающийся должен:

знать

- теоретические и практические основы построения системы риск-менеджмента;
- способы принятия решений в условиях риска и неопределенности;
- механизмы воздействия на риски;

уметь

- подготавливать и принимать решения в условиях риска;
- производить оптимизацию и оценку рисков;
- подготавливать и принимать решения в условиях неопределенности, оценивать возможность принятия рискованного решения;

владеть

- навыками поиска и обработки информации для анализа различных экономических рисков и выбора метода управления ими;
- методами управления рисками;
- навыками анализа и оценки рисков.

4. Объём дисциплины и виды учебной работы

Вид учебной работы	Всего часов	Семестры	
		2з / 2л	
Аудиторные занятия (всего)	22	14 / 8	
В том числе:			
Лекции (Л)	8	8 / –	
Практические занятия (ПЗ)	14	6 / 8	
Лабораторные работы (ЛР)	–	– / –	
Самостоятельная работа	118	29 / 89	
Контроль	4	– / 4	
Вид промежуточной аттестации		– / ЗЧО	
Общая трудоемкость	часы	144	43 / 101
	зачётные единицы	4	1.19 / 2.81

5. Содержание дисциплины

5.1. Содержание разделов дисциплины

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела дисциплины
1	Теоретические основы риск-менеджмента	Введение в риск-менеджмент. Классификация рисков, этапы управления рисками. Организация риск-менеджмента на предприятии. Особенности выбора стратегии и методы решения управленческих задач. Многовариантность риск-менеджмента, эвристические правила риск-менеджмента
2	Модели и методы разработки решений по управлению рисками в условиях конкуренции	Определение «функция полезности». Методы математического прогнозирования и оценки рисков на основе принципа «опоры на собственные силы». Модели расчета показателей риска банкротства и невозврата кредита в системе антикризисного управления фирмой
3	Управление рисками на финансовом рынке	Методы управления рисками на фондовом рынке. Оценка риска при проведении сделок с заемными средствами. Риски и страхование бизнеса. Особые условия договора

5.2. Количество часов и виды учебных занятий по разделам дисциплины

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Лекц.	Практ. зан.	Лаб. зан.	СРС	Всего
1	Теоретические основы риск-менеджмента	2	2	–	28	32

2	Модели и методы разработки решений по управлению рисками в условиях конкуренции	2	6	–	50	58
3	Управление рисками на финансовом рынке	4	6	–	40	50

6. Перечень основной и дополнительной учебной литературы

6.1. Основная литература

1. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2018. — 365 с. — (Авторский учебник). — ISBN 978-5-9916-3502-8. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/412965>.
2. Фомичев, А.Н. Риск-менеджмент / А.Н. Фомичев. – 7-е изд. – Москва: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2020. – 372 с. торговая корпорация «Дашков и К°», 2020. – 372 с.
3. Солодов, А.К. Основы финансового риск-менеджмента: учебник и учебное пособие / А.К. Солодов; Финуниверситет. — Москва: Издание Александра К. Солодова, 2018 — 286 с. — Имеется электронная версия: Электронные данные (1 файл: 3,91 Мб). — Свободный доступ из сети Интернет (чтение, печать, копирование). — <URL:http://elib.fa.ru/fbook/solodov_64842.pdf>..
4. Риск-менеджмент инвестиционного проекта: Учебник / Под ред. Грачевой М.В.. - М.: Юнити, 2018. - 576 с..
5. Ряховская, А.Н. Риск-менеджмент - основа устойчивости бизнеса: Учебное пособие / А.Н. Ряховская, О.Г. Крюкова, М.О. Кузнецова. - М.: Магистр, 2018. - 320 с.

6.2. Дополнительная литература

1. Покровский, А.К. Риск-менеджмент на предприятиях промышленности и транспорта: Учебное пособие / А.К. Покровский. - М.: КноРус, 2017. - 416 с..
2. Уколов, А.И. Управление корпоративными рисками: инструменты хеджирования / А.И.Уколов, Т.Н. Гупалова. – 2-е изд., стер. – Москва : Директ-Медиа, 2017. – 554 с.https://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=273678&sr=1.
3. Уколов, А.И. Оценка рисков / А.И. Уколов. – 2-е изд. стер. – Москва : Директ-Медиа, 2018. – 627 с. https://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=445268&sr=1.
4. Слепухина, Ю. Э. Риск-менеджмент на финансовых рынках : [учеб. пособие] / Ю. Э. Слепухина ; [науч. ред. А. Ю. Казак] ; М-во образования и науки Рос. Федерации, Урал. федер. ун-т. — Екатеринбург : Изд- во Урал. ун-та, 2015. — 216 с..
5. Мамаева, Л.Н. Управление рисками: Учебное пособие / Л.Н. Мамаева. — М.: Дашков и К, 2013. — 256 с..
6. Капустина, Н.В. Развитие организации на основе риск-менеджмента: теория, методология и практика: Монография / Н.В. Капустина. - М.: Инфра-М, 2018. - 304 с..
7. Соколов, Д.В. Базисная система риск-менеджмент организаций реального сектора экономики: Монография / Д.В. Соколов, А.В. Барчуков. - М.: Инфра-М, 2018. - 224 с..
8. Федорова, А.В. Риск-менеджмент (для менеджеров) (для бакалавров) / А.В. Федорова. - М.: КноРус, 2016. - 190 с.

7. Ресурсы Интернета

Перечень ресурсов Интернета, необходимых для освоения дисциплины:

1. Эл.библиотека Руконт, режим доступа <http://www.rucont.ru/efd/292911>.
2. Электронно-библиотечная система – Руконт.
3. Электронно-библиотечная система Юрайт.

8. Информационные технологии и программное обеспечение

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

1. Пакет офисных приложений Microsoft Office: Office Word 2007, Office Excel 2007, Power Point 2007.
2. Методический материал (перечень тематических вопросов, схемы, ситуации, задачи, тесты) для организации групповой и индивидуальной работы магистрантов на практических занятиях и в рамках выполнения СРС.
3. ИСС КОНСУЛЬТАНТ ПЛЮС.
4. ИСС ГАРАНТ.
5. IBM SPSS STATISTICS BASE.

9. Материально-техническая база

Для проведения учебных занятий по дисциплине «Риск-менеджмент» необходимо следующее материально-техническое обеспечение:

1. Аудитория для проведения лекционных, лабораторных и практических занятий, оснащенная стандартным набором учебной мебели, учебной доской и стационарным или переносным комплексом мультимедийного презентационного оборудования.
2. Методический, наглядный и раздаточный материал для организации групповой и индивидуальной работы обучающихся (схемы, таблицы, образцы анкет, памятки, варианты тестовых заданий и бланки ответов для проведения тестирования в периоды рубежных срезов и др.).

10. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Дисциплина «Риск-менеджмент» относится к вариативной части блока дисциплин. Программой дисциплины предусмотрено чтение лекций и проведение практических занятий. Промежуточная аттестация проводится в форме , аттестации с оценкой.

Лекционные занятия направлены на формирование глубоких, систематизированных знаний по разделам дисциплины. В ходе лекций преподаватель раскрывает основные, наиболее сложные понятия дисциплины, а также связанные с ними теоретические и практические проблемы, даёт рекомендации по практическому освоению изучаемого материала. В целях качественного освоения лекционного материала обучающимся рекомендуется составлять конспекты лекций, использовать эти конспекты при подготовке к практическим занятиям, промежуточной и итоговой аттестации.

Практические занятия являются формой организации педагогического процесса, направленной на углубление научно-теоретических знаний и овладение методами работы, в процессе которых вырабатываются умения и навыки выполнения учебных действий в сфере изучаемой науки. Практические занятия предполагают детальное изучение обучающимися отдельных теоретических положений учебной дисциплины. В ходе практических занятий формируются умения и навыки практического применения теоретических знаний в конкретных ситуациях путем выполнения поставленных задач, развивается научное мышление и речь, осуществляется контроль учебных достижений обучающихся.

При подготовке к практическим занятиям необходимо ознакомиться с теоретическим материалом дисциплины по изучаемым темам – разобрать конспекты лекций, изучить

литературу, рекомендованную преподавателем. Во время самого занятия рекомендуется активно участвовать в выполнении поставленных заданий, задавать вопросы, принимать участие в дискуссиях, аккуратно и своевременно выполнять контрольные задания.

Контроль за качеством обучения и ходом освоения дисциплины осуществляется на основе рейтинговой системы текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации студентов. Рейтинговая система предполагает 100-балльную оценку успеваемости студента по учебной дисциплине в течение семестра, 60 из которых отводится на текущий контроль, а 40 – на промежуточную аттестацию по дисциплине. Критериальная база рейтинговой оценки, типовые контрольные задания, а также методические материалы по их применению описаны в фонде оценочных средств по дисциплине, являющемся приложением к данной программе.

11. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы

Самостоятельная работа обучающихся является неотъемлемой частью процесса обучения в вузе. Правильная организация самостоятельной работы позволяет обучающимся развивать умения и навыки в усвоении и систематизации приобретаемых знаний, обеспечивает высокий уровень успеваемости в период обучения, способствует формированию навыков совершенствования профессионального мастерства.

Самостоятельная работа обучающихся во внеаудиторное время включает в себя подготовку к аудиторным занятиям, а также изучение отдельных тем, расширяющих и углубляющих представления обучающихся по разделам изучаемой дисциплины. Такая работа может предполагать проработку теоретического материала, работу с научной литературой, выполнение практических заданий, подготовку ко всем видам контрольных испытаний, выполнение творческих работ.

Учебно-методическое обеспечение для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине представлено в рабочей программе и включает в себя:

- рекомендуемую основную и дополнительную литературу;
- информационно-справочные и образовательные ресурсы Интернета;
- оценочные средства для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации по дисциплине.

Конкретные рекомендации по планированию и проведению самостоятельной работы по дисциплине «Риск-менеджмент» представлены в методических указаниях для обучающихся, а также в методических материалах фондов оценочных средств.

12. Фонд оценочных средств

Фонд оценочных средств, включающий перечень компетенций с указанием этапов их формирования, описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания, типовые контрольные задания и методические материалы является приложением к программе учебной дисциплины.