




МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования
«Дальневосточный федеральный университет»
(ДВФУ)
ШКОЛА ЭКОНОМИКИ И МЕНЕДЖМЕНТА


СОГЛАСОВАНО
Руководитель ОП



(подпись) Л.Н. Бабак
(ФИО)
«24» ноября 2022 г.

УТВЕРЖДАЮ

Директор менеджмента и предпринимательства



(подпись) Е.Н. Яшина
(И.О. Фамилия)
«24» ноября 2022 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
Риск менеджмент
Направление подготовки 38.03.02 Менеджмент
(Менеджмент)
Форма подготовки: очная

Рабочая программа составлена в соответствии с требованиями Федерального государственного образовательного стандарта по направлению подготовки 38.03.02 **Менеджмент**, утвержденного приказом Минобрнауки России от 12 августа 2020 г. № 970

Рабочая программа обсуждена на заседании Департамента менеджмента и предпринимательства протокол от «24» ноября 2022 г. № 4

Директор Департамента реализующего структурного подразделения Яшина Е.Н.

Составители: Шичалина В.А.

Владивосток
2023

Оборотная сторона титульного листа РПД

1. Рабочая программа пересмотрена на заседании Департамента/кафедры/отделения (реализующего дисциплину) и утверждена на заседании Департамента/кафедры/отделения (выпускающего структурного подразделения), протокол от « ____ » _____ 202 г. № _____

2. Рабочая программа пересмотрена на заседании Департамента/кафедры/отделения (реализующего дисциплину) и утверждена на заседании Департамента/кафедры/отделения (выпускающего структурного подразделения), протокол от « ____ » _____ 202 г. № _____

3. Рабочая программа пересмотрена на заседании Департамента/кафедры/отделения (реализующего дисциплину) и утверждена на заседании Департамента/кафедры/отделения (выпускающего структурного подразделения), протокол от « ____ » _____ 202 г. № _____

4. Рабочая программа пересмотрена на заседании Департамента/кафедры/отделения (реализующего дисциплину) и утверждена на заседании Департамента/кафедры/отделения (выпускающего структурного подразделения), протокол от « ____ » _____ 202 г. № _____

5. Рабочая программа пересмотрена на заседании Департамента/кафедры/отделения (реализующего дисциплину) и утверждена на заседании Департамента/кафедры/отделения (выпускающего структурного подразделения), протокол от « ____ » _____ 202 г. № _____

Аннотация дисциплины

Риск менеджмент

Общая трудоемкость дисциплины составляет 5 зачётных единиц / 180 академических часа. Является дисциплиной обязательной части ОП, изучается на 4 курсе и завершается экзаменом. Учебным планом предусмотрено проведение лекционных занятий в объеме 18 часов, практических 54 часов, а также выделены часы на самостоятельную работу студента - 126 часов.

Язык реализации: русский язык.

Цель: ознакомление студентов с основными положениями и направлениями теории и практики риск-менеджмента, формирование навыков оценки и управления финансовыми рисками для разработки стратегии риск-менеджмента в целях обеспечения экономической безопасности организаций.

Задачи:

1. Идентификации и оценки факторов рисков.
2. Выбора методов управления рисками.
3. Разработки стратегий риск-менеджмента для обеспечения экономической безопасности организаций.

Для успешного изучения дисциплины «Риск-менеджмент» у обучающегося по программе должны быть сформированы следующие предварительные компетенции:

- способностью понимать и анализировать мировоззренческие, социально и личностно значимые философские проблемы;
- способностью работать с различными информационными ресурсами и технологиями, применять основные методы, способы и средства получения, хранения, поиска, систематизации, обработки и передачи информации;
- способностью применять математический инструментарий для решения экономических задач;
- способностью использовать закономерности и методы экономической науки при решении профессиональных задач;
- способностью применять основные закономерности создания и

принципы функционирования систем экономической безопасности хозяйствующих субъектов;

– способностью обосновывать выбор методик расчета экономических показателей;

– способностью на основе типовых методик и действующей нормативно- правовой базы рассчитывать экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов;

– способностью выполнять необходимые для составления экономических разделов планов расчеты, обосновывать их и представлять результаты работы в соответствии с принятыми стандартами.

Планируемые результаты обучения по дисциплине «Риск менеджмент», соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы, характеризуют формирование следующих компетенций, индикаторов достижения компетенций:

Наименование категории (группы) универсальных компетенций	Код и наименование универсальной компетенции (результат освоения)	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Наименование показателя оценивания (результата обучения по дисциплине)
	ПК-1	ПК-1.7 Проводит анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании	Знает нормативно-правовую базу, регламентирующую порядок расчета финансово-экономических показателей Умеет анализировать и раскрывать природу экономических процессов на основе полученных финансово-экономических показателей Владеет навыками анализа результатов исследования моделей финансово-экономических задач и делает на их основании количественные и качественные выводы и рекомендации по принятию финансово-экономических решений

Для формирования вышеуказанных компетенций в рамках дисциплины «Риск менеджмент» применяются следующие образовательные технологии и

методы / активного / интерактивного обучения: деловая игра, работа в малых группах, «круглый стол».

I. Цели и задачи освоения дисциплины:

Цель: ознакомление студентов с основными положениями и направлениями теории и практики риск-менеджмента, формирование навыков оценки и управления финансовыми рисками для разработки стратегии риск-менеджмента в целях обеспечения экономической безопасности организаций.

Задачи:

- Идентификации и оценки факторов рисков.
- Выбора методов управления рисками.
- Разработки стратегий риск-менеджмента для обеспечения экономической безопасности организаций.

Место дисциплины в структуре ОПОП : входит в часть, формируемую участниками образовательных отношений.

Профессиональные компетенции студентов, индикаторы их достижения и результаты обучения по дисциплине

Наименование категории (группы) универсальных компетенций	Код и наименование универсальной компетенции (результат освоения)	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Наименование показателя оценивания (результата обучения по дисциплине)
	ПК-1	ПК-1.7 Проводит анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании	Знает нормативно-правовую базу, регламентирующую порядок расчета финансово-экономических показателей Умеет анализировать и раскрывать природу экономических процессов на основе полученных финансово-экономических показателей Владеет навыками анализа результатов исследования моделей финансово-экономических задач и делает на их основании количественные и качественные выводы и рекомендации по принятию финансово-экономических решений

II. Трудоемкость дисциплины и виды учебных занятий по дисциплине

Общая трудоемкость дисциплины составляет 4 зачётных единиц (180 академических часов).

Структура дисциплины:

Форма обучения – **очная**.

№	Наименование раздела дисциплины	Семестр	Количество часов по видам учебных занятий и работы обучающегося				Формы промежуточной аттестации, текущего контроля успеваемости
			Лек	Пр	СР	Контроль	
1	Раздел I. Понятие, сущность и содержание риск-менеджмента	8	4	6	20	6	Рейтинг-план 0-20%
2	Раздел 2. Анализ рисков		4	6	20	6	Рейтинг-план 0-20%
3	Раздел 3. Основы теории принятия рискованных решений		6	12	20	6	Рейтинг-план 0-20%
4	Раздел 4. Методы уменьшения риска.		2	6	20	6	Рейтинг-план 0-20%
5	Раздел 5. Система управления рисками		2	6	19	3	Рейтинг-план 0-20%
	Итого:		18	36	99	27	100% Рейтинг-плана

III. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ТЕОРЕТИЧЕСКОЙ ЧАСТИ КУРСА

Лекционные занятия (18 час.)

Раздел I. Понятие, сущность и содержание риск-менеджмента (4 час.)

Тема 1. Понятие риска и функции риска (1 час.)

Понятие риска. Функции риска (инновационная функция, регулирующая функция, конструктивность и деструктивность риска, защитная функция, аналитическая функция).

Тема 2. Причины возникновения рисков (1 час.)

Источники рисков. Условия и факторы рисков и их классификация.

Тема 3. Классификация рисков (1 час.)

Чистые и спекулятивные риски. Природные, экологические, политические, транспортные, производственные, финансовые, инфляционные, системные, селективные риски, риск ликвидности, кредитные риски, региональный и отраслевой риски, риск предприятия и инновационный риск.

Тема 4. Цель и задачи риск-менеджмента. (1 час.)

Понятие риск-менеджмента. Направления управления рисками. Критерий оценки эффективности риск-менеджмента.

Раздел 2. Анализ рисков (4 час.)

Тема 1. Качественный анализ рисков (1 час.)

Понятие зоны риска. Допустимый риск. Критический риск. Катастрофический риск. Кривая риска.

Тема 2. Количественные методы анализа рисков (3 час.)

Общая характеристика методов количественного анализа рисков. Коэффициент риска. Метод аналогий, метод анализа чувствительности, метод анализа сценариев, метод статистических испытаний (Монте-Карло), экспертные методы.

Раздел 3. Основы теории принятия рискованных решений (6 час.)

Тема 1. Вероятностная постановка принятия предпочтительных решений (3 час.)

Понятие риска решения и коэффициента вариации, их расчет. Основные положения вероятностного подхода. Принятие диверсифицированных решений. Дерево решений

Тема 2. Методы теории игр (3 час.)

Матрица платежей. Критерий Вальда. Оптимистический подход. Критерий Гурвица. Критерии Байеса-Лапласа и Лапласа. Матрица упущенной выгоды. Критерий упущенной выгоды Сэвиджа.

Раздел 4. Методы уменьшения риска. (2 час.) Управление операционными рисками. Управление кредитными рисками. Объединение и группирование рисков. Диверсификация. Распределение рисков.

Раздел 5. Система управления рисками (2 час.) Стандарты построения системы управления рисками: COSO, FERMA, ИСО/МЭК. Разработка системы управления организации.

IV. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ПРАКТИЧЕСКОЙ ЧАСТИ КУРСА

Практические занятия (36 час.)

Практическое занятие 1. Дерево решений (6 час.)

Решение ситуационных задач.

Практическое занятие 2. Методы теории игр (6 час.)

Решение ситуационных задач.

Практическое занятие 3. Вероятностные методы принятия предпочтительных решений (12 час.)

Решение ситуационных задач.

Практическое занятие 4. Методы уменьшения рисков (6 час.)

Семинар. Тестирование.
Практическое занятие 5. Стандарты систем управления рисками (6 час.)
 Семинар. Тестирование.

V. КОНТРОЛЬ ДОСТИЖЕНИЯ ЦЕЛЕЙ КУРСА

№ п/п	Контролируемые разделы / темы дисциплины	Коды и этапы формирования компетенций	Результаты обучения	Оценочные средства	
				текущий контроль	промежуточная аттестация
1	Раздел I. Понятие, сущность и содержание риск-менеджмента	ПК-1.1; ПК-1.2	знает типовые методики классификации рисков, их источников, условий и факторов риска	конспект (ПР-7);	Рейтинг-план (0-20%)
			умеет на практике использовать типовые методики управления рисками	конспект (ПР-7);	
2	Раздел 2. Анализ рисков		знает типовые методики качественной и количественной оценки рисков	конспект (ПР-7); контрольная работа (ПР-2)	Рейтинг-план (0-20%)
			умеет осуществлять качественный и количественный анализ рисков.	контрольная работа (ПР-2)	
3	Раздел 3. Основы теории принятия рискованных решений	знает методы дерева решений и методы теории игр.	конспект (ПР-7);	Рейтинг-план (0-20%)	
		умеет осуществлять расчет коэффициента вариации и выбор наиболее предпочтительных с точки зрения риска решений и анализ риска диверсифицированных проектов.	контрольная работа (ПР-2)		
4	Раздел 4. Методы уменьшения риска.		знает методы уменьшения рисков	конспект (ПР-7); тест ПР-1;	Рейтинг-план (0-20%)

			умеет осуществлять управление операцион-ными рисками, и кредитными рисками.	конспект (ПР-7); тест ПР-1;	
5	Раздел 5. Система управления рисками		знает существующие стандарты построения системы управления рисками.	конспект (ПР-7); тест ПР-1	Рейтинг-план (0-20%)
			Умеет осуществлять разработку системы управления рисками.	конспект (ПР-7); тест ПР-1	
Итого					100%

Текущий контроль. Предусматривает учет посещения студентами занятий в течении периода обучения и оценку своевременности и качества выполнения студентами практических заданий и самостоятельных работ.

Итоговый контроль. Предусматривает рейтинговую оценку по учебной дисциплине в течении семестра в процессе обучения.

VI. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ ОБУЧАЮЩИХСЯ

Самостоятельная работа определяется как индивидуальная или коллективная учебная деятельность, осуществляемая без непосредственного руководства педагога, но по его заданиям и под его контролем. Самостоятельная работа – это познавательная учебная деятельность, когда последовательность мышления студента, его умственных и практических операций и действий зависит и определяется самим студентом.

Самостоятельная работа студентов способствует развитию самостоятельности, ответственности и организованности, творческого подхода к решению проблем учебного и профессионального уровня, что в итоге приводит к развитию навыка самостоятельного планирования и реализации деятельности.

Целью самостоятельной работы студентов является овладение необходимыми компетенциями по своему направлению подготовки, опытом творческой и исследовательской деятельности.

Формы самостоятельной работы студентов:

- работа с основной и дополнительной литературой, Интернет ресурсами;
- самостоятельное ознакомление с лекционным материалом, представленным на электронных носителях, в библиотеке образовательного учреждения;
- подготовка реферативных обзоров источников периодической печати, опорных конспектов, заранее определенных преподавателем;
- поиск информации по теме, с последующим ее представлением в аудитории в форме доклада, презентаций;
- подготовка к выполнению аудиторных контрольных работ;
- выполнение домашних контрольных работ;
- выполнение тестовых заданий, решение задач;
- составление кроссвордов, схем;
- подготовка сообщений к выступлению на семинаре, конференции;
- заполнение рабочей тетради;
- написание эссе, курсовой работы;
- подготовка к деловым и ролевым играм;
- составление резюме;
- подготовка к зачетам и экзаменам;
- другие виды деятельности, организуемые и осуществляемые образовательным учреждением и органами студенческого самоуправления.

VII. СПИСОК ЛИТЕРАТУРЫ И ИНФОРМАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Основная литература
(печатные издания)

1. Фомичев А.Н. Риск-менеджмент. Учебник. 5-е издание. М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К», 2018. – 372 с.

Дополнительная литература

(печатные и электронные издания)

1. Васин С.М., Шутов В.С. Управление рисками на предприятии: учебное пособие. – М.: Кнорус, 2010. – 304 с.
2. Рогов В.А., Чудаков А.Д. Управление рисками: учебное пособие. – Старый Оскол: ТНТ, 2017. – 340 с.
3. Авдийский В.И., Безденежных В.М., Дадалко А.В., Земсков В.В., Синявский Н.Г. Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов: учебное пособие. – М.:ИНФРА-М, 2017. – 203 с.
4. Новиков А.И, Солодка Т.И. Теория принятия решений и управления рисками в финансовой и налоговой сферах: учебное пособие. М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К», 2017. – 372 с. – 288 с.
5. Мумладзе Р.Г. Управление инновационной деятельностью [Электронный ресурс]: учебник/ Мумладзе Р.Г., Николаев О.В., Толпаров Э.Б.— Электрон. текстовые данные.— М.: Русайнс, 2015.— 148 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/61670.html>.— ЭБС «IPRbooks»
6. Информационные технологии в бизнес-планировании [Электронный ресурс]: лабораторный практикум/ — Электрон. текстовые данные.— Ставрополь: Северо-Кавказский федеральный университет, 2017.— 98 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/75574.html>.— ЭБС «IPRbooks»
7. Финансовые рынки и финансовые инструменты: Учебное пособие / Господарчук Г.Г., Господарчук С.А. - М.:НИЦ ИНФРА-М, 2018. - 88 с.: 60x90 1/16. - (Высшее образование) ISBN 978-5-16-107386-5 (online) - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/1009831>
8. Оптимальная бизнес-модель: Четыре инструмента управления рисками / Гиروتра К. - М.:Альпина Пабл., 2016. - 216 с.: ISBN 978-5-9614-4652-4 - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/915743>

Дополнительная литература:

(печатные и электронные издания)

1. Корпоративное управление : учебник / В.Р. Веснин, В.В. Кафидов. — М. : ИНФРА-М, 2017. — 272 с. + Доп. материалы [Электронный ресурс; Режим доступа <http://www.znanium.com>]. — (Высшее образование: Магистратура).
2. Жаров Д. Финансовое моделирование в Excel [Электронный ресурс]/ Жаров Д.— Электрон. текстовые данные.— М.: Альпина Паблицер, Альпина

Бизнес Букс, 2016.— 170 с.— Режим доступа:
<http://www.iprbookshop.ru/41489.html>.— ЭБС «IPRbooks»

Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

1. Freedom Collection на портале ScienceDirect
<http://www.sciencedirect.com/>
2. Электронная библиотека и базы данных ДВФУ .
<http://dvfu.ru/web/library/elib>
3. Электронно-библиотечная система «Научно-издательского центра ИНФРА-М» <http://znanium.com>
4. Электронно-библиотечная система Российской государственной библиотеки им.Ленина. <http://www.rgb.ru>
5. Научная библиотека КиберЛенинка: <http://cyberleninka.ru/>
6. Angel Capital Association – Connections and ideals that drive returns.
<http://angelcapitalassociation.org>
7. McKinsey&Company. <http://www.mckinseyquarterly.com>

Перечень информационных технологий и программного обеспечения

1. Microsoft Word
2. Microsoft Excel
3. Microsoft PowerPoint
4. Microsoft Publisher
5. КонсультантПлюс / Гарант
6. Microsoft Internet Explorer/ Mozilla Firefox/ Opera

VIII. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

Успешное освоение дисциплины предполагает активную работу студентов на всех занятиях аудиторной формы: лекциях и практиках, выполнение аттестационных мероприятий. В процессе изучения дисциплины студенту необходимо ориентироваться на проработку лекционного материала, подготовку к практическим занятиям, выполнение контрольных и творческих работ.

Освоение дисциплины «Риск-менеджмент» предполагает рейтинговую

систему оценки знаний студентов и предусматривает со стороны преподавателя текущий контроль за посещением студентами лекций, подготовкой и выполнением всех практических заданий, выполнением всех видов самостоятельной работы.

Промежуточной аттестацией по дисциплине «Риск-менеджмент» является экзамен.

Студент считается аттестованным по дисциплине при условии выполнения всех видов текущего контроля и самостоятельной работы, предусмотренных учебной программой.

Шкала оценивания сформированности образовательных результатов по дисциплине представлена в фонде оценочных средств (ФОС).

IX. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Учебные занятия по дисциплине проводятся в помещениях, оснащенных соответствующим оборудованием и программным обеспечением.

Перечень материально-технического и программного обеспечения дисциплины приведен в таблице.

Материально-техническое и программное обеспечение дисциплины

Наименование специальных помещений и помещений для самостоятельной работы	Оснащенность специальных помещений и помещений для самостоятельной работы	Перечень лицензионного программного обеспечения. Реквизиты подтверждающего документа
Аудитории, оснащенные мультимедийным проектором Аудиторный фонд корпуса G, ШЭМ, ДВФУ	Библиотека ДВФУ, корпус А.	MS Office (Word, Excel, PPT, Teams) Консультант Плюс / Гарант Scopus, Science Direct.

X. ФОНДЫ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Фонды оценочных средств представлены в приложении.