Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Кубанский государственный университет»
Факультет экономический

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по учебной работе,
качеству образования – первый
проректор
_____ Хагуров Т.А.
подпись
«29» мая 2020г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Б1.В.ДВ 05.01 МЕТОДЫ И ИНСТРУМЕНТЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

Направление подготовки 38.04.01. Экономика

Направленность (профиль) Финансовая экономика

Программа подготовки академическая

Форма обучения заочная

Квалификация (степень) магистр

Краснодар 2020

1 Цели и задачи изучения дисциплины (модуля).

1.1 Цель освоения дисциплины: формирование и углубление у магистрантов необходимого объема компетенций, в т.ч. знаний, умений и навыков о современных концепциях, инструментах и методах управления рисками.

1.2 Задачи дисциплины: получение необходимых знаний и формирование умений и навыков по:

- овладению теоретическими и прикладными основами управления рисками; идентификации рисков,
- минимизации рисков инвестиционных и инновационных проектов,
- применению сценарного и имитационного подходов к моделированию рисков,
- хеджированию финансовых рисков;
- применению методов и инструментов минимизации факторов риска внутренней и внешней среды предприятия;

1.3 Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы.

Дисциплина «Методы и инструменты управления рисками» относится вариативной части Блока 1 "Дисциплины (модули)" учебного плана.

Для изучения дисциплины необходимы базовые знания по следующим дисциплинам: финансовый менеджмент в отраслях, современные проблемы финансовой экономики, практикум по финансовым вычислениям, корпоративная финансовая политика, эконометрика, методология управления инвестиционными проектами.

Овладение основами учебной дисциплины «Методы и инструменты управления рисками» является необходимой базой при углубленном изучении дисциплин, прогнозирование конъюктуры финансовых рынков, финансовое прогнозирование на предприятии, финансовые стратегии поведения экономических агентов на различных рынках, финансовые инструменты корпоративной защиты.

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

Изучение данной учебной дисциплины направлено на формирование у обучающихся профессиональных компетенций (ПК)

№ п.п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	**уметь**	**владеть**
1.	ПК-3	способностью проводить самостоятельные исследования в соответствии с разработанной программой	методологические основы риск-менеджмента; современные концепции управления рисками; основные инструменты и методы управления рисками; инструменты качественного	самостоятельно проводить исследования по: выбору концепции управления рисками на предприятии; идентификации рисков; ранжированию рисков; визуализации факто-	методами и инструментами проведения самостоятельных исследований по: качественному анализу рисков; идентификации рисков внутренней и внешней среды предприятия; оценке факторов риска по уровню возможного

№ п.п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	**уметь**	**владеть**
			анализа рисков для проведения самостоятельных исследований	ров риска с помощью графических методов	ущерба и вероятности возникновения факторов риска
2	ПК-4	способностью представлять результаты проведенного исследования научному сообществу в виде статьи или доклада	классификацию рисков внутренней и внешней среды предприятия (проекта); методы и инструменты количественного анализа рисков. Основные требования к оформлению докладов и научных статей.	представлять результаты проведенного исследования в виде статьи или доклада по: количественному анализу рисков; применению сценарного подход в управлении рисками; идентификации допустимых, критических и катастрофических рисков проектов. Разрабатывать мероприятия по управлению рисками. Интерпретировать результаты количественного анализа рисков	методами анализа чувствительности инвестиционного проекта к факторам риска; методами хеджирования финансовых рисков; современными экономико-математическими методами и инструментами по моделированию влияния факторов риска на деятельность предприятия или отдельного проекта. Умениями и навыками по представлению результатов исследования теоретических и практических аспектов управления рисками в виде докладов и научных статей

2. Структура и содержание дисциплины.

2.1 Распределение трудоёмкости дисциплины по видам работ.

Общая трудоёмкость дисциплины составляет 3 зач. ед. (108 часов), их распределение по видам работ представлено в таблице (для студентов ЗФО).

Вид учебной работы	Всего часов	Курс (часы)			
		6	___		
Контактная работа, в том числе:	**26,2**	**26,2**			
Аудиторные занятия (всего):	**26**	**26**			
Занятия лекционного типа	8	8		-	-
Лабораторные занятия				-	-

Занятия семинарского типа (семинары, практические занятия)		18	18		-	-
					-	-
Иная контактная работа:		**0,2**	**0,2**			
Контроль самостоятельной работы (КСР)						
Промежуточная аттестация (ИКР)						
Самостоятельная работа, в том числе:		**78**	**78**			
Курсовая работа		-	-	-	-	-
Проработка учебного (теоретического) материала		30	30	-	-	-
Выполнение индивидуальных заданий (подготовка сообщений, презентаций)		18	18	-	-	-
Реферат		10	10	-	-	-
Подготовка к текущему контролю		20	20	-	-	-
Контроль:						
Подготовка к экзамену		**3,8**	**3,8**			
Общая трудоемкость	**час.**	**108**	**108**	**-**	**-**	**-**
	в том числе контактная работа	**26,2**	**26,2**			
	зач. ед	**3**	**3**			

2.2 Структура дисциплины:

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины.

Разделы (темы) дисциплины, изучаемые на 6 курсе (ЗФО)

№	Наименование разделов (тем)	Количество часов				
		Всего	Аудиторная работа			Внеаудиторная работа
			Л	ПЗ	ЛР	СРС
1	2	3	4	5	6	7
1.	Концепции и модели риск-менеджмента	11	1	2		8
2.	Факторы риска внутренней и внешней среды предприятия (проекта)	18	2	2		14
3.	Методы и инструменты идентификации рисков	17	1	2		14
4.	Инструменты качественного анализа рисков	19	1	4		14
5.	Методы количественного анализа в риск-менеджменте	20	2	4		14
6.	Методы и инструменты управления рисками	19	1	4		14
	Итого по дисциплине:	**104**	**8**	**18**		**78**

Примечание: Л – лекции, ПЗ – практические занятия / семинары, ЛР – лабораторные занятия, СРС – самостоятельная работа студента

2.3 Содержание разделов (тем) дисциплины:
2.3.1 Занятия лекционного типа.

№	Наименование раздела (темы)	Содержание раздела (темы)	Форма текущего контроля
1	2	3	4
1.	Концепции и модели риск-менеджмента	Понятие «неопределенности» и «риска». Результаты проявления неопределенности. Модель управления рисками. Этапы реализации решений в риск-менеджменте. Концепции управления рисками. Концепция минимизации риска. Концепция приемлемого риска. Концепция «Риск как ресурс»	Контрольные вопросы
2.	Факторы риска внутренней и внешней среды предприятия (проекта)	Классификация рисков внешней и внутренней среды. Макроэкономические, мезо- и микроэкономические риски. Техногенные риски. Политические риски. Социальные риски. Проблемы прогнозирования рисков внешней среды. Классификация рисков внутренней среды. Производственно-технологические риски. Риски персонала. Маркетинговые риски. Логистические риски. Организационные риски. Финансовые риски. Валютные риски. Кредитные риски.. Риск выхода инвестора из проекта.	Контрольные вопросы
3.	Методы и инструменты идентификации рисков	Методы идентификации рисков. Качественный и количественный анализ. Анализ рисков инвестиционных проектов. Инструменты риск-анализа. Идентификация рисков сторонними экспертами. Стандартный и специализированные опросные листы для экспертов	Контрольные вопросы
4.	Инструменты качественного анализа рисков	Сущность качественного анализа проектных рисков. SWOT-анализ, метод Дельфи, метод «мозгового штурма» метод проектов-аналогов, диаграмма Исикавы, «роза рисков». Оценка вероятности возникновения и возможного ущерба от факторов риска. Экспертный метод: преимущества и недостатки	Контрольные вопросы
5.	Методы количественного анализа в риск-менеджменте	Анализ чувствительности проекта. Сценарный подход. Имитационное моделирование. Метод Монте-Карло. Статистический метод оценки риска. Метод экспертных оценок. Метод аналогов. Комбинированный метод.	Контрольные вопросы
6.	Методы и инструменты управления рисками предприятия (проекта)	Классификация инструментов риск-менеджмента. Инструменты управления проектными рисками по сферам деятельности. Хеджирование. Методы хеджирования (инструменты и стратегии). Хеджирование фьючерсными и форвардными контрактами ко Опционы. Валютные свопы. Диверсификация как инструмент управления рисками.	Контрольные вопросы

		Диверсификация инвестиционного портфеля компании. Диверсификация проектов с коррелируемыми и некоррелируемыми доходами.	

2.3.2 Занятия семинарского типа.

№	Наименование раздела (темы)	Тематика практических занятий (семинаров)	Форма текущего контроля
1	2	3	4
1.	Концепции и модели риск-менеджмента	1.Понятие «неопределенности» и «риска». 2. Модель управления рисками. 2.Этапы риск-менеджмента. 3. Концепции управления рисками. 4.Концепция минимизации риска. 5. Концепция приемлемого риска. 6. Концепция «Риск как ресурс»	Р
2.	Факторы риска внутренней и внешней среды предприятия (проекта)	1.Классификация рисков внешней и внутренней среды. 2.Макроэкономические, мезо- и микроэкономические риски. 3. Техногенные риски. 4.Политические риски. Социальные риски. 5.Проблемы прогнозирования рисков внешней среды. 6. Классификация рисков внутренней среды. 7.Производственно-технологические риски. Риски персонала. 8.Маркетинговые риски. Логистические риски. 9.Организационные риски.10. Финансовые риски. Валютные риски. Кредитные риски. 11 Риск выхода инвестора из проекта.	Р, ДИ
3.	Методы и инструменты идентификации рисков	1.Методы идентификации рисков.2. Качественный и количественный анализ. 3.Анализ рисков инвестиционных проектов. 4. Инструменты риск-анализа. 5.Идентификация рисков сторонними экспертами.6.Стандартный и специализированные опросные листы для экспертов	Р, РГЗ, КЗ
4.	Инструменты качественного анализа рисков	1.Сущность качественного анализа проектных рисков. 2.SWOT-анализ, 3. Метод Дельфи, метод «мозгового штурма». 4. Метод проектов-аналогов. 5. диаграмма Исикавы, «роза рисков». 6. Оценка вероятности возникновения и возможного ущерба от факторов риска. 7.Экспертный метод: преимущества и недостатки	Р, РГЗ, КЗ
5.	Методы количественного анализа в риск-менеджменте	1Анализ чувствительности проекта к факторам риска. 2.Сценарный подход.2. Имитационное моделирование. Метод Монте-Карло. 3. Статистический метод оценки риска. 4.Метод экспертных прогнозных оценок факторов риска. 5. Комбинированный метод количественного анализа рисков	Р, РГЗ, КЗ
6.	Методы и инструменты управления рисками	1. Классификация инструментов риск-менеджмента. 2. Инструменты управления рисками предприятия (проекта). 3.Хеджирование. Методы хеджирования (хеджирование фьючерсными и	Р, РГЗ,ДИ

		форвардными контрактами 4. Опционы. 5. Страхование рисков. 6. Диверсификация как инструмент управления рисками.	

Примечание: Р – рефераты, КЗ – контрольные задания, РГЗ – расчетно-графическое задание, ДИ – деловая игра

2.3.3 Лабораторные занятия. Не предусмотрены учебным планом

2.3.4 Примерная тематика курсовых работ (проектов). Курсовая работа не предусмотрена учебным планом

2.4 Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

№	Вид СРС	Перечень учебно-методического обеспечения дисциплины по выполнению самостоятельной работы
1	2	3
1	Подготовка к семинарскому занятию	Методические указания для подготовки к занятиям лекционного и семинарского типа. Утверждены на заседании Совета экономического факультета ФГБОУ ВО «КубГУ». Протокол № 8 от 29 июня 2017 г.
2	Подготовка реферата	Методические указания для подготовки эссе, рефератов, курсовых работ. Утверждены на заседании Совета экономического факультета ФГБОУ ВО «КубГУ». Протокол № 8 от 29 июня 2017 г.
3	Выполнение контрольных заданий	Методические указания по выполнению самостоятельной работы обучающихся. Утверждены на заседании Совета экономического факультета ФГБОУ ВО «КубГУ». Протокол № 8 от 29 июня 2017 г.
4.	Выполнение расчетно-графического задания	Методические указания по выполнению расчетно-графических заданий. Утверждены на заседании Совета экономического факультета ФГБОУ ВО «КубГУ». Протокол № 8 от 29 июня 2017 г.

Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся из числа инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья (ОВЗ) предоставляются в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

Для лиц с нарушениями зрения:

– в печатной форме увеличенным шрифтом,

– в форме электронного документа,

– в форме аудиофайла,

– в печатной форме на языке Брайля.

Для лиц с нарушениями слуха:

– в печатной форме,

– в форме электронного документа.

Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

– в печатной форме,

– в форме электронного документа,

– в форме аудиофайла.

Данный перечень может быть конкретизирован в зависимости от контингента обучающихся.

3. Образовательные технологии.

Лекционный материал к изучаемой дисциплине предлагается в виде презентации с использованием мультимедийной аппаратуры. Каждое лекционное занятие рассчитано на демонстрацию 30-40 слайдов по ключевым моментам темы.

Основной целью практических занятий является усвоение учебного материала, рассмотренного на лекциях, и формирование необходимых профессиональных компетенций. При проведении практических занятий студенты готовят и представляют (с использованием программы Power Point) презентации или рефераты по теоретическим и практическим аспектам текущей темы, отвечают на вопросы преподавателя и других студентов. Кроме этого на отдельных практических занятиях студенты представляют результаты самостоятельной работы по выполнению индивидуальных расчетно-графических заданий или контрольных заданий.

Интерактивные образовательные технологии, используемые в аудиторных занятиях: дискуссии, презентации, конференции. В сочетании с внеаудиторной работой они создают дополнительные условия формирования и развития требуемых компетенций обучающихся, поскольку позволяют обеспечить активное взаимодействие всех участников учебного процесса.

Деловая игра. Деловая игра, кейсы – формы промежуточного контроля. Деловая игра (кейс) проводится для решения определенной организационно-экономической проблемы на уровне страны, региона, предприятия или структурного подразделения. Создаются группы из 3-5 студентов, представляющих свой вариант решения проблемы. Деловая игра может проводиться в рамках одной темы или быть сквозной (3-4 темы дисциплины). Структура практического занятия с применением деловой игры (кейса) включает следующие элементы: ознакомление студентов с исходной информацией, основными целями и задачами игры (10 мин.), деловая игра (60 мин), анализ и обсуждение результатов (20 мин.).

Расчетно-графическое задание. Проверка умений и навыков студентов по применению полученных знаний при решении конкретных заданий с применением комплекса графических и экономико-математических методов.

Дискуссия. Оценочное средство, применяемое при коллективном обсуждении проблемы по одной или нескольким темам учебной дисциплины, позволяющее оценить умение студента находить оптимальные варианты управленческих решений, аргументировать и защищать свою позицию.

Указанные образовательные технологии способствуют реализации в процессе обучения личностно-ориентированного и профессионально-компетентностного подходов.

Для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья устанавливается особый порядок освоения указанной дисциплины. В образовательном процессе используются социально-активные и рефлексивные методы обучения (ролевая игра), технологии социокультурной реабилитации с целью оказания помощи в установлении полноценных межличностных отношений с другими студентами, создании комфортного психологического климата в студенческой группе.

Также для лиц с ограниченными возможностями здоровья предусмотрена организация консультаций с использованием электронной почты.

4. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации.

4.1 Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля.

Примерные темы рефератов (ПК-3; ПК-4):

1. Специфика управления рисками инновационных проектов
2. Инструментарий управления финансовыми рисками инновационных проектов

3. Инструменты минимизация рисков на различных этапах инвестиционных проектов
4. Методы управления валютными рисками
5. Инструменты управления рисками персонала
6. Инструменты управления логистическими рисками
7. Управление экологическими рисками
8. Управление производственно-технологическими рисками
9. Инструменты и методы управления маркетинговыми рисками
10. Методика оценки финансовых рисков внутренне и внешней среды
11. SWOT и PEST-анализ в риск-менеджменте
12. Управление финансовыми рисками
13. Управление валютными рисками
14. Форвардные и фьючерсные контракты как инструменты управления финансовыми рисками
15. Особенности управления рисками в период экономической нестабильности
16. Диверсификация рисков инвестиционного портфеля компании
17. Системный подход к управлению налоговыми рисками
18. Современные инструменты качественного анализа рисков
19. Количественная оценка рисков инвестиционных проектов
20. Сценарный подход к управлению рисками
21. Инструментарий управления технологическими рисками
22. Экспертиза инновационных проектов как инструмент минимизации рисков
23. Имитационное моделирование как инструмент риск-менеджмента
24. Страхование имущественных рисков: преимущества и недостатки
25. Современные концепции риск-менеджмента

Примерные контрольные задания (ПК-3, ПК-4):

Задание 1.

Вышло из строя оборудование после гарантийного срока. Возможные простои 2 месяца. Планируемый доход в месяц: 2 млн. руб. Подобрать оптимальный инструмент управления риском, исходя из «концепции приемлемого риска»

Задание 2.

Вышло из строя оборудование во время гарантийного срока. Простои 1 месяц. Планируемый доход в месяц: 3 млн. руб. Подобрать оптимальный инструмент управления риском, исходя из «концепции приемлемого риска»

Задание 3.

Нарушение технологии из-за заводского брака оборудования. Остановка производства на 2 месяца. Ежемесячный доход компании: 5 млн. руб. Подобрать оптимальный инструмент управления риском

Задание 4

Провести анализ чувствительности проекта по PI, если затраты на логистику увеличатся на 20%.

Доля логистических издержек в совокупных затратах составляет 15%, дисконтированные совокупные затраты – 10 млн. р., дисконтированная совокупная выручка – 17 млн. р., первоначальные инвестиции – 5 млн. р.

Задание 5

Провести анализ чувствительности проекта по NPV, если затраты на подбор персонала из-за текучести кадров увеличатся на 20%.

Доля затрат на подбор персонала в совокупных затратах составляет 5%, дисконтированные совокупные затраты – 8 млн. р., дисконтированная совокупная выручка – 15 млн. р., первоначальные инвестиции – 4 млн.р.

Примерное расчетно-графическое задание (ПК-3; ПК-4):

1. Идентифицировать риски внутренней и внешней среды инвестиционного проекта по фазам проекта
2. Проранжировать риски по 10- балльной шкале: 1 – минимальная вероятность фактора риска; 10 – максимальная;
3. Выбрать риски средние (ранг 4-7) и высокие (8-10) – не менее 10.
4. Построить график «Роза рисков», диаграмму Исикавы дать краткий анализ
5. Предложить инструменты минимизации рисков по выбранным факторам риска
6. Рассчитать возможный ущерб от факторов риска по наиболее значимым рискам (с высоким и средним рангом)
7. Предложить оптимальный инструмент(ы) по управлению рисками
8. Рассчитать затраты на управление рисками по предлагаемым инструментам (суммарные затраты не более 15% от предполагаемого ущерба)

Примерная деловая игра (ПК-3, ПК-4):

Малое предприятие является разработчиком продуктовой инновации – пеноалюминия. композитного материала, обладающего уникальным набором свойств. Он легкий, но в то же время очень прочный и жесткий, способен эффективно поглощать шум и энергию удара, обладает низкой тепло- и электропроводностью. Кроме того, материал экологичен и может производиться из вторичного сырья. Сфера применения достаточно широкая: от производства посуды до машиностроения и строительства.

Цель игры: идентифицировать риски реализации данного проекта и подобрать наиболее эффективные инструменты при следующих условиях:

а) оборудование для производства пеноалюминия будет закупаться в США;

б) сырье для производства – отечественное;

в) из необходимых 150 млн. руб. первоначальных инвестиций, малое предприятие располагает только 15 млн. руб.

4.2 Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации.

Примерный перечень вопросов к зачету (ПК-3; ПК-4):

1. Понятие «неопределенности» и «риска».
2. Модель управления рисками.
3. Концепции управления рисками
4. Концепция «риск как ресурс»
5. Концепция минимизации рисков
6. Концепция приемлемого риска.
7. Классификация рисков внешней среды
8. Классификация рисков по степени ущерба
9. Кривая рисков
10. Классификация рисков внутренней среды
11. Производственно-технологические риски.
12. Риски персонала
13. Логистические риски

14. Маркетинговые риски
15. Организационные риски
16. Политические риски
17. Институциональные риски
18. Экологические и техногенные риски
19. Макроэкономические риски
20. Инструменты управления инфляционными рисками
21. Финансовые риски внутренней и внешней среды
22. Качественный анализ проектных рисков.
23. Ранжирование факторов риска
24. Методы идентификации рисков
25. SWOT-анализ, PEST - анализ
26. Метод проектов-аналогов
27. Диаграмма Исикавы.
28. Роза рисков
29. Методы оценки вероятности возникновения факторов риска.
30. Анализ чувствительности проекта. Коэффициент эластичности
31. Сценарный подход. Виды сценариев
32. Имитационное моделирование. Метод Монте-Карло
33. Классификация инструментов риск-менеджмента.
34. Страхование рисков
35. Специфика риск-менеджмента инновационных проектов
36. Инструменты диверсификации рисков
37. Резервные фонды в управлении рисками
38. Гарантийные фонды в системе риск-менеджмента
39. Хеджирование фьючерсными контрактами.
40. Управление производственно-технологическими рисками.
41. Управление рисками персонала
42. Управление логистическими рисками
43. Управление маркетинговыми рисками
44. Управление рисками финансового менеджмента
45. Управление институциональными рисками
46. Управление экологическими и техногенными рисками
47. Управление макроэкономическими рисками
48. Диверсификация инвестиционного портфеля.
49. Методы оценки ущерба от факторов риска
50. Оценка эффективности затрат на управление рисками

Оценочные средства для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья выбираются с учетом их индивидуальных психофизических особенностей.

– при необходимости инвалидам и лицам с ограниченными возможностями здоровья предоставляется дополнительное время для подготовки ответа на экзамене;

– при проведении процедуры оценивания результатов обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья предусматривается использование технических средств, необходимых им в связи с их индивидуальными особенностями;

– при необходимости для обучающихся с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов процедура оценивания результатов обучения по дисциплине может проводиться в несколько этапов.

Процедура оценивания результатов обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья по дисциплине (модулю) предусматривает предоставление информации в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

Для лиц с нарушениями зрения:
– в печатной форме увеличенным шрифтом,
– в форме электронного документа.
Для лиц с нарушениями слуха:
– в печатной форме,
– в форме электронного документа.
Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:
– в печатной форме,
– в форме электронного документа.
Данный перечень может быть конкретизирован в зависимости от контингента обучающихся.

5. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля).

5.1 Основная литература:

1. Управление рисками [Электронный ресурс] : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / А. В. Воронцовский. - М. : Юрайт, 2018. - 414 с. - https://biblio-online.ru/book/E098C311-CAA9-4FD5-AC72-5F801419DD64

2. Управление рисками проекта : учебное пособие для вузов / В. Е. Шкурко ; А. В. Гребенкина. 2-е изд. М. : Юрайт, 2018.182 с. https://biblio-online.ru/book/98B10AB3-0155-4551-8DA2-1E0AA6E566AC/upravlenie-riskami-proekta

3. Домащенко Д. В. Управление рисками в условиях финансовой нестабильности / Домащенко Д. В., Финогенова Ю. Ю. - М.: Магистр, ИНФРА-М Издательский Дом, 2015. - 240 с . URL http://znanium.com/bookread2.php?book=502885#

5.2 Дополнительная литература:

1. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., пер. и доп. — М. : Издательство Юрайт, 2018. — 365 с. — (Серия : Авторский учебник). — ISBN 978-5-9916-3502-8. — Режим доступа : www.biblio-online.ru/book/4627F69F-8A78-4F2B-BA77-0FBA1599D0AC.

2. Управление рисками проектов [Электронный ресурс] : учебное пособие / Е. В. Кулешова ; Томск : Эль Контент, 2015. - 188 с. - https://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=480767&sr=1

3. Управление финансовыми рисками : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / И. П. Хоминич [и др.] ; под ред. И. П. Хоминич, И. В. Пещанской. — М. : Издательство Юрайт, 2018. — 345 с. — (Серия : Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-01019-0. — Режим доступа : www.biblio-online.ru/book/419260FD-3B72-4848-A8C3-B8EBABF94F86.

4. Рягин, Ю. И. Рискология в 2 ч. Часть 1 : учебник для вузов / Ю. И. Рягин. — М. : Издательство Юрайт, 2018. — 255 с. — (Серия : Университеты России). — ISBN 978-5-534-01680-2. — Режим доступа : www.biblio-online.ru/book/A58CBF3E-26BD-46F7-BB2E-927515B6E898.

5. Основы риск-менеджмента / Д. Гэлаи, М. Кроуи, В. Б. Минасян, Р. Марк. — М. : Издательство Юрайт, 2018. — 390 с. — (Серия : Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-02578-1. — Режим доступа : www.biblio-online.ru/book/B09D2080

Для освоения дисциплины инвалидами и лицами с ограниченными возможностями здоровья имеются издания в электронном виде в электронно-библиотечных системах «Лань» и «Юрайт».

5.3. Периодические издания:

1. Управление риском
2.Управление финансовыми рисками

3.Финансовый директор
4.Финансовый менеджмент
5.Управление проектом
6.Финансы и кредит
7.Риск-менеджмент
8.Проблемы анализа риска
9.Управление проектами

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

1. http://www.parusinvestora.ru/refbook/rts/3.shtm
2. http://bre.ru/risk/
3. http://www.riskm.ru/
4. http://www.cfin.ru/finanalysis/risk

7. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля).

Для достижения целей и задач учебной дисциплины, формирования необходимых профессиональных компетенций студентам необходимо выполнять следующие методические указания:

1) систематическая работа в аудитории и вне аудитории под руководством преподавателя, а также самостоятельная работа по закреплению полученных знаний и навыков;

2) добросовестное выполнение заданий преподавателя на практических занятиях и в процессе самостоятельной подготовки;

3) выяснение и уточнение отдельных предпосылок, умозаключений и выводов, содержащихся в учебном курсе; взаимосвязей отдельных его разделов, используемых методов, характера их использования в практической деятельности бизнес-аналитика;

4) уяснение и сопоставление точек зрения различных авторов по затрагиваемым в учебном курсе проблемам; выявление дискуссионных вопросов и неточностей в материалах, опубликованных периодической и специальной литературе;

5) в случае возникновения трудностей в освоении теоретических и практических положений дисциплины разработка предложений преподавателю в части совершенствования учебного курса;

6) выступление на научно-практических конференциях, подготовка научных статей для опубликования в периодической печати, участие в работе студенческих научных обществ, круглых столах и диспутах.

Реферат — это письменная научная работа магистранта примерным объемом 12-15 страниц, способствующая развитию креативного мышления, формированию необходимых компетенций для научно-исследовательской и педагогической деятельности. Реферат готовится к определенному занятию, оформляется в печатном варианте или в виде презентации в MS PowerPoint с применением мультимедийных средств.

Основные требования к содержанию реферата:

1. Актуальность темы исследования. Тема может быть выбрана из рекомендуемого списка или предложена магистрантом, но согласованная с преподавателем.
2. Источники и аналитические данные не позднее 3-5 лет.
3. Особенно приветствуются статьи из зарубежных научных периодических изданий и фактический материал с сайтов корпораций, федеральных (региональных, муниципальных) органов управления.

4. Научный стиль изложения.
5. Уровень оригинальности текста 80-90% по системе Антиплагиат.
6. Краткие аргументированные выводы автора по проблематике реферата, результаты анализа и предложения по использованию передового российского и зарубежного опыта в экономике.

Основные требования к оформлению реферата:

1. Формат бумаги А4, шрифт - Times New Roman, 14 кегль, интервал 1,5, поля – 20 мм, ссылки на источники по тексту, для таблиц и графиков 12 кегль шрифта.

2. Структура: титульный лист, введение (1 стр.), где кратко формулируется цель, задачи исследования, актуальность и информационная база. Основная часть (анализ проблемы) (10 стр.). Заключение (2-3 стр.) - резюме работы и выводы автора. Список литературы (1-2 стр.).

3. Список использованных источников оформляется в соответствии с требованиями ГОСТа Р 7.0.5 – 2008.

В освоении дисциплины инвалидами и лицами с ограниченными возможностями здоровья большое значение имеет индивидуальная учебная работа (консультации) – дополнительное разъяснение учебного материала.

Индивидуальные консультации по предмету являются важным фактором, способствующим индивидуализации обучения и установлению воспитательного контакта между преподавателем и обучающимся инвалидом или лицом с ограниченными возможностями здоровья.

8. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю)

8.1 Перечень необходимого программного обеспечения

1 Microsoft Windows 8, 10,
2 Microsoft Office Professional Plus

8.2 Перечень необходимых информационных справочных систем и профессиональных баз данных

Обучающимся обеспечен доступ к современным профессиональным базам данных, профессиональным справочным и поисковым системам:

1. Консультант Плюс - справочная правовая система http://www.consultant.ru;
2. База данных международных индексов научного цитирования Web of Science (WoS) http://webofscience.com/;
3. База данных рефератов и цитирования Scopus http://www.scopus.com/;
4. Базы данных компании «Ист Вью» http://dlib.eastview.com;
5. База открытых данных Росфинмониторинга http://fedsfm.ru/opendata;
6. База открытых данных Росстата http://www.gks.ru/opendata/dataset;
7. База открытых данных Управления Федеральной службы государственной статистики по Краснодарскому краю и Республике Адыгея http://krsdstat.gks.ru/wps/wcm/connect/rosstat_ts/krsdstat/ru/statistics/krsndStat/db/;
8. Научная электронная библиотека (НЭБ) http://www.elibrary.ru/;
9. Электронная Библиотека Диссертаций https://dvs.rsl.ru;
10. Научная электронная библиотека КиберЛенинка http://cyberleninka.ru/

9. Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине

№	Наименование специальных помещений и помещений для самостоятельной работы	Номера аудиторий / кабинетов
1.	Учебные аудитории для занятий лекционного типа	Ауд. 201А, 202А, 205А, 520А, 207Н, 208Н, 209Н, 212Н, 214Н, 2026Л, 2027Л, 4033Л, 4034Л, 4035Л, 4036Л, 4038Л, 4039Л, 5040Л, 5041Л, 5042Л, 5045Л, 5046Л
2.	Учебные аудитории для проведения занятий семинарского типа	А208Н, 210Н, 216Н, 513А, 514А, 515А, 516А, 5043Л 201А, 202А, 205А, 520А, 2026Л, 2027Л, 4033Л, 4034Л, 4035Л, 4036Л, 4038Л, 4039Л, 5040Л, 5041Л, 5042Л, 5045Л, 5046Л, 207Н, 208Н, 209Н, 212Н, 214Н,
3.	Аудитории для групповых и индивидуальных консультаций	Кафедра Мировой экономики и менеджмента ауд.236
4.	Аудитории для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации	А208Н, 210Н, 216Н, 513А, 514А, 515А, 516А, 5043Л 201А, 202А, 205А, 520А, 201Н, 202Н, 203Н, А203Н, 207Н, 208Н, 209Н, 212Н, 214Н, 2026Л, 2027Л, 4033Л, 4034Л, 4035Л, 4036Л, 4038Л, 4039Л, 5040Л, 5041Л, 5042Л, 5045Л, 5046Л
5.	Помещения для самостоятельной работы, с рабочими местами, оснащенными компьютерной техникой с подключением к сети «Интернет» и обеспечением неограниченного доступа в электронную информационно-образовательную среду организации для каждого обучающегося, в соответствии с объемом изучаемых дисциплин	Ауд. 213А, 218А

РЕЦЕНЗИЯ

на рабочую программу дисциплины «Методы и инструменты управления рисками» для студентов направления «Экономика», магистерской программы «Финансовая экономика»

Рабочая программа направлена на формирование и углубление у магистрантов необходимого объема компетенций, в т.ч. знаний, умений и навыков о современных концепциях, инструментах и методах управления рисками.

Для успешной реализации целей и задач изучения дисциплины в рабочей программе представлены основные требования по формированию определенных общекультурных и профессиональных компетенций магистра.

Рабочая программа дисциплины содержит необходимые сведения о трудоемкости (в часах), объемах аудиторной и самостоятельной работы студентов, формах текущего контроля; вопросах, рассматриваемых на лекциях и семинарах, основной и дополнительной рекомендуемой учебной литературы; методическом, информационном и материально-техническом обеспечении учебного процесса.

Рабочая программа учебной дисциплины составлена с применением современных образовательных интерактивных технологий: дискуссии по ключевым вопросам лекций и семинаров, разбор конкретных производственных ситуаций, расчетно-графические задания, деловые игры, кейсы, имитационное моделирование.

Повышению эффективности учебного процесса также будет способствовать предлагаемый перечень тестовых и контрольных заданий, вопросы к зачету, список основной и дополнительной рекомендуемой литературы. Для углубленного изучения дисциплины, исследования прикладных аспектов рассматриваемых проблем составителем рабочей программы представлен список рекомендуемых периодических изданий и интернет-ресурсов.

Рабочая программа дисциплины «Методы и инструменты управления рисками» для студентов направления «Экономика», магистерской программы «Финансовая экономика» разработана в полном соответствии с требованиями ФГОС ВО третьего поколения и рекомендуется к применению в учебном процессе для всех форм обучения.

Рецензент:
директор ООО «Экоинвест»

_____ А.Г. Касьянов

РЕЦЕНЗИЯ

на рабочую программу по дисциплине «Методы и инструменты управления рисками» направления 38.04.01. «Экономика» для студентов магистерской программы «Финансовая экономика».

Рабочая программа подготовлена на кафедре мировой экономики и менеджмента ФГБОУ ВО «Кубанский государственный университет».

Составитель: к.э.н., доцент Александрин Ю..Н.

Рабочая программа дисциплины направлена на овладение теоретическими и прикладными основами управления рисками; получение необходимых знаний по идентификации рисков, минимизации рисков инвестиционных и инновационных проектов, применению сценарного и имитационного моделирования рисков, хеджированию финансовых рисков и диверсификации инвестиционного портфеля с учетом факторов риска.

Представленная на рецензию рабочая программа по дисциплине «Методы и инструменты управления рисками», разработанная для направления подготовки магистров 38.04.01 «Экономика», программы «Финансовая экономика» соответствует компетентностному подходу к обучению, а также требованиям Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки 38.04.01 «Экономика».

Рабочая программа дисциплины включает разделы: цели и задачи освоения дисциплины, место дисциплины в структуре ООП ВО, требования к результатам освоения содержания дисциплины, содержание и структура дисциплины, интерактивные образовательные технологии, используемые в аудиторных занятиях, учебно-методическое обеспечение дисциплины, методические указания и материалы по видам занятий.

РПД разработана с применением современных образовательных технологий: дискуссии по ключевым вопросам лекций и семинаров, расчетно-графические задания, деловые игры, кейс-стади, имитационное моделирование.

Предлагаемый перечень тестовых и контрольных заданий, вопросы к зачету, тематика рефератов и эссе позволят студентам оперативно проверять уровень знаний по учебной дисциплине, более эффективно готовиться к практическим занятиям. Следует отметить и учебно-методическое обеспечение учебного процесса. Кроме рекомендуемого списка основной и дополнительной литературы, составителем РПД представлены авторские учебно-методические пособия.

Особое внимание в рабочей программе дисциплины уделяется различным формам текущего контроля, разработанных с участием представителей работодателей. Также рабочая программа дисциплины предполагает активное применениев учебном процессе мультимедийных средств обучения.

Рецензируемая рабочая программа дисциплины «Методы и инструменты управления рисками» для студентов направления 38.04.01 «Экономика» магистерской программы «Финансовая экономика» полностью соответствует требованиям ФГОС ВО третьего поколения и рекомендуется к применению в учебном процессе для всех форм обучения.

Рецензент:
д.э.н., профессор кафедры маркетинга и торгового дела
ФГБОУ ВО «Кубанский государственный университет»

Воронов А. А. Воронов