

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего профессионального образования

**«УФИМСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АВИАЦИОННЫЙ  
ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ»**

Кафедра финансов и экономического анализа

**АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ**

УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

**«РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ В СИСТЕМЕ УПРАВЛЕНИЯ ХОЗЯЙСТВУЮЩИХ СУБЪЕКТОВ  
(БАЗОВЫЙ УРОВЕНЬ)»**

Уровень подготовки

высшее образование-магистратура

(высшее образование - бакалавриат; высшее образование – специалитет, магистратура)

Направление подготовки (специальность)

38.04.08. "Финансы и кредит"

(код и наименование направления подготовки, специальности)

Направленность подготовки (профиль, специализация)

"Финансы и кредит "

(наименование профиля подготовки, специализации)

Квалификация (степень) выпускника

Магистр

Форма обучения

заочная

Уфа 2015

Исполнители:

Ст.преподаватель каф. ФиЭА

должность

подпись



Гусева Г.Ю.

расшифровка подписи

Заведующий кафедрой

Финансов и экономического анализа

наименование кафедры

личная подпись



Кощегулова И.Р

расшифровка подписи

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего профессионального образования

**«УФИМСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АВИАЦИОННЫЙ  
ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ»**

Кафедра финансов и экономического анализа

**АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ**

УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

**«РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ В СИСТЕМЕ УПРАВЛЕНИЯ ХОЗЯЙСТВУЮЩИХ СУБЪЕКТОВ  
(БАЗОВЫЙ УРОВЕНЬ)»**

Уровень подготовки

высшее образование-магистратура

(высшее образование - бакалавриат; высшее образование – специалитет, магистратура)

Направление подготовки (специальность)

38.04.08. "Финансы и кредит"

(код и наименование направления подготовки, специальности)

Направленность подготовки (профиль, специализация)

"Финансы и кредит "

(наименование профиля подготовки, специализации)

Квалификация (степень) выпускника

Магистр

Форма обучения

заочная

Уфа 2015

Исполнители:

Ст.преподаватель каф. ФиЭА

*должность*

*подпись*

Гусева Г.Ю.

*расшифровка подписи*

Заведующий кафедрой

Финансов и экономического анализа

*наименование кафедры*

*личная подпись*

Коцегулова И.Р

*расшифровка подписи*

## 1. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина Риск-менеджмент в системе управления хозяйствующих субъектов (базовый уровень) является дисциплиной *вариативной* части ОПОП по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит, направленность: Финансы и кредит. Является дисциплиной по выбору обучающихся.

Рабочая программа составлена в соответствии с требованиями Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки магистров 38.04.08 Финансы и кредит, утвержденного приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от "30" марта 2015 г. № 325. Является неотъемлемой частью основной образовательной профессиональной программы (ОПОП).

Целью освоения дисциплины является формирование у будущих магистров в области финансов и кредита современных знаний в области теории управления рисками, стратегии и тактике управления рисками, о роли и значении управления рисками в системе управления хозяйствующих субъектов.

### Задачи:

- Сформировать системное представление о современных методах управления экономическими рисками.
- Изучить основные принципы и базовые концепции риск-менеджмента.
- Изучить методологические основы оценки рисков хозяйственных субъектов.
- Изучить организационные аспекты управления рисками.
- Изучить методы минимизации экономических рисков хозяйствующих субъектов.
- Изучить

### Входные компетенции:

№	Компетенция	Код	Уровень освоения, определяемый этапом формирования компетенции*	Название дисциплины (модуля), практики, научных исследований, сформировавших данную компетенцию
1	готовность действовать в нестандартных ситуациях, нести социальную и этическую ответственность за принятые решения	ОК-2	базовый уровень 1 этап	Психология и педагогика
2	способность провести анализ и дать оценку существующих финансово-экономических рисков, составить и обосновать прогноз динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро- и мезоуровне	ПК-4	базовый	Финансовое планирование (макроуровень)
3	способность обосновать на основе анализа финансово-экономических рисков стратегию поведения экономических агентов на различных сегментах финансового рынка	ПК-11	базовый	Анализ и прогнозирование финансово-экономических рядов

\*- **пороговый уровень** дает общее представление о виде деятельности, основных закономерностях функционирования объектов профессиональной деятельности, методов и алгоритмов решения практических задач;

-**базовый уровень** позволяет решать типовые задачи, принимать профессиональные и управленческие решения по известным алгоритмам, правилам и методикам;

-**повышенный уровень** предполагает готовность решать практические задачи повышенной сложности, нетиповые задачи, принимать профессиональные и управленческие решения в условиях неполной определенности, при недостаточном документальном, нормативном и методическом обеспечении.

#### Исходящие компетенции:

№	Компетенция	Код	Уровень освоения, определяемый этапом формирования компетенции	Название дисциплины (модуля), практики, научных исследований для которых данная компетенция является входной
1	способность провести анализ и дать оценку существующих финансово-экономических рисков, составить и обосновать прогноз динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро- и мезоуровне	ПК-4	базовый уровень освоения компетенции	НИР, ГИА Производственная практика Преддипломная практика
2	способность обосновать на основе анализа финансово-экономических рисков стратегию поведения экономических агентов на различных сегментах финансового рынка	ПК-11	базовый уровень освоения компетенции	Стратегии поведения на финансовых рынках Финансовая инженерия и производные финансовые инструменты Производственная практика Преддипломная практика НИР, ГИА

## 2. Перечень результатов обучения

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование элементов следующих компетенций.

#### Планируемые результаты обучения по дисциплине

№	Формируемые компетенции	Код	Знать	Уметь	Владеть
1	готовность действовать в нестандартных ситуациях, нести социальную и этическую ответственность за принятые решения	ОК-2		- учитывать психологическое восприятие рисковых решений	
2	способность провести анализ и дать оценку существующих	ПК-4	- способы оценки степени риска; - место риска в инвестировании	- применять количественные и качественные методы анализа	- навыками применения современных моделей оценки

№	Формируемые компетенции	Код	Знать	Уметь	Владеть
	финансово-экономических рисков, составить и обосновать прогноз динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро- и мезоуровне		капитала; - основные факторы, определяющие величину ущерба, нанесенного владельцу коммерческой организации	рисков для решения экономических задач; выбрать наименее рисковое вложение капитала; - анализировать и классифицировать риски, возникающие при деятельности предприятия, изыскивать методы их расчетов	рисков для решения экономических задач; - навыками анализа инвестиционных рисков; - навыками самостоятельного использования методов минимизации рисков хозяйствующих субъектов
3	способность обосновать на основе анализа финансово-экономических рисков стратегию поведения экономических агентов на различных сегментах финансового рынка	ПК-11	- принципы портфельного управления инвестированием; - принципы подбора и распределения активов; - принципы соотношения риска и доходности; - понятия безрискового актива; - способы управления финансовыми рисками; - методы количественного и качественного анализа финансовых показателей	-рассчитывать величину портфеля, достаточную для покрытия финансовых целей; - выявлять соответствие/несоответствие инвестиционного профиля клиента параметрам инвестиционного портфеля; - рассчитывать целевую доходность в зависимости от финансовых целей и начального капитала	

### 3. Содержание и структура дисциплины (модуля)

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетные единицы (108 часа).

Трудоемкость дисциплины по видам работ

Вид работы	Трудоемкость, час.	
	<b>2 семестр</b>	
	108 часов /3 ЗЕ	
Лекции (Л)	6	

Вид работы	Трудоемкость, час.	
Практические занятия (ПЗ)	8	
Лабораторные работы (ЛР)		
КСР	3	
Курсовая проект работа (КР)		
Расчетно-графическая работа (РГР)		
Самостоятельная работа (проработка и повторение лекционного материала и материала учебников и учебных пособий, подготовка к лабораторным и практическим занятиям, коллоквиумам, рубежному контролю и т.д.)	82	
Подготовка и сдача экзамена		
Подготовка и сдача зачета (контроль)	9	
Вид итогового контроля (зачет, экзамен)	зачет	

Содержание разделов и формы текущего контроля

№	Наименование и содержание раздела	Количество часов						Литература, рекомендуемая студентам*	Виды интерактивных образовательных технологий**
		Аудиторная работа				СРС	Всего		
		Л	ПЗ	ЛР	КСР				
1	<b>Риск-менеджмент: понятия, особенности, задачи:</b> Современная теория риск-менеджмента: предпосылки возникновения и основные этапы развития. Основные характеристики риск-менеджмента. Система целей и задач риск-менеджмента. Идентификация и классификация рисков.	4			1	15	20		<i>лекция-визуализация, проблемное обучение</i>
2	<b>Базовые показатели финансовых рисков:</b> Количественные и качественные методы анализа рисков. Использование теории вероятности в анализе рисков. Экспертный метод оценки риска. Специфические показатели, используемые для количественной оценки риска. Учет риска при принятии управленческих решений.	2	6		1	20	29		
3	<b>Оценка рисков инвестиций:</b> Определение цели риска и цели рискованных вложений капитала. Получение информации о хозяйственной ситуации, ее анализ. Анализ вариантов сопоставления прибыли и риска по вложениям капитала. Риски прямых инвестиций. Риски финансовых инвестиций.	2	6		1	13	22		
4	<b>Система управления рисками:</b> Понятие управления финансовыми рисками. Основное содержание и сущность системы риск-менеджмента. Элементы системы и их	2				10	12		<i>лекция-визуализация, проблемное обучение</i>

№	Наименование и содержание раздела	Количество часов						Литература, рекомендуемая студентам*	Виды интерактивных образовательных технологий**
		Аудиторная работа				СРС	Всего		
		Л	ПЗ	ЛР	КСР				
	взаимосвязь. Стратегия и тактика управления финансовым риском. Выбор стратегии и приемов управления риском, способов снижения степени риска. Учет психологического восприятия рискованных решений. Разработка программы действий по снижению риска. Организация выполнения намеченной программы и контроль.								
5	<b>Методы управления рисками:</b> Сущность приемов риск-менеджмента. Средства разрешения рисков: избегание, удержание, передача, снижение степени. Приемы снижения степени риска: диверсификация, лимитирование, самострахование, страхование, хеджирование.	2	4			10	16	<i>лекция-визуализация, проблемное обучение, обучение на основе опыта, деловая игра</i>	

Занятия, проводимые в интерактивной форме, составляют 100% от общего количества аудиторных часов по дисциплине Статистическое моделирование (продвинутый уровень).



## Практические занятия (семинары)

№ занятия	№ раздела	Тема	Кол-во часов
1	2	Расчет основных показателей измерения риска	2
2	2	Выбор варианта рискованного решения	2
3	2	Принятие решений в условиях риска и неопределенности	2
4	3	Расчет риска инвестиционных проектов	2
5	3	Расчет риска портфеля инвестиционных проектов	2
6	3	Расчет риска портфеля ценных бумаг	2
7,8	5	Разработка программы управления рисками	4

### Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины (модуля)

#### Основная литература

1. Гусева Г. Ю. Управление финансовыми рисками и страхование: учебное пособие для студентов, обучающихся по направлению подготовки магистров 521600 (08010068) "Экономика" (программа 521620 "Финансы") / Г. Ю. Гусева; ГОУ ВПО УГАТУ - Уфа: УГАТУ, 2010 - 189 с.
2. Шапкин А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин - Москва: Дашков и К, 2014 - 544 с.

#### 6.2 Дополнительная литература

1. Кириченко Т. В. Финансовый менеджмент: учеб. / Т. В. Кириченко - Москва: Дашков и К, 2014 - 484 с.

#### 6.3. Интернет-ресурсы (электронные учебно-методические издания, лицензионное программное обеспечение)

Электронная коллекция образовательных ресурсов УГАТУ

<http://www.library.ugatu.ac.ru/cgi-bin/zgate.exe?Init+ugatu-fulltxt.xml,simple-fulltxt.xml+rus>

#### Материально-техническое обеспечение дисциплины

- лекционные аудитории с современными средствами демонстрации 3-207, 3-213.
- кафедральные лаборатории, обеспечивающих реализацию ОПОП ВО: 3-213.

#### Адаптация рабочей программы для лиц с ОВЗ

Адаптированная программа разрабатывается при наличии заявления со стороны обучающегося (родителей, законных представителей) и медицинских показаний (рекомендациями психолого-медико-педагогической комиссии). Для инвалидов адаптированная образовательная программа разрабатывается в соответствии с индивидуальной программой реабилитации.