

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«ДАГЕСТАНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»
Экономический факультет

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Риск-менеджмент

Кафедра «Финансы и кредит» экономического факультета

Образовательная программа

38.03.01 Экономика

Направленность (профиль) подготовки
«Финансы и кредит»

Уровень высшего образования
бакалавриат

Форма обучения
Очная, очно-заочная

Статус дисциплины: *дисциплина по выбору*

Махачкала, 2021

Рабочая программа дисциплины «Риск-менеджмент» (онлайн-курс НИУ ВШЭ) рекомендована кафедрой финансов и кредита в 2021 году в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки 38.03.01 Экономика (уровень бакалавриата) от «12» августа 2020 г. №954.

Разработчик(и): НИУ ВШЭ, онлайн-курс

<https://openedu.ru/course/hse/RISKM/>

Швец Сергей Константинович, д.э.н., профессор, Санкт-Петербургская школа экономики и менеджмента, Департамент финансов

Рабочая программа дисциплины одобрена:

на заседании кафедры финансов и кредита от «_5_» июля 2021 г., протокол № 11.

И.о. зав. кафедрой

(подпись)

Махдиева Ю.М.

на заседании Методической комиссии экономического факультета от «_5_» июля 2021 г., протокол № 10.

Председатель

(подпись)

Судейманова Д.А.

Рабочая программа дисциплины согласована с учебно-методическим управлением «_5_» июля 2021 г.

Начальник УМУ

(подпись)

Гасангаджиева А.Г.

О курсе

Онлайн-курс НИУ ВШЭ рассчитан на студентов бакалавриата. Желательно, но не обязательно, иметь базовые знания по менеджменту и экономике. Специального материального и программного обеспечения для освоения удаленного курса не требуется. Основной целью дистанционного курса является формирование у слушателей профессиональных компетенций в области управления рисками на основе изучения теоретических основ риск-менеджмента и овладения практическими навыками анализа и оценки рисков компаний реального сектора экономики.

В процессе изучения курса слушателям будут предложены тестовые задания, а также расчетные задачи для отработки и закрепления прослушанного теоретического материала лекций. Так же по завершении курса слушателям будет предложен итоговый тест, состоящий так же из тестовых заданий и расчетных примеров.

Формат

Курс состоит из коротких видео-лекций от 5 до 20 минут длиной, внутри которых встроены не оцениваемые задачи и примеры. На каждой неделе будет представлен оцениваемый тест из 12 вопросов. После прохождения теоретического материала студентам будет предоставлен итоговый экзамен, состоящий из тестовых теоретических вопросов и задач.

Программа курса

- Тема 1. Риск и неопределенность.
- Тема 2. Риск, доходность и стоимость активов компании.
- Тема 3. Интегрированное управление рисками в компании.
- Тема 4. Диагностика рисков.
- Тема 5. Методы измерения рисков.
- Тема 6. Стресс-анализ компании.
- Тема 7. Метрики риска.
- Тема 8. Система элиминирования рисков.
- Тема 9. Управление финансовыми рисками компании.
- Тема 10. Управление нефинансовыми рисками компании.

Результаты обучения

В результате освоения курса слушатели получат следующие навыки:

Умение осуществлять качественную и количественную оценку рисков.

Умение разрабатывать стратегию элиминированию рисков (хеджирование, диверсификация, страхование).

Умение использовать современные методы управления рисками нефинансовых компаний для обеспечения динамического развития их бизнеса, проводить самостоятельные исследования в области управления рисками нефинансовых компаний в соответствии с разработанной программой.

Навыки разработки прогнозов развития определенной области знаний (технологий) в условиях риска и неопределенности.

Способность разрабатывать (формулировать) основные стратегии управления рисками.

Умение определять качественные и количественные критерии эффективности СИУР.

Информационные ресурсы

Основная литература:

1. Дамодаран А. Стратегический риск-менеджмент. Принципы и методики. Пер. с англ. –М.: И.Д. Вильямс, 2010.
2. Круи М., Галай Д., Марк Р. Основы риск-менеджмента. Пер.с англ. –М.: Юрайт, 2011.
3. Энциклопедия финансового риск-менеджмента/ Под ред. А.А. Лобанова и А.В. Чугунова.- 4-е изд. –М. Альпина Бизнес Букс. 2009.

Дополнительная литература:

1. Балдин К.В., Воробьев С.Н. Управление рисками: учебное пособие.-М.: Юнити-Дана, 2012.
2. Воронцовский А.В. Управление рисками: Учеб. пособие 3-е изд. – СПб.: Изд-во С.-Петерб. Ун-та, 2005.
3. Ляпина С.Ю., Грачева М.В. Управление рисками инновационной деятельности: учебное пособие. –М.: Юнити-Дана, 2012.
4. Просветов Г.И. Управление рисками: задачи и решения. Учебно-практическое пособие –М.: Альфа-Пресс, 2011.
5. Риск-менеджмент инвестиционного проекта: учебник. Под ред. М.В. Грачевой, Секерина. –М.: Юнити-Дана, 2009.
6. Рогова Е.М. Финансовый менеджмент: учебник –М.:Изд. Юрайт, 2011.
7. Рэдхэд К., Хьюс С. Управление финансовыми рисками. Пер. с англ. –М.: ИНФРА-М, 1996.
8. Уколов А.И., Гупалова Т.Н. Управление корпоративными рисками: инструменты хеджирования. Учебное пособие. –М.:Директ-Медиа, 2014.
9. Эллиот М. У. Основы финансирования риска. Пер. с англ. -М.: ИНФА-М, 2010.
10. Russel J. Cohn R. Enterprise risk management. LENNER Corp.62012.

Формируемые компетенции

Компетенции, приобретаемые в результате обучения:

ПК-7. Способность идентифицировать и анализировать финансовые и кредитные риски на макро-, мезо- и микроуровнях и предлагать мероприятия по воздействию на риски.

Сертификат

По данному курсу предусмотрен сертификат.