



**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования**

**«ДАГЕСТАНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»
Факультет Управления**

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ

Кафедра Менеджмент Факультет Управления

**Образовательная программа
38.05.01 Экономическая безопасность**

**специализация
«Система управления экономической
безопасностью»**

**Уровень высшего образования
Специалитет**

**Форма обучения
заочная**

Статус дисциплины: модуль профильной направленности

Махачкала - 2022г.

Рабочая программа дисциплины «Риск-менеджмент» составлена в 2022 году в соответствии с требованиями ФГОС ВО – специалитета по направлению подготовки 38.05.01 Экономическая безопасность направления (профиля) «Система управления экономической безопасностью» от «14» апреля 2021 г. № 293.

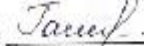
Разработчик: кафедра «Менеджмент»,
Юсупова М.Г. – ст. преподаватель




Рабочая программа дисциплины одобрена:
на заседании кафедры «Менеджмент» от 17.06.2022 г., протокол № 10

Зав. кафедрой  Магомедбеков Г.У.

на заседании Учебно-методической комиссии факультета управления от
01.07.2022г. протокол № 10

Председатель  Гашимова Л.Г.

Рабочая программа дисциплины согласована с учебно - методическим
управлением 4.07.2022г.

Начальник УМУ  Гасангаджиева А.Г.
(подпись)

Рабочая программа дисциплины «Риск-менеджмент» составлена в 2022 году в соответствии с требованиями ФГОС ВО – специалитета по направлению подготовки 38.05.01 Экономическая безопасность направления (профиля) «Система управления экономической безопасностью» от «14» апреля 2021 г. № 293.

Разработчик: кафедра «Менеджмент»,
Юсупова М.Г. – ст. преподаватель

Рабочая программа дисциплины одобрена:
на заседании кафедры «Менеджмент» от 17.06.2022 г., протокол № 10

Зав. кафедрой _____ Магомедбеков Г.У

на заседании Учебно-методической комиссии факультета управления от
01.07 2022г. протокол № 10

Председатель _____ Гашимова Л.Г.

Рабочая программа дисциплины согласована с учебно - методическим
управлением 4.07.2022г.

Начальник УМУ _____ Гасангаджиева А.Г.
(подпись)

СОДЕРЖАНИЕ

1.Цели освоения дисциплины

2.Место дисциплины в структуре ОПОП специалитета

3.Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины (перечень планируемых результатов обучения)

4. Объем, структура и содержание дисциплины.

5.Образовательные технологии

6.Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов.

7. Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины.

7.1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы.

7.2. Типовые контрольные задания

7.3. Методические материалы, определяющие процедуру оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций.

8.Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины.

9.Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины.

10.Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины.

11.Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем.

12.Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине.

Аннотация рабочей программы дисциплины

Дисциплина «Риск-менеджмент» входит в модуль профильной направленности ОПОП образовательной программы 38.05.01 «Экономическая безопасность», специализация «Система управления экономической безопасностью».

Предметом дисциплины «Риск-менеджмент» являются фундаментальные категории и технология разработки, принятия и реализации управленческих решений. Разработка и принятие управленческого решения по праву считается ключевым звеном процесса управления, обуславливающим достижение управленческих целей и эффективность функционирования организации.

Учебная дисциплина способствует углублению и расширению базовой профессиональной подготовки студентов, а так же учитывает их образовательные потребности.

Дисциплина направлена на формирование следующих компетенций у выпускника: универсальных -УК-2, профессиональных-ПК-2.

Курс «Риск-менеджмент» ориентирован на привитие студентам профессиональных навыков, необходимых в реальной управленческой деятельности. Данный учебный курс включает значительный объем самостоятельной работы. В курсе одновременно рассматриваются методологические проблемы и конкретные рекомендации успешных менеджеров. В значительной степени обучение предполагает выработку у студентов навыков работы над собой в целях профессионального роста.

Преподавание дисциплины предусматривает проведение следующих видов учебных занятий: лекции, практические занятия, самостоятельная работа.

Рабочая программа дисциплины предусматривает проведение следующих видов контроля: текущий контроль успеваемости в форме опросов, рефератов, дискуссий, тестов, решения задач и кейсов и промежуточный контроль в форме экзамена.

Объем дисциплины 3 зачетные единицы, в том числе 108 ч. в академических часах по видам учебных занятий.

Форма обучения: заочная

Семес тр	Учебные занятия							Форма промежуточной аттестации (зачет, дифференциро ванный зачет, экзамен
	в том числе							
	Контактная работа обучающихся с преподавателем							
	Все го	из них					СРС, в том числе экза мен	
Лекц ии		Лаборатор ные занятия	Практичес кие занятия	КС Р	консульта ции			
4	108	4		2			102	зачет

1. Цели освоения дисциплины

Целью изучения дисциплины «Риск-менеджмент» является формирование теоретических знаний о методах разработки, принятия и реализации управленческих решений и практических навыков находить организационно- управленческие решения и готовность нести за них ответственность.

Целью освоения у студентов дисциплины «Риск-менеджмент» является:

- воспитание у студентов чувства ответственности, закладка нравственных,

эстетических норм поведения в обществе и коллективе, формирование патриотических взглядов, мотивов социального поведения и действий, финансово-экономического мировоззрения, способностей придерживаться законов и норм поведения, принятых в обществе и в своей профессиональной среде;

- изучить методы обеспечения качества управления экономическими и производственными рисками в условиях неопределенности внешней и внутренней среды, с учетом факторов неопределенности ситуации и риска вкладываемых инвестиций;

- изучить факторы (экономические законы, научные подходы и др.), влияющие на управление рисков как основного условия достижения его конкурентоспособности;

- изучить технологии разработки, принятия, реализации и мотивации качественного управленческого решения; изучить методы анализа, прогнозирования, оптимизации и экономического обоснования экономических и производственных рисков в рамках системы менеджмента;

- получение практических навыков и умений самостоятельно разрабатывать и принимать управленческие решения и адаптировать методы принятия управленческих решений, исходя из особенностей конкретного объекта управления;

изучение современных методов управления экономических и производственных рисков, используемых в практической деятельности отечественных и зарубежных организаций;

- закрепить полученные знания с целью их применения на практике после окончания учебы.

2. Место дисциплины в структуре ОПОП магистратуры.

Дисциплина «Риск-менеджмент» входит в модуль профильной направленности ОПОП образовательной программы 38.05.01 «Экономическая безопасность», специализация «Система управления экономической безопасностью». и разработана в соответствии с требованиями ФГОС ВО, компетентностным подходом, реализуемым в системе высшего образования

В силу особой значимости решений в процессе управления, курс «Риск-менеджмент» при подготовке экономистов, занимает одно из ведущих мест.

Освоение данной дисциплины необходимо как предшествующее для изучения дисциплин: «Риск управления портфелем финансовых рисков», «Методы принятия государственных управленческих решений».

3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины (перечень планируемых результатов обучения и процедура освоения).

Код и наименование компетенции из ОПОП	Код и наименование индикатора достижения компетенций (в соответствии с ОПОП)	Планируемые результаты обучения	Процедура освоения
УК-2 Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	С-УК-2.1. Формулирует на основе поставленной проблемы проектную задачу и способ ее решения через реализацию проектного управления С-И УК-2.2. Разрабатывает концепцию проекта в рамках обозначенной проблемы: формулирует цель, задачи, обосновывает актуальность,	Знает: методы разработки и управления проектами. Умеет: прогнозировать проблемные ситуации и риски в проектной деятельности Владеет: методами разработки и управления проектами	Устный опрос, письменный опрос

	<p>значимость, ожидаемые результаты и возможные сферы их применения</p> <p>С-И УК-2.3. Разрабатывает план реализации проекта с учетом возможных рисков реализации и возможностей их устранения, планирует необходимые ресурсы, в том числе с учетом их заменяемости</p> <p>С-УК-2.4. Представляет результаты проекта, предлагает возможности их использования и/или совершенствования</p>		
<p>ПК- 2 Способен подготавливать аналитические и экспертно-оценочные материалы по результатам мониторинга деятельности организаций с целью выявления объектов, направлений и форм проявления повышенного риска для принятия мер по линии ПОД/ФТ</p>	<p>ПК-2.И-1Подготавливает аналитические и экспертно-оценочные материалы по результатам мониторинга деятельности организаций</p> <p>ПК-2.И-2Выявляет объекты, направления и формы проявления повышенного риска для принятия мер по линии ПОД/ФТ</p> <p>С-И УК-2.3. Разрабатывает план реализации проекта с учетом возможных рисков реализации и возможностей их устранения, планирует необходимые ресурсы, в том числе с учетом их заменяемости</p> <p>С-УК-2.4. Представляет результаты проекта, предлагает возможности их использования и/или совершенствования</p>	<p>Знает: способы подготовки аналитических и экспертно-оценочных материалов; объекты, направления и формы проявления повышенного риска в сфере экономики;</p> <p>Умеет: проводить мониторинг деятельности различных организаций осуществлять контроль и выявлять проявления повышенного риска в сфере экономики, в том числе экономические преступления</p> <p>Владеет: навыками принятия мер по линии ПОД/ФТ по результатам мониторинга деятельности различных организаций</p>	<p>Устный опрос, письменный опрос</p>

4. Объем, структура и содержание дисциплины.

4.1. Объем дисциплины составляет 3 зачетных единиц, 108 академических часов.

4.2. Структура дисциплины.

Форма обучения заочная

НАИМЕНОВАНИЕ ТЕМ	Количество часов			
	Всего	в том числе		
		Лекции	Практ. занятия	Самост. Работа

Тема 1. Задачи и процесс управления рисками		1	1	20
Тема 2. Технология управления экономическими и производственными рисками		1	1	22
Тема 3. Модели и методы управления экономическими и производственными рисками		2		22
ИТОГО:		4	2	102

4.3. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам).

Тема 1. Задачи и процесс управления рисками. Предмет управления рисками. Понятие риска и риск-менеджмента. Место курса в системе наук управления. Природа риска. Развитие взглядов на риски. Вклад Блеза Паскаля, Даниила и Якоба Бернулли, Джозефа фон Неймана, Гарри Марковица. Аспекты риска. Основные виды рисков. Стратегические, операционные (функциональные), финансовые риски и риски опасностей. Развитие взглядов на управление риском. Способы управления рисками. Страхование, резервирование, хеджирование, распределение, диверсификация, минимизация, избежание. Инструменты манипулирования рисками. Передача риска третьей стороне, самостоятельное удержание риска. Издержки и доходы управления риском. Подверженность риску. Чистый ущерб, вследствие проявления риска. Декомпозиция и агрегирование риска.

Тема 2. «Технология управления экономическими и производственными рисками».

Риски и неопределенность. Риски и стратегия. Стратегия: внешние и внутренние риски компании. Стратегические риски компании. Риски среды. Этапы жизни и динамика рисков компании. Новые, псевдоновые и специфические риски. Мониторинг рисков. Многомерное управление компанией. Многомерность рискового пространства. Развитие компании и управление рисками. Функция управления риском. Формат идентификации рисков компании. Рисковый спектр и профиль. Методы диагностики рисков компании. Картографирование рисков фирмы.

Тема 3. «Модели и методы управления экономическими и производственными рисками».

Стратегические риски (Strategic). Макроэкономические и политические риски, риски непрерывности деятельности, риски ошибок корпоративного управления. Риски, связанные с человеческим фактором.

Юридические риски. Риски изменения законодательства и системы налогообложения. Методы интеграции. Совокупное покрытие рисков. Альянсы и неопределенности. Снижение подверженности рискам. Риски отношений в альянсах. Риски усиления конкуренции в условиях спада: продукция и услуги, коммуникации, сбыт, ценообразование, кадры.

Системы интегрированного управления рисками фирмы.

Концепция и опыт интеграции риск-менеджмента. Программа управления рисками: диагностика рисков, комплексный анализ рисков и их количественная оценка, организационная и финансовая стратегия управления рисками. Получение конкурентных преимуществ, рост и развитие, операционная эффективность.

Разработка ситуационных планов. Диверсификация и портфельная теория.

Организационная структура службы управления рисками. Мониторинг программы и симптомы раннего оповещения.

Психологические аспекты управления рисками. Поведение людей и управление рисками. Особенности психологической реакции на риск. Правила обращения с рисками.

Риски регрессивного и прогрессивного состояния систем управления. Основные понятия теории стоимости управления. Риски конфликтов. Риски потери качества капитала и ресурса влияния. Риски снижения рентабельности управления. Риски нелояльности и оппортунизма. Риски хищения клиентского портфеля. Риски потери инициативы и интереса к работе. Риски саботажа. Риски некомпетентности и непрофессионализма. Риски работы на сторону.

Темы практических или семинарских занятий.

Тема 1. Задачи и процесс управления рисками.

1. Этимология категории «риск» .
2. Предпосылки и факторы возникновения рискованных ситуаций.
3. Основные аспекты и тенденции риск-менеджмента .
4. Основные подходы к классификации рисков.
5. Сущность и критерии управления экономических и производственных рисков.
6. Факторы, влияющие на управление экономических и производственных рисков.
7. Основные компоненты внешней среды организации, их влияние на управление экономических и производственных рисков.
8. Сущность математических методов при оценке экономических и производственных рисков.
9. Методика обеспечения сопоставимости альтернативных решений по управлению экономических и производственных рисков.
10. Методы анализа и расчета экономических рисков.

Литература: 1,3,5,6,9

Тема 2. «Технология управления экономическими и производственными рисками».

1. Проблема. Классификация рисков. Идентификация элементов неопределенности.
2. Классификация рисков Этапы диагностики. Описание проблемы. Анализ проблем.
3. Методология по разработке стратегий.
4. Многомерность рискованного пространства. Понятие пересекающихся иерархий данных.
5. Многомерное развитие компании и концепция многомерного управления рисками.
6. Функции управления риском.
7. Анализ рисков компании. Рисковые спектр и профиль.
8. Методы диагностики рисков компании.
9. Картографирование рисков фирмы.

Литература: 1,2,5,7,8

Тема 3. «Модели и методы управления экономическими и производственными рисками».

1. Макроэкономические и политические риски компании.
2. Риски изменения законодательства и системы налогообложения.
3. Методы интеграции и совокупное покрытие рисков.
4. Риски усиления конкуренции в условиях спада.
1. Концепция и опыт интегрированного управления рисками фирмы.
2. Программа управления рисками и ее компоненты.
3. Разработка ситуационных планов.
4. Психологические аспекты управления рисками.
1. Основные понятия теории стоимости управления.
2. Риски потери качества капитала и ресурса влияния.
3. Риски снижения рентабельности управления.

4. Риски, связанные с человеческим фактором.

Литература: 1,4,6,7,

5. Образовательные технологии

С целью формирования и развития профессиональных навыков, обучающихся в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки, предусматривается широкое использование в учебном процессе активных и интерактивных форм проведения занятий:

- во время лекционных занятий используется презентация с применением слайдов с графическим и табличным материалом, что повышает наглядность и информативность используемого теоретического материала;
- практические занятия предусматривают использование групповой формы обучения, которая позволяет студентам эффективно взаимодействовать в микрогруппах при обсуждении теоретического материала;
- использование кейс-метода (проблемно-ориентированного подхода), то есть анализ и обсуждение в микрогруппах конкретной деловой ситуации из практического опыта товароведной деятельности отечественных и зарубежных компаний;
- использование тестов для контроля знаний во время текущих аттестаций и промежуточной аттестации;
- подготовка рефератов и докладов по самостоятельной работе студентов и выступление с докладом перед аудиторией, что способствует формированию навыков устного выступления по изучаемой теме и активизирует познавательную активность студентов.

Предусмотрены также встречи с представителями предпринимательских структур, государственных и общественных организаций, мастер-классы специалистов.

Использование технологий, развивающих навыки командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерские качества (чтение интерактивных лекций, проведение групповых дискуссий и проектов, анализ деловых ситуаций на основе кейс-метода и имитационных моделей, проведение ролевых игр, тренингов и других технологий), преподавание дисциплин в форме авторских курсов по программам, составленным на основе результатов исследований научных школ вуза, учитывающих региональную и профессиональную специфику при условии реализации содержания образования и формировании компетенций выпускника, определяемых настоящим ФГОС.

Вузовская лекция должна выполнять не только информационную функцию, но также и мотивационную, воспитательную и обучающую.

Информационная функция лекции предполагает передачу необходимой информации по теме, которая должна стать основой для дальнейшей самостоятельной работы студента.

Мотивационная функция должна заключаться в стимулировании интереса студентов к науке. На лекции необходимо заинтересовывать, озадачить студентов с целью выработки у них желания дальнейшего изучения той или иной экономической проблемы.

Воспитательная функция ориентирована на формирование у молодого поколения чувства ответственности, закладку нравственных, эстетических норм поведения в обществе и коллективе, формирование патриотических взглядов, мотивов социального поведения и действий, финансово-экономического мировоззрения.

6. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов.

В период самостоятельной работы по освоению данной дисциплины студенты по каждой теме учебно-тематического плана должны:

- изучать тексты учебников и учебных пособий;
- строить структурно-логические схемы изученного учебного материала;
- работать со словарями и справочниками;

- изучать учебные пособия из электронных библиотек;
- работать с конспектами лекций;
- составление плана изученного учебного материала;
- готовить доклады и сообщения к семинарскому или практическому занятию;
- выполнять знаково-символические модели изучаемых явлений и готовить пояснения к ним;
- готовить материалы к «интеллектуальным разминкам» и «мозговым штурмам».

Целью подготовки реферата является приобретение навыков творческого обобщения и анализа имеющейся литературы по рассматриваемым вопросам, что обычно является первым этапом самостоятельной работы. По каждому модулю предусмотрены написание и защита одного реферата. Всего по дисциплине студент может представить шесть рефератов. Тему реферата студент выбирает самостоятельно из предложенной тематики. При написании реферата надо составить краткий план, с указанием основных вопросов избранной темы.

Реферат должен включать введение, несколько вопросов, посвященных рассмотрению темы, заключение и список использованной литературы. В вводной части реферата следует указать основания, послужившие причиной выбора данной темы, отметить актуальность рассматриваемых в реферате вопросов. В основном разделе излагаются наиболее существенные сведения по теме, производится их анализ, отмечаются отдельные недостатки или нерешенные еще вопросы, вносятся и обосновываются предложения по повышению качества потребительских товаров, расширению ассортимента, совершенствованию контроля за качеством и т.д. В заключении реферата на основании изучения литературных источников должны быть сформулированы краткие выводы и предложения. Список литературы оформляется в соответствии с требованиями ГОСТ 7.1-84 «Библиографическое описание документа». Перечень литературы составляется в алфавитном порядке фамилий первых авторов, со сквозной нумерацией. Примерный объем реферата 15-20 страниц.

Предусмотрено проведение индивидуальной работы (консультаций) со студентами в ходе изучения материала данной дисциплины.

7. Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины.

7.1. Примерный перечень тестовых заданий для текущего, промежуточного и итогового контроля:

Задание 1. Источником какого из перечисленных видов риска является увеличение налоговых ставок:

- а) финансового;
- б) политического;
- в) инновационного

Задание 2. Какой классификационный признак избран для деления предпринимательского риска на производственный, финансовый, коммерческий и инновационный риск:

- а) сфера и отраслевая принадлежность хозяйственной деятельности;
- б) сфера проявления;
- в) в зависимости от причины возникновения?

Задание 3. Какой из перечисленных ниже классификационных признаков лежит в основе деления рисков на материальный, финансовый, информационный:

- а) по типу хозяйственного процесса;
- б) по месту в системе;
- в) по типу логистического потока?

Задание 4. Количество вариантов хозяйственных ситуаций риска в морфологической таблице рисков коммерческого предприятия определяется произведением числа переменных по всем включенным в анализ признакам: по логистике, по типу процесса, по месту в системе и по субъективному фактору. Сколько вариантов хозяйственных ситуаций риска содержит морфологическая таблица:

- а) 27,
- б) 54,
- в) 9.

Задание 5. Какие риски принято разделять на «каска» и «карго»:

- а) экономические;
- б) транспортные;
- в) специальные

Задание 6. Для нахождения оптимальной альтернативы решения принимаемого в рамках ряда известных ограничений может быть использована:

- а. балансовая модель;
- б. модель линейного программирования;
- в. модель экстраполяции;
- г. корреляционная модель;
- д. сетевая графическая модель.

Задание 7. Письменная характеристика, выданная руководителем на своего подчиненного может быть отнесена:

- а. к изобразительным моделям;
- б. к описательным моделям;
- в. к аналоговым моделям;
- г. к функционирующим моделям.

Тематика рефератов:

1. Этимология категории «риск»
2. Предпосылки и факторы возникновения рисков ситуаций
3. Основные аспекты и тенденции риск-менеджмента
4. Информационное обеспечение риск-менеджмента
5. Основные подходы к классификации рисков
6. Качественный анализ риска
7. Количественные методы оценки риска
8. Идентификация и анализ рисков
9. Инвестиционные риски. Оценка и управление рисками инвестиционного проекта.
10. Инвестиционные риски. Формирование инвестиционного портфеля с учетом риска.
11. Этапы управления риском
12. Зарубежная практика риск-менеджмента
13. Стратегия и тактика риск-менеджмента
14. Оценка риска с применением экспертных методов
15. Неопределенность и риск инвестиционных проектов
16. Отраслевые особенности управления риском
17. Методы реагирования на риск
18. Экологические риски и основные подходы к управлению ими
19. Страхование как инструмент управления рисками

20. Статистические методы оценки рисков: достоинства и недостатки
21. Методы имитационного моделирования в оценке рисков ситуации
22. Риски развития. Лидерство в снижении издержек и дифференциация. Поиск наиболее эффективного пути развития.
23. Стратегические риски. Стратегическая безопасность. Проблемы и перспективы глобализации
24. Картографирование рисков и построение рискового профиля предприятия
25. Оценка эффективности управления предпринимательским риском
26. Диагностика финансового кризиса предприятия. Анализ рисков при угрозе банкротства
27. Принятие решений в условиях неопределенности и риска
28. Организация системы риск-менеджмента на предприятии
29. Методы управления финансовыми рисками. Исследование факторов, влияющих на уровень финансовых рисков организации. Выбор механизмов нейтрализации финансовых рисков.
30. Методы управления финансовыми рисками. Исследование факторов, влияющих на уровень финансовых рисков организации.

Текущий контроль успеваемости в форме опросов, рефератов, дискуссий, тестов, решения задач и промежуточный контроль в форме зачета.

Перечень контрольных вопросов для студентов для подготовки к зачету.

1. Понятие риска и его природа. Развитие взглядов на риски.
2. Аспекты риска.
3. Основные виды рисков и их характеристика.
4. Развитие взглядов на управление риском.
5. Способы управления рисками и их содержание.
6. Инструменты манипулирования рисками.
7. Издержки и доходы управления риском.
8. Базовые понятия финансовой математики в управлении рисками.
9. Количественные и качественные методы оценки рисков.
10. Стохастический подход и методы оценки рисков.
11. Теоретико-игровые модели в оценке рисков.
12. Элементы регрессионного анализа и статистического моделирования в прогнозировании и в оценке рисков.
13. Риски и неопределенность. Стратегия и риски компании.
14. Риски внешней и внутренней среды организации.
15. Этапы жизненного цикла и динамика рисков компании.
16. Многомерность управления компанией.
17. Многомерность рискового пространства.
18. Развитие компании и управление рисками.
19. Функция управления риском.
20. Диагностика рисков компании. Формат идентификации рисков.
21. Рисковые спектр и профиль.
22. Методы диагностики рисков компании.
23. Картографирование рисков фирмы.
24. Стратегические риски.
25. Макроэкономические и политические риски компании.
26. Риски изменения законодательства и системы налогообложения.
27. Методы интеграции и совокупное покрытие рисков.

28. Альянсы и неопределенности. Риски отношений в альянсах.
29. Риски усиления конкуренции в условиях спада.
30. Основные операционные риски финансовых организаций.
31. Основные операционные риски промышленных компаний.
32. Технологические риски.
33. Риски информационных систем и технологий.
34. Портфельный подход в управлении рисками.
35. Основные виды финансовых рисков.
36. Валютный риск.
37. Кредитный риск.
38. Производные финансовые инструменты.
39. Основные стратегии применения производных финансовых инструментов.
40. Риск выбора банка.
41. Риски опасностей.
42. Экологические и природные риски.
43. Криминальные риски и риск преступлений.
44. Судебные, бухгалтерские и налоговые риски.
45. Риски применения ошибочных схем налоговой оптимизации.
46. Риски регрессивного и прогрессивного состояния систем управления.
47. Основные понятия теории стоимости управления.
48. Риски потери капитала и ресурса влияния.
49. Риски снижения рентабельности управления.
50. Риски снижения рентабельности управления.
51. Риски, связанные с человеческим фактором.
52. Риски конфликтов. Риски нелояльности и оппортунизма.
53. Риски некомпетентности и непрофессионализма. Риски саботажа.
54. Концепция интегрированного управления рисками фирмы.
55. Программа управления рисками и ее компоненты.
56. Мониторинг программы управления рисками.
57. Разработка ситуационных планов.
58. Организационная структура службы управления рисками.
59. Психологические аспекты управления рисками.

7.2. Методические материалы, определяющие процедуру оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций.

Оценка за модуль определяется как сумма баллов за текущую и контрольную работу.

Коэффициент весомости баллов, набранных за текущую и контрольную работу, составляет 0,5/0,5.

Текущая работа включает оценку аудиторной и самостоятельной работы.

Оценка знаний студента на практическом занятии (аудиторная работа) производится по 100-балльной шкале.

Оценка самостоятельной работы студента (написание эссе, подготовка доклада, выполнение домашней контрольной работы и др.) также осуществляется по 100-балльной шкале.

Для определения среднего балла за текущую работу суммируются баллы, полученные за аудиторную и самостоятельную работу, полученная сумма делится на количество полученных оценок.

Итоговый балл за текущую работу определяется как произведение среднего балла за текущую работу и коэффициента весомости.

Если студент пропустил занятие без уважительной причины, то это занятие оценивается в 0 баллов и учитывается при подсчете среднего балла за текущую работу.

Если студент пропустил занятие по уважительной причине, подтвержденной документально, то преподаватель может принять у него отработку и поставить определенное количество баллов за занятие. Если преподаватель по тем или иным причинам не принимает отработку, то это занятие при делении суммарного балла не учитывается.

Контрольная работа за модуль также оценивается по 100-балльной шкале. Итоговый балл за контрольную работу определяется как произведение баллов за контрольную работу и коэффициента весомости.

Критерии оценок аудиторной работы студентов по 100-балльной шкале:

«0 баллов» - студент не смог ответить ни на один из поставленных вопросов

«10-50 баллов» - обнаружено незнание большей части изучаемого материала, есть слабые знания по некоторым аспектам рассматриваемых вопросов

«51-65 баллов» - неполно раскрыто содержание материала, студент дает ответы на некоторые рассматриваемые вопросы, показывает общее понимание, но допускает ошибки

«66-85 баллов» - студент дает почти полные ответы на поставленные вопросы с небольшими проблемами в изложении. Делает самостоятельные выводы, имеет собственные суждения.

«86-90 баллов» - студент полно раскрыл содержание материала, на все поставленные вопросы готов дать абсолютно полные ответы, дополненные собственными суждениями, выводами. Студент подготовил и отвечает дополнительный материал по рассматриваемым вопросам.

1. Таблица перевода рейтингового балла в «5»-балльную шкалу

Итоговая сумма баллов по дисциплине по 100-балльной шкале	Оценка по 5-балльной шкале
0-50	незачтено
51-100	зачтено

Критерии оценки курсовой и реферата.

Изложенное понимание реферата как целостного авторского текста определяет критерии его оценки: новизна текста; обоснованность выбора источника; степень раскрытия сущности вопроса; соблюдения требований к оформлению.

Новизна текста: а) актуальность темы исследования; б) новизна и самостоятельность в постановке проблемы, формулирование нового аспекта известной проблемы в установлении новых связей (межпредметных, внутрипредметных, интеграционных); в) умение работать с исследованиями, критической литературой, систематизировать и структурировать материал; г) явленность авторской позиции, самостоятельность оценок и суждений; д) стилевое единство текста, единство жанровых черт.

Степень раскрытия сущности вопроса: а) соответствие плана теме реферата; б) соответствие содержания теме и плану реферата; в) полнота и глубина знаний по теме; г)

обоснованность способов и методов работы с материалом; е) умение обобщать, делать выводы, сопоставлять различные точки зрения по одному вопросу (проблеме).

Обоснованность выбора источников: а) оценка использованной литературы: привлечены ли наиболее известные работы по теме исследования (в т.ч. журнальные публикации последних лет, последние статистические данные, сводки, справки и т.д.).

Соблюдение требований к оформлению: а) насколько верно оформлены ссылки на используемую литературу, список литературы; б) оценка грамотности и культуры изложения (в т.ч. орфографической, пунктуационной, стилистической культуры), владение терминологией; в) соблюдение требований к объёму реферата.

Рецензент должен чётко сформулировать замечание и вопросы, желательно со ссылками на работу (можно на конкретные страницы работы), на исследования и фактические данные, которые не учёл автор.

Рецензент может также указать: обращался ли учащийся к теме ранее (рефераты, письменные работы, творческие работы, олимпиадные работы и пр.) и есть ли какие-либо предварительные результаты; как выпускник вёл работу (план, промежуточные этапы, консультация, доработка и переработка написанного или отсутствие чёткого плана, отказ от рекомендаций руководителя).

В конце рецензии руководитель и консультант, учитывая сказанное, определяют оценку. Рецензент сообщает замечание и вопросы учащемуся за несколько дней до защиты.

Учащийся представляет реферат на рецензию не позднее чем за неделю до экзамена. Рецензентом является научный руководитель. Опыт показывает, что целесообразно ознакомить ученика с рецензией за несколько дней до защиты. Оппонентов назначает председатель аттестационной комиссии по предложению научного руководителя. Аттестационная комиссия на экзамене знакомится с рецензией на представленную работу и выставляет оценку после защиты реферата. Для устного выступления ученику достаточно 10-20 минут (примерно столько времени отвечает по билетам на экзамене).

Оценка 86-100 ставится, если выполнены все требования к написанию и защите реферата: обозначена проблема и обоснована её актуальность, сделан краткий анализ различных точек зрения на рассматриваемую проблему и логично изложена собственная позиция, сформулированы выводы, тема раскрыта полностью, выдержан объём, соблюдены требования к внешнему оформлению, даны правильные ответы на дополнительные вопросы.

Оценка 66-85 – основные требования к реферату и его защите выполнены, но при этом допущены недочёты. В частности, имеются неточности в изложении материала; отсутствует логическая последовательность в суждениях; не выдержан объём реферата; имеются упущения в оформлении; на дополнительные вопросы при защите даны неполные ответы.

Оценка 51-65 – имеются существенные отступления от требований к реферированию. В частности: тема освещена лишь частично; допущены фактические ошибки в содержании реферата или при ответе на дополнительные вопросы; во время защиты отсутствует вывод.

Оценка 1-50 – тема реферата не раскрыта, обнаруживается существенное непонимание проблемы.

Оценка 0 – реферат выпускником не представлен.

Критерии оценки самостоятельной работы студентов (заданий, выступлений, кейсов)

Оценка 86-100 ставится тогда, когда: • Студент свободно применяет знания на практике; • Не допускает ошибок в воспроизведении изученного материала; • Студент выделяет главные положения в изученном материале и не затрудняется в ответах на видоизмененные вопросы; • Студент усваивает весь объем программного материала; • Материал оформлен аккуратно в соответствии с требованиями;

Оценка 66-85 ставится тогда когда: • Студент знает весь изученный материал; • Отвечает без особых затруднений на вопросы преподавателя; • Студент умеет применять полученные знания на практике; • В условных ответах не допускает серьезных ошибок, легко устраняет определенные неточности с помощью дополнительных вопросов преподавателя; • Материал оформлен недостаточно аккуратно и в соответствии с требованиями; 19 Оценка

Оценка 51-65 ставится тогда когда: • Студент обнаруживает освоение основного материала, но испытывает затруднения при его самостоятельном воспроизведении и требует дополнительных дополняющих вопросов преподавателя; • Предпочитает отвечать на вопросы воспроизводящего характера и испытывает затруднения при ответах на воспроизводящие вопросы; • Материал оформлен не аккуратно или не в соответствии с требованиями;

Оценка 1-50 ставится тогда когда: • У студента имеются отдельные представления об изучаемом материале, но все, же большая часть не усвоена; • Материал оформлен не в соответствии с требованиями.

8.Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины.

а) адрес сайта курса:

1.Moodle [Электронный ресурс]: система виртуального обучения: [база данных] / ДГУ – гМахачкала. – доступ из сети ДГУ или, после регистрации из сети университета, из любой точки, имеющей доступ в интернет. – URL: <http://moodle.dgu.ru/>

основная литература:

1. Балдин К.В., Воробьев С.Н. Управление рисками. Учебное пособие. – М.: ЮНИТИ, 2005. – 511 с.
2. Шапкин, Александр Сергеевич. Экономические и финансовые риски: Оценка, управление, портфель инвестиций / Шапкин, Александр Сергеевич, В. А. Шапкин. - 7-е изд. - М. : Дашков и К, 2017, 2016, 2008, 2007, 2006, 2004. - 543 с. - ISBN 978-5-394-00062-1242-00.
- 3.Новиков,А.И.Теория принятия решений и управление рисками в финансовой и налоговой сферах : Учебное пособие для бакалавров / А. И. Новиков ; А. И. Новиков, Т. И. Солодка. - М. : Дашков и Ко, 2013. - 285. - (Учебные издания для бакалавров). - ISBN 978-5-394-01380-5.
4. Фомичев, Андрей Николаевич. Риск-менеджмент : учеб. пособие / Фомичев, Андрей

Николаевич. - 2-е изд. - М. : Дашков и К, 2006. - 291 с

5. Фомичев, Андрей Николаевич.

Риск-менеджмент : учеб. пособие / Фомичев, Андрей Николаевич. - 2-е изд. - М. : Дашков и К, 2006. - 291 с
6. Косолапов, А.Б. Управление рисками в туристском бизнесе: Учебное пособие / А.Б. Косолапов. - М.: КноРус, 2012. - 286 с.

6. Воробьев, Сергей Николаевич.

Управление рисками в предпринимательстве / Воробьев, Сергей Николаевич, К. В. Балдин. - 2-е изд. - М. : Дашков и К, 2007. - 770 с.
22. Мамаева, Л.Н. Управление рисками: Учебное пособие / Л.Н. Мамаева. - М.: Дашков и К, 2013. - 256 с.

7. Милославская, Н.Г. Управление рисками информационной безопасности: Учебное пособие для вузов / Н.Г. Милославская, М.Ю. Сенаторов, А.И. Толстой. - М.: РиС, 2014. - 130 с.

8. Новиков, А.И. Теория принятия решений и управление рисками в финансовой и налоговой сферах: Учебное пособие / А.И. Новиков, Т.И. Солодкая. - М.: Дашков и К, 2012. - 288 с.

9. Новиков, А.И. Теория принятия решений и управление рисками в финансовой и налоговой сферах: Учебное пособие / А.И. Новиков, Т.И. Солодкая. - М.: Дашков и К, 2013. - 288 с.

10 Новиков, А.И. Теория принятия решений и управление рисками в финансовой и налоговой сферах: Учебное пособие для бакалавров / А.И. Новиков, Т.И. Солодкая. - М.: Дашков и К, 2013. - 288 с.

11. Новиков, А.И. Теория принятия решений и управление рисками в финансовой и налоговой сферах: Учебное пособие для бакалавров / А.И. Новиков, Т.И. Солодкая. - М.: Дашков и К, 2015. - 288 с.

б) дополнительная литература.

12. Рубина И.Н. Основы управления рисками: учебное пособие / И.Н. Дубина, Г.К. Кишибекова. — Электрон. текстовые данные. — Саратов: Вузовское образование, 2018. — 266 с. — 978-5-4487-0271-6. IPR books

13. Пасько Е.А. Страхование и управление рисками [Электронный ресурс] : практикум / Е.А. Пасько. — Электрон. текстовые данные. — Ставрополь: Северо-Кавказский федеральный университет , 2017. — 106 с. — 2227-8397. IPR books

14. Афонин П.Н. Система управления рисками [Электронный ресурс] : учебное пособие / П.Н. Афонин. — Электрон. текстовые данные. — СПб. : Троицкий мост, 2016. — 125 с. — 978-5-4377-0067-9.

15. Поздеева С.Н. Основы управления рисками [Электронный ресурс] : практикум / С.Н. Поздеева. — Электрон. текстовые данные. — М. : Российская таможенная академия, 2016. — 68 с. — 978-5-9590-0927-4. IPR books

16. Саркисова, Е.А. Риски в торговле. Управление рисками: Практическое пособие / Е.А. Саркисова. - М.: Дашков и К, 2016. - 242 с.

17. Сигел, Д. Фьючерсные рынки: Портфельные стратегии, управление рисками и арбитраж / Д. Сигел. - М.: Альпина Паблишер, 2015. - 627 с.

18. Стреbel, П. Грамотные ходы Как умные стратегия, психология и управление рисками обеспечивают успех бизнеса / П. Стреbel. - М.: Олимп-Бизнес, 2013. - 208 с.

19. Стреbel, П. Грамотные ходы. Как умные стратегия, психология и управление рисками обеспечивают успех бизнеса / П. Стреbel, Э. Олссон; Пер. с англ. А. Столяров. - М.:

9. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины.

1. eLIBRARY.RU [Электронный ресурс]: электронная библиотека/Науч.электрон.б-ка.— Москва, 1999.—Режим доступа: <http://elibrary.ru/defaultx.asp> (дата обращения: 01.04.2020).— Яз. рус., англ.
2. Moodle [Электронный ресурс]: система виртуального обучения: [база данных]/Даг. гос. ун-т.— Махачкала, г.— Доступ из сети ДГУ или, после регистрации из сети ун-та, из любой точки, имеющей доступ в интернет.— URL: <http://moodle.dgu.ru/> (дата обращения: 22.03.2018).
3. Электронный каталог НБДГУ [Электронный ресурс]: база данных содержит сведения о всех видах лит. п. оступающих в фонд НБДГУ/Дагестанский гос. ун-т.— Махачкала, 2010— Режим доступа: <http://elib.dgu.ru>, свободный (дата обращения: 21.03.2018).
4. Мировая цифровая библиотека / <http://wdl.org/ru/>
5. Публичная Электронная Библиотека / <http://lib.walla.ru/>
6. Российское образование. Федеральный портал. / <http://www.edu.ru/>
7. Русский гуманитарный интернет-университет / <http://www.i-u.ru/biblio/links.aspx?id=6>
8. Университетская библиотека / <http://www.biblioclub.ru/>
9. Электронная библиотека Российской государственной библиотеки / <http://www.rsl.ru/ru/s2/s101/>
10. Электронная библиотека учебников / <http://studentam.net/>
11. Электронная библиотека IQlib / <http://www.iqlib.ru/>
12. Lib.Ru: Библиотека Максима Мошкова / <http://lib.ru/>
13. Официальный сайт Президента Российской Федерации // www.kremlin.ru
14. Официальный сайт Министерства иностранных дел Российской Федерации // www.mid.ru
15. Официальный сайт Министерства экономического развития Российской Федерации // www.economy.gov.ru

10. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины.

Основной целью лекционных занятий является изложение теоретических проблем дисциплины «Современные проблемы менеджмента». Лекционные занятия проводятся в следующей форме: преподаватель в устной форме излагает тему, а студенты записывают ее основные положения. Помимо теоретических положений, преподаватель приводит практические примеры и статистический материал, которые позволяют лучше понять теоретическую сущность излагаемой проблемы. Лекционный материал по дисциплине «Современные проблемы менеджмента» включает 6 тем, программа изучения которых приведена в Рабочей программе по дисциплине.

Для закрепления теоретических знаний по изучаемым проблемам на лекциях проводятся семинарские занятия. Тематика семинарских занятий приведена в тематическом плане Рабочей программы, там же указано количество часов по темам. На семинарских занятиях студенты выполняют следующие задания: тесты; решение задач; решение проблемных ситуаций и т.д. Для этого необходимо изучение литературных источников, законодательных актов, список которых приведен в Рабочей программе по дисциплине.

Для подготовки к лекционным занятиям студенты могут предварительно ознакомиться с материалами каждой из 6 тем, представленными в электронной образовательной среде Moodle. После лекции при подготовке к практическому занятию студенты должны углубленно изучить основные вопросы темы, используя для этого презентации, мультимедийный интерактивный учебник, материалы для чтения и другие рекомендованные источники. Для самостоятельной оценки качества освоения темы студенты выполняют тесты, размещенные в каждом блоке электронного курса.

Подготовка к экзамену предполагает изучение конспектов лекций, рекомендуемой литературы и других источников, повторение материалов практических занятий

11. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении

образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем.

Для проведения индивидуальных консультаций может использоваться электронная почта. Разработан учебный курс на электронной платформе Moodle.

12. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине.

На факультете управления Дагестанского государственного университета имеются аудитории, оборудованные интерактивными, мультимедийными досками, проекторами, что позволяет читать лекции в формате презентаций, разработанных с помощью пакета прикладных программ MS PowerPoint, Microsoft Office. Использовать наглядные, иллюстрированные материалы, обширную информацию в табличной и графической формах, видеолекции, а также электронные ресурсы сети Интернет.