

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего
образования «Вятский государственный университет»
(ВятГУ)
г. Киров

Утверждаю
Директор/Декан Соболева О. Н.



Номер регистрации
РПД_3-38.03.02.02_2018_93573
Актуализировано: 12.04.2021

Рабочая программа дисциплины
Управление финансовыми рисками в проектной деятельности

	наименование дисциплины
Квалификация выпускника	Бакалавр пр.
Направление подготовки	38.03.02
	шифр
	Менеджмент МиС
	наименование
Направленность (профиль)	3-38.03.02.02
	шифр
	Управление проектами
	наименование
Формы обучения	Заочная, Очная
	наименование
Кафедра-разработчик	Кафедра финансов и экономической безопасности (ОРУ)
	наименование
Выпускающая кафедра	Кафедра менеджмента и маркетинга (ОРУ)
	наименование

Киров, 2018 г.

Сведения о разработчиках рабочей программы дисциплины

Давыдова Юлия Владимировна

ФИО

Цели и задачи дисциплины

Цель дисциплины	Целью изучения дисциплины является формирование у студентов комплекса знаний в области управления финансовыми рисками в проектной деятельности, а также формирование практических навыков и умений по идентификации и оценке рисков, выбору методов управления рисками.
Задачи дисциплины	<ul style="list-style-type: none"> - изучение основных понятий риск-менеджмента и способов классификации финансовых рисков; - изучение системы и этапов процесса управления риском; - изучение основных методов управления рисками: методов идентификации риска, методов оценки риска; методов трансформации риска, методов финансирования риска, методов оценки эффективности управления риском; - приобретение знаний по управлению основными видами финансовых рисков (риски ликвидности, кредитные риски, операционные риски).

Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Компетенция ПК-4

умением применять основные методы финансового менеджмента для оценки активов, управления оборотным капиталом, принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала, в том числе, при принятии решений, связанных с операциями на мировых рынках в условиях глобализации		
Знает	Умеет	Владеет
понятие и содержание основных категорий управления рисками в инвестиционных проектах; законодательные и нормативные акты, регулирующие данную сферу; отечественный и зарубежный опыт управления рисками в инвестиционных проектах	применять основные методы финансового менеджмента для управления рисками в инвестиционных проектах	навыками анализа и обоснования способов управления рисками, методами оценки и управления рисками инвестиционных проектов

Компетенция ПК-6

способностью участвовать в управлении проектом, программой внедрения технологических и продуктовых инноваций или программой организационных изменений		
Знает	Умеет	Владеет
теоретические основы разработки и управления проектами, подходы к маркетинговому сопровождению проектов и	применять теоретические основы разработки и управления проектами на практике, вести маркетинговое	теоретическими знаниями разработки и управления проектами, навыками маркетингового сопровождения проектов и

<p>программ в цифровой экономике; этапы жизненного цикла проекта, основы стратегического анализа и управления портфелем проектов и программ; технологию управления качеством проекта при внедрении технологических и продуктовых инноваций при организационных изменениях</p>	<p>сопровождение проектов и программ в цифровой экономике; выделять этапы жизненного цикла проекта, применять основы стратегического анализа и управления портфелем проектов и программ; применять технологию управления качеством проекта при внедрении технологических и продуктовых инноваций при организационных изменениях</p>	<p>программ в цифровой экономике; навыками выявления этапов жизненного цикла проекта, навыками стратегического анализа и управления портфелем проектов и программ; технологией управления качеством проекта при внедрении технологических и продуктовых инноваций при организационных изменениях</p>
---	---	--

Структура дисциплины
Тематический план

№ п/п	Наименование разделов дисциплины	Шифр формируемых компетенций
1	Понятие и классификация рисков	ПК-6
2	Система управления рисками	ПК-6
3	Анализ и оценка финансовых рисков	ПК-4
4	Управление отдельными видами финансовых рисков	ПК-4
5	Подготовка и прохождение промежуточной аттестации	ПК-4, ПК-6

Формы промежуточной аттестации

Зачет	Не предусмотрен (Очная форма обучения) Не предусмотрен (Заочная форма обучения)
Экзамен	5 семестр (Очная форма обучения) 5 семестр (Заочная форма обучения)
Курсовая работа	Не предусмотрена (Очная форма обучения) Не предусмотрена (Заочная форма обучения)
Курсовой проект	Не предусмотрена (Очная форма обучения) Не предусмотрена (Заочная форма обучения)

Трудоемкость дисциплины

Форма обучения	Курсы	Семестры	Общий объем (трудоемкость)		Контактная работа, час	в том числе аудиторная контактная работа обучающихся с преподавателем, час				Самостоятельная работа, час	Курсовая работа (проект), семестр	Зачет, семестр	Экзамен, семестр
			Часов	ЗЕТ		Всего	Лекции	Семинарские, практические занятия	Лабораторные занятия				
Очная форма обучения	3	5	180	5	98	54	18	36	0	82			5
Заочная форма обучения	2, 3	4, 5	180	5	18.5	16	8	8	0	161.5			5

Содержание дисциплины

Очная форма обучения

Код занятия	Наименование тем занятий	Трудоемкость, академических часов
Раздел 1 «Понятие и классификация рисков»		27.50
Лекции		
Л1.1	Понятие и функции риск	2.00
Л1.2	Классификация финансовых рисков	2.00
Семинары, практические занятия		
П1.1	Понятие и структура риска	2.00
П1.2	Критерии классификации рисков	2.00
Самостоятельная работа		
С1.1	Подготовка к лекционным занятиям	5.00
С1.2	Подготовка к практическим занятиям	5.00
Контактная внеаудиторная работа		
КВР1.1	контактная внеаудиторная работа	9.50
Раздел 2 «Система управления рисками»		30.00
Лекции		
Л2.1	Понятие и этапы управления рисками	2.00
Л2.2	Методы управления рисками	2.00
Семинары, практические занятия		
П2.1	Управление рисками на различных стадиях жизненного цикла проекта	4.00
П2.2	Выбор метода управления рисками	4.00
Самостоятельная работа		
С2.1	Подготовка к лекционным занятиям	4.00
С2.2	Подготовка к практическим занятиям	4.00
Контактная внеаудиторная работа		
КВР2.1	контактная внеаудиторная работа	10.00
Раздел 3 «Анализ и оценка финансовых рисков»		40.50
Лекции		
Л3.1	Методы идентификации рисков	2.00
Л3.2	Качественная оценка рисков	2.00
Л3.3	Количественная оценка риска	2.00
Семинары, практические занятия		
П3.1	Качественные методы оценки финансовых рисков, построение карты рисков	4.00
П3.2	Количественные методы оценки рисков	4.00
Самостоятельная работа		
С3.1	Подготовка к лекционным занятиям	7.00
С3.2	Подготовка к практическим занятиям	7.50
Контактная внеаудиторная работа		
КВР3.1	контактная внеаудиторная работа	12.00
Раздел 4 «Управление отдельными видами финансовых рисков»		55.00
Лекции		

Л4.1	Управление процентным риском банка	1.00
Л4.2	Классификация и оценка кредитных рисков	1.00
Л4.3	Цели и процесс управления операционными рисками	1.00
Л4.4	Оценка риска балансовой ликвидности банка	1.00
Семинары, практические занятия		
П4.1	GAP-анализ процентного риска	2.00
П4.2	Анализ процентного риска методом дюрации	2.00
П4.3	Оценка операционного кредитного риска	2.00
П4.4	Оценка портфельного кредитного риска	2.00
П4.5	Методы расчета капитала банка для покрытия операционных рисков	2.00
П4.6	Идентификация и оценка операционных рисков	2.00
П4.7	GAP-анализ риска ликвидности	2.00
П4.8	Стресс-тестирование риска ликвидности	2.00
Самостоятельная работа		
С4.1	Подготовка к лекционным занятиям	12.00
С4.2	Подготовка к практическим занятиям	13.00
Контактная внеаудиторная работа		
КВР4.1	Контактная внеаудиторная работа	10.00
Раздел 5 «Подготовка и прохождение промежуточной аттестации»		27.00
Э5.1	Подготовка к сдаче экзамена	24.50
КВР5.1	Консультация перед экзаменом	2.00
КВР5.2	Сдача экзамена	0.50
ИТОГО		180.00

Заочная форма обучения

Код занятия	Наименование тем занятий	Трудоемкость, академических часов
Раздел 1 «Понятие и классификация рисков»		32.00
Лекции		
Л1.1	Понятие и функции риск	0.50
Л1.2	Классификация финансовых рисков	0.50
Семинары, практические занятия		
П1.1	Понятие и структура риска	0.50
П1.2	Критерии классификации рисков	0.50
Самостоятельная работа		
С1.1	Подготовка к лекционным занятиям	15.00
С1.2	Подготовка к практическим занятиям	15.00
Контактная внеаудиторная работа		
КВР1.1	контактная внеаудиторная работа	
Раздел 2 «Система управления рисками»		18.00
Лекции		
Л2.1	Понятие и этапы управления рисками	0.50
Л2.2	Методы управления рисками	0.50
Семинары, практические занятия		

П2.1	Управление рисками на различных стадиях жизненного цикла проекта	0.50
П2.2	Выбор метода управления рисками	0.50
Самостоятельная работа		
С2.1	Подготовка к лекционным занятиям	8.00
С2.2	Подготовка к практическим занятиям	8.00
Контактная внеаудиторная работа		
КВР2.1	контактная внеаудиторная работа	
Раздел 3 «Анализ и оценка финансовых рисков»		22.00
Лекции		
Л3.1	Методы идентификации рисков	0.50
Л3.2	Качественная оценка рисков	0.50
Л3.3	Количественная оценка риска	1.00
Семинары, практические занятия		
П3.1	Качественные методы оценки финансовых рисков, построение карты рисков	1.00
П3.2	Количественные методы оценки рисков	1.00
Самостоятельная работа		
С3.1	Подготовка к лекционным занятиям	9.00
С3.2	Подготовка к практическим занятиям	9.00
Контактная внеаудиторная работа		
КВР3.1	контактная внеаудиторная работа	
Раздел 4 «Управление отдельными видами финансовых рисков»		99.00
Лекции		
Л4.1	Управление процентным риском банка	1.00
Л4.2	Классификация и оценка кредитных рисков	1.00
Л4.3	Цели и процесс управления операционными рисками	1.00
Л4.4	Оценка риска балансовой ликвидности банка	1.00
Семинары, практические занятия		
П4.1	GAP-анализ процентного риска	0.50
П4.2	Анализ процентного риска методом дюрации	0.50
П4.3	Оценка операционного кредитного риска	0.50
П4.4	Оценка портфельного кредитного риска	0.50
П4.5	Методы расчета капитала банка для покрытия операционных рисков	0.50
П4.6	Идентификация и оценка операционных рисков	0.50
П4.7	GAP-анализ риска ликвидности	0.50
П4.8	Стресс-тестирование риска ликвидности	0.50
Самостоятельная работа		
С4.1	Подготовка к лекционным занятиям	41.00
С4.2	Подготовка к практическим занятиям	50.00
Контактная внеаудиторная работа		
КВР4.1	Контактная внеаудиторная работа	
Раздел 5 «Подготовка и прохождение промежуточной аттестации»		9.00
Э5.1	Подготовка к сдаче экзамена	6.50
КВР5.1	Консультация перед экзаменом	2.00
КВР5.2	Сдача экзамена	0.50
ИТОГО		180.00

Содержание дисциплины данной рабочей программы используется при обучении по индивидуальному учебному плану, при ускоренном обучении, при применении дистанционных образовательных технологий и электронном обучении (при наличии).

Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Успешное освоение дисциплины предполагает активное, творческое участие обучающегося на всех этапах ее освоения путем планомерной, повседневной работы. Обучающийся обязан посещать лекции, семинарские, практические и лабораторные занятия (при их наличии), получать консультации преподавателя и выполнять самостоятельную работу.

Изучение дисциплины следует начинать с проработки настоящей рабочей программы, методических указаний и разработок, указанных в программе, особое внимание уделить целям, задачам, структуре и содержанию дисциплины.

Главной задачей каждой лекции является раскрытие сущности темы и анализ ее основных положений. Тематика лекций определяется настоящей рабочей программой дисциплины.

Лекции – это систематическое устное изложение учебного материала. На них обучающийся получает основной объем информации по каждой конкретной теме. Лекции обычно носят проблемный характер и нацелены на освещение наиболее трудных и дискуссионных вопросов.

Предполагается, что обучающиеся приходят на лекции, предварительно проработав соответствующий учебный материал по источникам, рекомендованным программой. Часто обучающимся трудно разобраться с дискуссионными вопросами, дать однозначный ответ. Преподаватель, сравнивая различные точки зрения, излагает свой взгляд и нацеливает их на дальнейшие исследования и поиск научных решений. После лекции желательно вечером перечитать и закрепить полученную информацию, тогда эффективность ее усвоения значительно возрастает. При работе с конспектом лекции необходимо отметить материал, который вызывает затруднения для понимания, попытаться найти ответы на затруднительные вопросы, используя предлагаемую литературу. Если самостоятельно не удалось разобраться в материале, сформулируйте вопросы и обратитесь за помощью к преподавателю.

Целью семинарских занятий является проверка уровня понимания обучающимися вопросов, рассмотренных на лекциях и в учебной литературе.

Целью практических и лабораторных занятий является формирование у обучающихся умений и навыков применения теоретических знаний в реальной практике решения задач; восполнение пробелов в пройденной теоретической части курса.

Семинарские, практические и лабораторные занятия в равной мере направлены на совершенствование индивидуальных навыков решения теоретических и прикладных задач, выработку навыков интеллектуальной работы, а также ведения дискуссий. Для успешного участия в семинарских, практических и лабораторных занятиях обучающемуся следует тщательно подготовиться.

Основной формой подготовки обучающихся к практическим (лабораторным) занятиям является самостоятельная работа с учебно-методическими материалами, научной литературой, статистическими данными и т.п.

Изучив конкретную тему, обучающийся может определить, насколько хорошо он в ней разобрался. Если какие-то моменты остались непонятными, целесообразно составить список вопросов и на занятии задать их преподавателю. Практические (лабораторные) занятия предоставляют обучающемуся возможность творчески раскрыться, проявить инициативу и развить навыки публичного ведения дискуссий и общения.

Самостоятельная работа обучающихся включает в себя выполнение различного рода заданий (изучение учебной и научной литературы, материалов лекций, систематизацию прочитанного материала, подготовку контрольной работы, решение

задач, подготовка докладов, написание рефератов, публикация тезисов, научных статей, подготовка и защита курсовой работы / проекта и другие), которые ориентированы на глубокое усвоение материала изучаемой дисциплины.

Обучающимся рекомендуется систематически отводить время для повторения пройденного материала, проверяя свои знания, умения и навыки.

Внутренняя система оценки качества освоения дисциплины включает входной контроль уровня подготовленности обучающихся, текущий контроль успеваемости, промежуточную аттестацию, направленную на оценивание промежуточных и окончательных результатов обучения по дисциплине (в том числе результатов курсового проектирования (выполнения курсовых работ) при наличии).

При проведении промежуточной аттестации обучающегося учитываются результаты текущего контроля, проводимого в течение освоения дисциплины.

Процедура оценивания результатов освоения дисциплины осуществляется на основе действующих локальных нормативных актов ФГБОУ ВО «Вятский государственный университет», с которыми обучающиеся знакомятся на официальном сайте университета www.vyatsu.ru.

Учебно-методическое обеспечение дисциплины, в том числе учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающегося по дисциплине

Учебная литература (основная)

1) Головань, С. А. Управление финансовыми (страховыми, налоговыми и иными) рисками с системе экономической безопасности : учебное пособие / С. А. Головань. - Иркутск : ИргУПС, 2019. - 96 с. - Б. ц. - URL: <https://e.lanbook.com/book/157968> (дата обращения: 15.05.2020). - Режим доступа: ЭБС Лань. - Текст : электронный.

2) Шапкин, А. С. Экономические и финансовые риски: оценка, управление, портфель инвестиций / А.С. Шапкин, В.А. Шапкин. - 9-е изд. - Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2018. - 544 с. : ил. - Библиогр.: с. 531 - 536. - ISBN 978-5-394-02150-3 : Б. ц. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=496079/> (дата обращения: 24.03.2020). - Режим доступа: ЭБС Университетская библиотека ONLINE. - Текст : электронный.

3) Родионова, Е. В. Финансовая среда и управление рисками организации : конспект лекций / Е.В. Родионова. - Йошкар-Ола : ПГТУ, 2017. - 56 с. - ISBN 978-5-8158-1851-4 : Б. ц. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=476508/> (дата обращения: 24.03.2020). - Режим доступа: ЭБС Университетская библиотека ONLINE. - Текст : электронный.

4) Каранина, Елена Валерьевна. Управление финансовыми рисками: стратегические концепции, модели, профессиональные стандарты : учеб. пособие для бакалавров, магистров и специалистов УГНС 38.00.00 "Экономика и управление" / Е. В. Каранина ; ВятГУ, ИЭМ, ФЭИФ, каф. ФЭБ. - Киров : ВятГУ, 2016. - 136 с. - Библиогр.: с. 133-136. - Б. ц. - Текст : непосредственный.

Учебная литература (дополнительная)

1) Бородавко, Л. С. Управление финансовыми рисками организации : монография / Л. С. Бородавко. - Иркутск : ИргУПС, 2018. - 160 с. - ISBN 978-5-98710-358-6 : Б. ц. - URL: <https://e.lanbook.com/book/157893> (дата обращения: 15.05.2020). - Режим доступа: ЭБС Лань. - Текст : электронный.

2) Сафонова, Т. Ю. Управление рисками на рынке производных финансовых инструментов : монография / Т.Ю. Сафонова. - Москва : Креативная экономика, 2017. - 398 с. : табл., граф., схем. - Библиогр. в кн. - ISBN 978-5-91292-185-8 : Б. ц. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=499040/> (дата обращения: 24.03.2020). - Режим доступа: ЭБС Университетская библиотека ONLINE. - Текст : электронный.

3) Киселев, А. А. Риск-менеджмент в управлении организациями: учебник для бакалавриата : учебник / А.А. Киселев. - Москва|Берлин : Директ-Медиа, 2020. - 173 с. : ил., схем. - Библиогр.: с. 157-158. - ISBN 978-5-4499-0851-3 : Б. ц. - URL:

<http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=575459/> (дата обращения: 24.03.2020). - Режим доступа: ЭБС Университетская библиотека ONLINE. - Текст : электронный.

4) Каранина, Е. В. Риск-менеджмент : учебник / Е.В. Каранина. - Москва|Берлин : Директ-Медиа, 2020. - 190 с. : табл., ил., схем. - Библиогр. в кн. - ISBN 978-5-4499-1172-8 : Б. ц. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=576201/> (дата обращения: 24.03.2020). - Режим доступа: ЭБС Университетская библиотека ONLINE. - Текст : электронный.

Учебно-методические издания

1) Бережная, Л. Ю. Риск-менеджмент : практикум для обучающихся по образовательной программе высшего образования по направлению подготовки 38.03.02 менеджмент / Л. Ю. Бережная. - Оренбург : ОГУ, 2019. - 133 с. - ISBN 978-5-7410-2354-9 : Б. ц. - URL: <https://e.lanbook.com/book/159986> (дата обращения: 15.05.2020). - Режим доступа: ЭБС Лань. - Текст : электронный.

2) Чернопяттов, А. М. Риск-менеджмент : учебно-методическое пособие / А.М. Чернопяттов. - Москва|Берлин : Директ-Медиа, 2018. - 177 с. : ил., схем., табл. - Библиогр. в кн. - ISBN 978-5-4475-2824-9 : Б. ц. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=495847/> (дата обращения: 24.03.2020). - Режим доступа: ЭБС Университетская библиотека ONLINE. - Текст : электронный.

Периодические издания

1) Управление риском : ежекварт. аналит. журн.. - М. : [б. и.]. - Выходит ежеквартально. - ISSN 1684-6303. - Текст : непосредственный.

Учебно-наглядное пособие

1) Сысолятин, Алексей Витальевич. Управление стоимостью и рисками проекта : учебно-наглядное пособие для обучающихся направления подготовки 38.03.02 "Менеджмент" всех форм обучения / А. В. Сысолятин ; ВятГУ, ИЭМ, ФМиС, каф. МиМ. - Киров : ВятГУ, 2021. - 15 с. - Б. ц. - Текст . Изображение : электронное.

Электронные образовательные ресурсы

1) Портал дистанционного обучения ВятГУ [электронный ресурс] / - Режим доступа: <http://mooc.do-kirov.ru/>

2) Раздел официального сайта ВятГУ, содержащий описание образовательной программы [электронный ресурс] / - Режим доступа: https://www.vyatsu.ru/php/programms/eduPrograms.php?Program_ID=3-38.03.02.02

3) Личный кабинет студента на официальном сайте ВятГУ [электронный ресурс] / - Режим доступа: <https://new.vyatsu.ru/account/>

4) Единое окно доступа к образовательным ресурсам <http://window.edu.ru/>

Электронные библиотечные системы (ЭБС)

- ЭБС «Научная электронная библиотека eLIBRARY» (<http://elibrary.ru/defaultx.asp>)
- ЭБС «Издательства Лань» (<http://e.lanbook.com/>)
- ЭБС «Университетская библиотека online» (www.biblioclub.ru)
- Внутренняя электронно-библиотечная система ВятГУ (<http://lib.vyatsu.ru/>)
- ЭБС «ЮРАЙТ» (<https://urait.ru>)

Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы

- ГАРАНТ
- КонсультантПлюс
- Техэксперт: Нормы, правила, стандарты
- Роспатент (<https://www1.fips.ru/elektronnye-servisy/informatsionno-poiskovaya-sistema>)
- Web of Science® (<http://webofscience.com>)

Материально-техническое обеспечение дисциплины

Демонстрационное оборудование

Перечень используемого оборудования
Акустическая система
МУЛЬТИМЕДИА ПРОЕКТОР CASIO XJ-F210WN С ДОПОЛНИТЕЛЬНЫМ КАБЕЛЕМ HDMI
Экран настенный 198*264

Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, в том числе лицензионное и свободно распространяемое ПО (включая ПО отечественного производства)

№ п.п	Наименование ПО	Краткая характеристика назначения ПО
1	Программная система с модулями для обнаружения текстовых заимствований в учебных и научных работах «Антиплагиат.ВУЗ»	Программный комплекс для проверки текстов на предмет заимствования из Интернет-источников, в коллекции диссертация и авторефератов Российской государственной библиотеки (РГБ) и коллекции нормативно-правовой документации LEXPRO
2	Microsoft Office 365 ProPlusEdu ALNG SubsVL MVL AddOn toOPP	Набор веб-сервисов, предоставляющий доступ к различным программам и услугам на основе платформы Microsoft Office, электронной почте бизнес-класса, функционалу для общения и управления документами
3	Office Professional Plus 2016	Пакет приложений для работы с различными типами документов: текстами, электронными таблицами, базами данных, презентациями
4	Windows Professional	Операционная система
5	Kaspersky Endpoint Security для бизнеса	Антивирусное программное обеспечение
6	Справочная правовая система «Консультант Плюс»	Справочно-правовая система по законодательству Российской Федерации
7	Электронный периодический справочник ГАРАНТ Аналитик	Справочно-правовая система по законодательству Российской Федерации
8	Security Essentials (Защитник Windows)	Защита в режиме реального времени от шпионского программного обеспечения, вирусов.
9	МойОфис Стандартный	Набор приложений для работы с документами, почтой, календарями и контактами на компьютерах и веб браузерах

Обновленный список программного обеспечения данной рабочей программы находится по адресу:
https://www.vyatsu.ru/php/list_it/index.php?op_id=93573