

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:

ФИО: Исаев Игорь Магомедович

Должность: Проректор по безопасности и общим вопросам

Дата подписания: 26.09.2023 16:44:45

Уникальный программный ключ:

d7a26b9e8ca85e98ac3de2ab454b4659d961f749

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования

«Национальный исследовательский технологический университет «МИСиС»

Рабочая программа дисциплины (модуля)

Риск-менеджмент

Закреплена за подразделением

Кафедра промышленного менеджмента

Направление подготовки

38.04.02 МЕНЕДЖМЕНТ

Профиль

Управление бизнесом в цифровой экономике

Квалификация

Магистр

Форма обучения

очная

Общая трудоемкость

3 ЗЕТ

Часов по учебному плану

108

Формы контроля в семестрах:

в том числе:

экзамен 3

аудиторные занятия

17

самостоятельная работа

37

часов на контроль

54

Распределение часов дисциплины по семестрам

| Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>) | 3 (2.1) | | Итого | |
|---|---------|-----|-------|-----|
| | УП | РП | | |
| Неделя | 18 | | | |
| Вид занятий | УП | РП | УП | РП |
| Лекции | 6 | 6 | 6 | 6 |
| Практические | 11 | 11 | 11 | 11 |
| Итого ауд. | 17 | 17 | 17 | 17 |
| Контактная работа | 17 | 17 | 17 | 17 |
| Сам. работа | 37 | 37 | 37 | 37 |
| Часы на контроль | 54 | 54 | 54 | 54 |
| Итого | 108 | 108 | 108 | 108 |

Программу составил(и):

ст.преп., Ковтун Анна Васильевна

Рабочая программа

Риск-менеджмент

Разработана в соответствии с ОС ВО:

Самостоятельно устанавливаемый образовательный стандарт высшего образования - магистратура Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования «Национальный исследовательский технологический университет «МИСиС» по направлению подготовки 38.04.02 МЕНЕДЖМЕНТ (приказ от 02.04.2021 г. № 119 о.в.)

Составлена на основании учебного плана:

38.04.02 МЕНЕДЖМЕНТ, 38.04.02-ММН-22-2.plx Управление бизнесом в цифровой экономике, утвержденного Ученым советом ФГАОУ ВО НИТУ "МИСиС" в составе соответствующей ОПОП ВО 22.09.2022, протокол № 8-22

Утверждена в составе ОПОП ВО:

38.04.02 МЕНЕДЖМЕНТ, Управление бизнесом в цифровой экономике, утвержденной Ученым советом ФГАОУ ВО НИТУ "МИСиС" 22.09.2022, протокол № 8-22

Рабочая программа одобрена на заседании

Кафедра промышленного менеджмента

Протокол от 20.05.2022 г., №15

Руководитель подразделения Костюхин Юрий Юрьевич

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ

| | |
|-----|---|
| 1.1 | Сформировать комплексное представление о возможных методах оценки и управления рисками, ознакомить с методами оптимизации рисков. |
| 1.2 | Научить основным методам измерения различных видов риска. |
| 1.3 | Научить основным подходам к построению системы управления рисками и формированию стратегии по управлению рисками. |
| 1.4 | Научить методам оптимизации финансовых рисков. |

2. МЕСТО В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

| | | |
|------------|---|------|
| Блок ОП: | | Б1.В |
| 2.1 | Требования к предварительной подготовке обучающегося: | |
| 2.1.1 | Международная логистика | |
| 2.1.2 | Производственный менеджмент (продвинутый уровень) | |
| 2.2 | Дисциплины (модули) и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее: | |
| 2.2.1 | Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы | |
| 2.2.2 | Учебная практика по получению первичных профессиональных умений и навыков. Преддипломная практика | |

3. РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ, СООТНЕСЕННЫЕ С ФОРМИРУЕМЫМИ КОМПЕТЕНЦИЯМИ

| | |
|--|--|
| ОПК-3: Способен самостоятельно принимать обоснованные организационно-управленческие решения, оценивать их операционную и организационную эффективность, социальную значимость, обеспечивать их реализацию в условиях сложной (в том числе кросс-культурной) и динамичной среды, применять знание экономических, организационных и управленческих вопросов, таких как: управление проектами, рисками и изменениями | |
| Знать: | |
| ОПК-3-33 Методы расчета рискованности. | |
| ОПК-3-32 Концепцию рискованности | |
| ОПК-3-31 Статистические методы оценки рисков. | |
| Уметь: | |
| ОПК-3-У3 Давать количественную оценку уровня риска. | |
| ОПК-3-У2 Выбирать оптимальную хозяйственную операцию и наименее рискованное вложение капитала. | |
| ОПК-3-У1 Оптимизировать вложения средств с точки зрения риска. | |
| Владеть: | |
| ОПК-3-В3 Владеть методами вычисления VAR (рискованности). | |
| ОПК-3-В2 Владеть математическими методами оптимизации рисков. | |
| ОПК-3-В1 Владеть статистическими методами оценки рисков. | |

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ

| Код занятия | Наименование разделов и тем /вид занятия/ | Семестр / Курс | Часов | Формируемые индикаторы компетенций | Литература и эл. ресурсы | Примечание | КМ | Выполняемые работы |
|-------------|--|----------------|-------|------------------------------------|--------------------------|--|----|--------------------|
| | Раздел 1. Статистические методы оценки риска | | | | | | | |
| 1.1 | Основные статистические показатели, применяемые для оценки риска /Лек/ | 3 | 1 | ОПК-3-31 | Л1.1Л2.1 Э2 | | | |
| 1.2 | Статистический метод расчета бета-коэффициентов. /Пр/ | 3 | 1 | ОПК-3-31 | Л1.1Л2.1 Э1 Э2 | Занятия проводятся в дисплейном классе | | |

| | | | | | | | | |
|--|--|---|----|--|-------------------|--|-------------|----|
| 1.3 | Освоение материала по теме "Статистические методы оценки риска". Выполнение курсовой работы. /Ср/ | 3 | 10 | ОПК-3-31 ОПК-3-У1 | Л1.1Л2.1 Э1 Э2 | | | |
| Раздел 2. Концепция рисковей стоимости | | | | | | | | |
| 2.1 | Методы расчета рисковей стоимости /Лек/ | 3 | 3 | ОПК-3-31 ОПК-3-32 ОПК-3-33 | Л1.1 | | | |
| 2.2 | Расчет рисковей стоимости ковариационным методом /Пр/ | 3 | 4 | ОПК-3-31 ОПК-3-32 ОПК-3-33 ОПК-3-У1 ОПК-3-У2 ОПК-3-У3 | Л1.1 Э1 | Занятия проводятся в дисплейном классе | КМ1 | |
| 2.3 | Освоение материала по теме "Концепция рисковей стоимости". Выполнение курсовой работы. /Ср/ | 3 | 10 | ОПК-3-31 ОПК-3-32 ОПК-3-33 ОПК-3-У1 ОПК-3-У2 ОПК-3-У3 | Л1.1 | | | Р1 |
| Раздел 3. Методы оценки риска вложений в ценные бумаги | | | | | | | | |
| 3.1 | Оценка риска портфеля ценных бумаг /Лек/ | 3 | 1 | ОПК-3-31 | Л1.1Л2.1 Э2 | | | |
| 3.2 | Расчет общего риска портфеля ценных бумаг /Пр/ | 3 | 2 | ОПК-3-31 ОПК-3-У1 | Л1.1Л2.1 Э1 Э2 | Занятия проводятся в дисплейном классе | КМ2 | |
| 3.3 | Освоение материала по теме "Методы оценка риска вложений в ценные бумаги". Выполнение курсовой работы. /Ср/ | 3 | 10 | ОПК-3-31 ОПК-3-У1 | Л1.1Л2.1 Э1 Э2 | | | Р1 |
| Раздел 4. Оптимизация портфеля ценных бумаг по уровню риска | | | | | | | | |
| 4.1 | Методика расчета оптимального портфеля ценных бумаг /Лек/ | 3 | 1 | ОПК-3-31 ОПК-3-32 ОПК-3-33 | Л1.1Л2.1 Э2 | | | |
| 4.2 | Расчет оптимального портфеля ценных бумаг /Пр/ | 3 | 4 | ОПК-3-31 ОПК-3-32 ОПК-3-33 ОПК-3-У1 ОПК-3-У2 ОПК-3-У3 | Л1.1Л2.1 Э1 Э2 | Занятия проводятся в дисплейном классе | КМ3,К М4 | |
| 4.3 | Освоение материала по теме "Оптимизация портфеля ценных бумаг". Выполнение курсовой работы. /Ср/ | 3 | 7 | ОПК-3-31 ОПК-3-32 ОПК-3-33 ОПК-3-У1 ОПК-3-У2 ОПК-3-У3 | Л1.1Л2.1 Э1 Э2 | | | Р1 |

5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ МАТЕРИАЛОВ

5.1. Контрольные мероприятия (контрольная работа, тест, коллоквиум, экзамен и т.п), вопросы для самостоятельной подготовки

| Код КМ | Контрольное мероприятие | Проверяемые индикаторы компетенций | Вопросы для подготовки |
|--------|-------------------------|------------------------------------|------------------------|
|--------|-------------------------|------------------------------------|------------------------|

| | | | |
|-----|--|----------------------------|---|
| КМ1 | Реферат | ОПК-3-31;ОПК-3-32;ОПК-3-33 | <p>Типовые темы докладов:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Бюджетирование как метод управления финансовыми рисками. 2. Особенности управления валютными рисками. 3. Предпринимательские риски и хеджирование в отечественной экономике. 4. Промышленная безопасность и стратегия управления промышленными рисками. 5. Организация мероприятий по управлению риском на промышленном предприятии. 6. Инвестиционная деятельность страховых компаний. 7. Учет неопределенности и оценка рисков инвестиционного проекта. 8. Критерии эффективности применения способов активного и пассивного управления рисками. 9. Этические нормы защиты от предпринимательского риска. 10. Риск-менеджмент в инновационной деятельности. 11. Анткризисное управление как основа риск-менеджмента. 12. Управление рисками в банковской системе. 13. Основные способы и инструменты управления рисками. 14. Концепция рисковости стоимости. 15. Методы анализа рисков: вариация, дисперсия, стандартное отклонение, дерево решений. 16. Учет риска в доходном подходе к оценке бизнеса. 17. Анализ странового риска. 18. Управление инвестиционными рисками. Метод Монте-Карло. 19. Хеджирование как способ управления рисками. 20. Декларация промышленной безопасности. 21. Область применения, принципы, процесс создания риск-менеджмента. 22. Принципы процесса управления рисками: принцип максимизации, принцип минимизации, принцип адекватности реакции, принцип принятия риска. 23. Допустимые, критические катастрофические риски. |
| КМ2 | Контрольная работа №1. Риск как экономическая категория. | ОПК-3-31 | <p>Контрольные вопросы:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Каковы основные подходы к определению понятия «риск»? 2. Какую функцию риска характеризует выполнение им роли катализатора в принятии решений, связанных с реализацией инновационных проектов? 3. Каковы основные причины возникновения неопределенности? 4. Назовите обязательные условия рисковости ситуации. 5. Какие виды потерь могут возникнуть в результате воздействия риска? 6. Дайте определение риска как экономической категории. 7. С какими категориями связана объективная основа риска? 8. При каком отношении предпринимателя к риску увеличение общей полезности превышает прирост связанного с риском дохода? 9. При каком отношении к риску предприниматель предпочитает определенный гарантированный доход? |
| КМ3 | Контрольная работа №2. Организация процесса управления риском на предприятии | ОПК-3-32;ОПК-3-33 | <p>Контрольные вопросы:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Охарактеризуйте область применения риск-менеджмента. 2. Какие Вы можете назвать основные факторы риска невостребованности продукции? 3. К каким факторам относятся: законодательство, регулирующее предпринимательскую деятельность; действия органов государственного и местного управления; налоговая система; взаимоотношения с партнерами; конкуренция предпринимателей? 4. Что такое факторы и причины риска? 5. Перечислите цели и задачи риск-менеджмента. 6. Охарактеризуйте алгоритм управления риском. 7. Перечислите функции системы риск-менеджмента организации. 8. Что включается в протокол риска? 9. Какие этапы входят в процесс принятия решений? |

| | | | |
|-----|---|----------|--|
| КМ4 | Контрольная работа №3. Методы оценки риска. | ОПК-3-33 | Контрольные вопросы: 1. Какова сущность метода построения деревьев событий при оценке рисков? 2. Назовите условия, необходимые для эффективного применения метода «события – последствия». 3. Приведите пример построения деревьев отказов. 4. Как производится оценка ущерба. |
|-----|---|----------|--|

5.2. Перечень работ, выполняемых по дисциплине (Курсовая работа, Курсовой проект, РГР, Реферат, ЛР, ПР и т.п.)

| Код работы | Название работы | Проверяемые индикаторы компетенций | Содержание работы |
|------------|-----------------|--|--|
| P1 | Курсовая работа | ОПК-3-31;ОПК-3-32;ОПК-3-33;ОПК-3-У1;ОПК-3-У2;ОПК-3-У3;ОПК-3-В1;ОПК-3-В2;ОПК-3-В3 | Курсовая работа имеет индивидуальное задание для каждого студента с общей тематикой «Оптимизация портфеля ценных бумаг» и содержит три взаимосвязанные задачи: выбор и обоснование портфеля ценных бумаг, анализ рисковой стоимости выбранного портфеля и оптимизация портфеля ценных бумаг. |

5.3. Оценочные материалы, используемые для экзамена (описание билетов, тестов и т.п.)

Экзаменационный билет состоит из трех теоретических вопросов. Экзаменационные билеты хранятся на кафедре.

Экзаменационный билет №1

Сущность категории «риск»; эволюция представлений о риске.

Объективные и субъективные стороны риска; причины возникновения экономического риска.

Цели, задачи и функции риск-менеджмента. Функциональная структура риск-менеджмента.

Экзаменационный билет №2

Алгоритм управления риском в системе управления предприятием.

Организация процесса управления риском на предприятии.

Мониторинг программ риск-менеджмента. Принятие решений.

Экзаменационный билет №3

Общие принципы классификации рисков.

Виды рисков: промышленные риски.

Виды рисков: экологические риски.

Экзаменационный билет №4

Методы выявления риска: анализ финансовой и управленческой отчетности.

Оценка вероятности неблагоприятных событий: метод построения деревьев событий.

Концепция приемлемого риска.

5.4. Методика оценки освоения дисциплины (модуля, практики. НИР)

Предполагается следующая шкала оценок:

а) «отлично» – студент показывает глубокие, исчерпывающие знания в объеме пройденной программы, уверенно действует по применению полученных знаний на практике, грамотно и логически стройно излагает материал при ответе, умеет формулировать выводы из изложенного теоретического материала, знает дополнительно рекомендованную литературу;

б) «хорошо» – студент показывает твердые и достаточно полные знания в объеме пройденной программы, допускает незначительные ошибки при освещении заданных вопросов, правильно действует по применению знаний на практике, четко излагает материал;

в) «удовлетворительно» – студент показывает знания в объеме пройденной программы, ответы излагает хотя и с ошибками, но уверенно исправляемыми после дополнительных и наводящих вопросов, правильно действует по применению знаний на практике;

г) «неудовлетворительно» – студент допускает грубые ошибки в ответе, не понимает сущности излагаемого вопроса, не умеет применять знания на практике, дает неполные ответы на дополнительные и наводящие вопросы;

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ

6.1. Рекомендуемая литература

6.1.1. Основная литература

| | Авторы, составители | Заглавие | Библиотека | Издательство, год |
|------|---------------------|---|------------------------|-------------------|
| Л1.1 | Ларионова И. А. | Риск-менеджмент (N 2733): учеб. пособие | Электронная библиотека | М.: [МИСиС], 2017 |

6.1.2. Дополнительная литература

| | Авторы, составители | Заглавие | Библиотека | Издательство, год |
|--|---------------------|----------|------------|-------------------|
|--|---------------------|----------|------------|-------------------|

| | | | | |
|---|--|---|------------------|------------------------|
| | Авторы, составители | Заглавие | Библиотека | Издательство, год |
| Л2.1 | Ларионова И. А. | Управление финансовыми рисками: учеб. пособие | Библиотека МИСиС | М.: Изд-во МИСиС, 2010 |
| 6.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» | | | | |
| Э1 | Московская биржа. Официальный сайт. | https://www.moex.com/ | | |
| Э2 | Образовательная платформа института ЭУШП | http://85.143.106.40/ | | |
| 6.3 Перечень программного обеспечения | | | | |
| П.1 | Win Pro 10 32-bit/64-bit | | | |
| П.2 | Microsoft Office | | | |
| П.3 | LMS Canvas | | | |
| П.4 | MS Teams | | | |
| 6.4. Перечень информационных справочных систем и профессиональных баз данных | | | | |

| 7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ | | |
|---|--|---|
| Ауд. | Назначение | Оснащение |
| Любой корпус Мультимедийная | Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа и/или для проведения практических занятий: | комплект учебной мебели до 36 мест для обучающихся, мультимедийное оборудование, магнитно-маркерная доска, рабочее место преподавателя, ПКс доступом к ИТС «Интернет», ЭИОС университета через личный кабинет на платформе LMS Canvas, лицензионные программы MS Office, MS Teams, ESET Antivirus |
| Любой корпус Компьютерный класс | Учебная аудитория для проведения практических занятий: | экран, проектор, доска, комплект учебной мебели на 30 посадочных мест, персональные компьютеры, доступ к ЭИОС университета LMS Canvas, лицензионные программы MS Teams, MS Office |
| Читальный зал №3 (Б) | | комплект учебной мебели на 44 места для обучающихся, МФУ Xerox VersaLink B7025 с функцией масштабирования текстов и изображений, 8 ПК с доступом к ИТС «Интернет», ЭИОС университета через личный кабинет на платформе LMS Canvas, лицензионные программы MS Office, MS Teams, ESET Antivirus. |
| Любой корпус Мультимедийная | Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа и/или для проведения практических занятий: | комплект учебной мебели до 36 мест для обучающихся, мультимедийное оборудование, магнитно-маркерная доска, рабочее место преподавателя, ПКс доступом к ИТС «Интернет», ЭИОС университета через личный кабинет на платформе LMS Canvas, лицензионные программы MS Office, MS Teams, ESET Antivirus |
| Любой корпус Мультимедийная | Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа и/или для проведения практических занятий: | комплект учебной мебели до 36 мест для обучающихся, мультимедийное оборудование, магнитно-маркерная доска, рабочее место преподавателя, ПКс доступом к ИТС «Интернет», ЭИОС университета через личный кабинет на платформе LMS Canvas, лицензионные программы MS Office, MS Teams, ESET Antivirus |

8. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ

Преподавание дисциплины предусматривает следующие формы организации учебного процесса: лекции, практические занятия, самостоятельную работу студента, консультации.

При изучении тем студентам необходимо повторить лекционный учебный материал, изучить рекомендованную литературу, а также учебный материал, находящийся в указанных информационных ресурсах.

На завершающем этапе изучения каждого модуля необходимо, воспользовавшись предложенными вопросами для самоконтроля, размещенными в электронной информационной образовательной среде (LMS), проверить качество усвоения учебного материала.

В случае затруднения в ответах на поставленные вопросы рекомендуется повторить учебный материал.

После изучения каждого модуля дисциплины необходимо ответить на вопросы контрольного теста по данному модулю с целью оценивания знаний и получения баллов.

По завершению изучения учебной дисциплины в семестре студент обязан пройти промежуточную аттестацию. Вид промежуточной аттестации определяется рабочим учебным планом. Форма проведения промежуточной аттестации – компьютерное тестирование с использованием автоматизированной системы тестирования знаний студентов в LMS.

К промежуточной аттестации допускаются студенты, выполнившие требования рабочего учебного плана.

Особенности освоения дисциплины для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья Обучение обучающихся с ограниченными возможностями здоровья при необходимости, по личному заявлению, осуществляется на основе адаптированной рабочей программы с использованием специальных методов обучения и дидактических

материалов, составленных с учетом особенностей психофизического развития, индивидуальных возможностей и состояния здоровья таких обучающихся (обучающегося).