

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:

ФИО: Исаев Игорь Магомедович

Должность: Проректор по учебной работе

Дата подписания: 01.09.2023 11:50:09

Уникальный идентификатор документа:

d7a26b9e8ca85e98ec3de2eb454b4659d061f249

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

Финансовый менеджмент

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-23-1.plx Финансовый менеджмент, утвержденного Ученым советом НИТУ МИСИС в составе соответствующей ОПОП ВО 22.06.2023, протокол № 5-23

Утверждена в составе ОПОП ВО:

38.04.02 МЕНЕДЖМЕНТ, Финансовый менеджмент, утвержденной Ученым советом НИТУ МИСИС 22.06.2023, протокол № 5-23

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 представления 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	Логистика. Продвинутый уровень	
2.1.2	Страховое дело	
2.1.3	Производственный менеджмент (продвинутый уровень)	
2.2	Дисциплины (модули) и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:	
2.2.1	Защита выпускной квалификационной работы	
2.2.2	Учебная практика по получению первичных профессиональных умений и навыков. Научно-исследовательская 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 рисковей стоимости.	
ОПК-3-32 Концепцию рисковей стоимости	
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 (рисковей стоимости).	
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
--------	-------------------------	------------------------------------	------------------------

KM1	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.
KM2	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?
KM3	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).