

Министерство науки и высшего образования РФ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Национальный исследовательский университет «МЭИ»

Направление подготовки/специальность: 38.03.01 Экономика

Наименование образовательной программы: Экономика и экономическая безопасность предприятия (организации)

Уровень образования: высшее образование - бакалавриат

Форма обучения: Очно-заочная

Рабочая программа дисциплины
УПРАВЛЕНИЕ ЭКОНОМИЧЕСКИМИ РИСКАМИ

| | |
|---|---|
| Блок: | Блок 1 «Дисциплины (модули)» |
| Часть образовательной программы: | Часть, формируемая участниками образовательных отношений |
| № дисциплины по учебному плану: | Б1.Ч.02.01 |
| Трудоемкость в зачетных единицах: | 7 семестр - 6; |
| Часов (всего) по учебному плану: | 216 часов |
| Лекции | 7 семестр - 16 часов; |
| Практические занятия | 7 семестр - 16 часов; |
| Лабораторные работы | не предусмотрено учебным планом |
| Консультации | 7 семестр - 10 часов; |
| Самостоятельная работа | 7 семестр - 169,2 часа; |
| в том числе на КП/КР | 7 семестр - 14 часов; |
| Иная контактная работа | 7 семестр - 4 часа; |
| включая: Тестирование Контрольная работа | |
| Промежуточная аттестация: | |
| Защита курсовой работы | 7 семестр - 0,4 часа; |
| Экзамен | 7 семестр - 0,4 часа; всего - 0,8 часа |

Москва 2023

ПРОГРАММУ СОСТАВИЛ:

Преподаватель

(должность)

| | | |
|---|--|--------------------------------|
|  | Подписано электронной подписью ФГБОУ ВО «НИУ «МЭИ» | |
| | Сведения о владельце ЦЭП МЭИ | |
| | Владелец | Унижаев Н.В. |
| | Идентификатор | Rb43f42d6-UnizhayevNV-2454ef20 |

(подпись)

Н.В. Унижаев

(расшифровка
подписи)

СОГЛАСОВАНО:

Руководитель
образовательной программы

(должность, ученая степень, ученое звание)

| | | |
|---|--|--------------------------------|
|  | Подписано электронной подписью ФГБОУ ВО «НИУ «МЭИ» | |
| | Сведения о владельце ЦЭП МЭИ | |
| | Владелец | Унижаев Н.В. |
| | Идентификатор | Rb43f42d6-UnizhayevNV-2454ef20 |

(подпись)

Н.В. Унижаев

(расшифровка
подписи)

Заведующий выпускающей
кафедры

(должность, ученая степень, ученое звание)

| | | |
|---|--|-----------------------------|
|  | Подписано электронной подписью ФГБОУ ВО «НИУ «МЭИ» | |
| | Сведения о владельце ЦЭП МЭИ | |
| | Владелец | Невский А.Ю. |
| | Идентификатор | R4bc65573-NevskyAY-0b6e493d |

(подпись)

А.Ю. Невский

(расшифровка
подписи)

1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель освоения дисциплины: обучение студентов методике построения и практического применения моделей представления экономических рисков, методам управления экономическими рисками с использованием традиционных и современных технологий

Задачи дисциплины

- исследовать природу, содержание и особенности различных видов рисков, источники и факторы их возникновения;
- провести классификацию и структуризацию рисков для конкретной компании;
- рассмотреть методы анализа и оценки рисков;
- изучить способы и инструменты снижения рисков в различных сферах бизнес-деятельности.

Формируемые у обучающегося **компетенции** и запланированные **результаты обучения** по дисциплине, соотнесенные с **индикаторами достижения компетенций**:

| Код и наименование компетенции | Код и наименование индикатора достижения компетенции | Запланированные результаты обучения |
|--|---|--|
| ПК-1 Способность разрабатывать отдельные функциональные направления управления рисками | ИД-1 _{ПК-1} Способен выполнять мониторинг рисков | знать: - классификацию и структуризацию рисков для организаций; - методы анализа и оценки рисков. уметь: - принимать оптимальные решения по минимизации потерь и ущерба; - документировать процесс управления рисками. |
| ПК-1 Способность разрабатывать отдельные функциональные направления управления рисками | ИД-2 _{ПК-1} Способен проводить анализ экономических рисков, оценивать их и прогнозировать последствия воздействия угроз экономической безопасности | знать: - пути минимизации рисков, влияющих на экономические процессы; - методы мониторинга рисков. уметь: - проводить анализ и управлять экономическими рисками; - обрабатывать полученные данные. |
| ПК-1 Способность разрабатывать отдельные функциональные направления управления рисками | ИД-3 _{ПК-1} Способен разрабатывать мероприятия по управлению рисками | знать: - нормативно-правовое регулирование рисков, роль государства в управлении рисками; - особенности представления материалов, связанных с управлением рисками. уметь: - выполнять мониторинг рисков для конкретной организации; - проводить оценку последствиям воздействия угроз экономической безопасности. |
| ПК-1 Способность | ИД-4 _{ПК-1} Способен | знать: |

| Код и наименование компетенции | Код и наименование индикатора достижения компетенции | Запланированные результаты обучения |
|---|--|---|
| разрабатывать отдельные функциональные направления управления рисками | документировать процесс управления рисками | <ul style="list-style-type: none"> - требования к документообороту; - методы управления экономиками процессами. <p>уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> - собирать, обрабатывать и хранить документы, связанные с управлением рисками; - используя стандарты создать систему мониторинга рисков. |

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ ВО

Дисциплина относится к основной профессиональной образовательной программе Экономика и экономическая безопасность предприятия (организации) (далее – ОПОП), направления подготовки 38.03.01 Экономика, уровень образования: высшее образование - бакалавриат.

Базируется на уровне среднего общего образования.

Результаты обучения, полученные при освоении дисциплины, необходимы при выполнении выпускной квалификационной работы.

3. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

3.1 Структура дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины составляет 6 зачетных единиц, 216 часов.

| № п/п | Разделы/темы дисциплины/формы промежуточной аттестации | Всего часов на раздел | Семестр | Распределение трудоемкости раздела (в часах) по видам учебной работы | | | | | | | | | | Содержание самостоятельной работы/ методические указания |
|-------|--|-----------------------|---------|--|-----|----|--------------|---|-----|----|----|-------------------|-----------------------------------|--|
| | | | | Контактная работа | | | | | | | СР | | | |
| | | | | Лек | Лаб | Пр | Консультация | | ИКР | | ПА | Работа в семестре | Подготовка к аттестации /контроль | |
| КПР | ГК | ИККП | ТК | | | | | | | | | | | |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 |
| 1 | Понятие риска, его основные элементы и черты | 44 | 7 | 6 | - | 2 | - | - | - | - | - | 36 | - | <p><u>Подготовка к контрольной работе:</u> Изучение материалов по разделу Понятие риска, его основные элементы и черты и подготовка к контрольной работе</p> <p><u>Подготовка доклада, выступления:</u> Задание связано с углубленным изучением разделов дисциплины и самостоятельным поиском материалов для раскрытия темы доклада. Материалы выполненной работы представляются в электронном виде или в форме распечатанных презентационных слайдов. В качестве тем докладов студентам предлагаются следующие варианты:</p> <p><u>Подготовка домашнего задания:</u> Подготовка домашнего задания направлена на отработку умений решения профессиональных задач. Домашнее задание выдается студентам по изученному в разделе "Понятие риска, его основные элементы и черты" материалу. Дополнительно студенту необходимо изучить литературу и разобрать примеры выполнения подобных заданий. Проверка домашнего задания проводится по представленным письменным работам.</p> <p><u>Подготовка к аудиторным занятиям:</u> Проработка лекции, выполнение и подготовка к защите лаб. работы</p> <p><u>Подготовка к текущему контролю:</u></p> |
| 1.1 | Тема 1. Введение в проблематику риска. | 14 | | 2 | - | - | - | - | - | - | - | 12 | - | |
| 1.2 | Тема 2. Современные теории риска. | 15 | | 2 | - | 1 | - | - | - | - | - | 12 | - | |
| 1.3 | Тема 3. Основы классификации рисков | 15 | | 2 | - | 1 | - | - | - | - | - | 12 | - | |

| | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|-----|------------------------------------|----|---|---|---|---|---|---|---|---|---|----|---|--|--|--|---|
| | | | | | | | | | | | | | | | | | <p>Повторение материала по разделу "Понятие риска, его основные элементы и черты" <u>Подготовка к практическим занятиям:</u> Изучение материала по разделу "Понятие риска, его основные элементы и черты" подготовка к выполнению заданий на практических занятиях <u>Изучение материалов литературных источников:</u> [4], 27-36 [6], 38-86 [12], 14-87 [13], 24-58 [14], 24-76</p> |
| 2 | Теория управления рисками | 32 | 4 | - | 4 | - | - | - | - | - | - | 24 | - | | | | <u>Подготовка к текущему контролю:</u> Повторение материала по разделу "Теория управления рисками" |
| 2.1 | Тема 4 Риски по сфере деятельности | 16 | 2 | - | 2 | - | - | - | - | - | - | 12 | - | | | | <u>Подготовка к практическим занятиям:</u> Изучение материала по разделу "Теория управления рисками" подготовка к выполнению заданий на практических занятиях |
| 2.2 | Тема 5. Понятие управления рисками | 16 | 2 | - | 2 | - | - | - | - | - | - | 12 | - | | | | <u>Подготовка доклада, выступления:</u> Задание связано с углубленным изучением разделов дисциплины и самостоятельным поиском материалов для раскрытия темы доклада. Материалы выполненной работы представляются в электронном виде или в форме распечатанных презентационных слайдов. В качестве тем докладов студентам предлагаются следующие варианты: <u>Подготовка домашнего задания:</u> Подготовка домашнего задания направлена на отработку умений решения профессиональных задач. Домашнее задание выдается студентам по изученному в разделе "Теория управления рисками" материалу. Дополнительно студенту необходимо изучить литературу и разобрать примеры |

| | | | | | | | | | | | | | |
|-----|--|----|---|---|---|---|---|---|---|---|----|---|---|
| | | | | | | | | | | | | | <p>выполнения подобных заданий. Проверка домашнего задания проводится по представленным письменным работам.</p> <p><u>Подготовка к аудиторным занятиям:</u> Проработка лекции, выполнение и подготовка к защите лаб. работы</p> <p><u>Изучение материалов литературных источников:</u></p> <p>[1], 47-76 [2], 112-145 [3], 26-87 [4], 39-55 [5], 47-57 [8], 54-87 [11], 12-35 [13], 37-79 [16], 47-87 [17], 36-87</p> |
| 3 | Теория и практика оценки и снижения предпринимательских рисков | 48 | 4 | - | 6 | - | - | - | - | - | 38 | - | <p><u>Подготовка к практическим занятиям:</u> Изучение материала по разделу "Теория и практика оценки и снижения предпринимательских рисков" подготовка к выполнению заданий на практических занятиях</p> |
| 3.1 | Тема 6. Понятие оценки рисков. | 16 | 2 | - | 2 | - | - | - | - | - | 12 | - | <p><u>Подготовка к контрольной работе:</u> Изучение материалов по разделу Теория и практика оценки и снижения предпринимательских рисков и подготовка к контрольной работе</p> |
| 3.2 | Тема 7. Оценка риска в условиях неопределённости | 15 | 1 | - | 2 | - | - | - | - | - | 12 | - | <p><u>Подготовка доклада, выступления:</u> Задание связано с углубленным изучением разделов дисциплины и самостоятельным поиском материалов для раскрытия темы доклада. Материалы выполненной работы представляются в электронном виде или в форме распечатанных презентационных слайдов. В качестве тем докладов студентам предлагаются следующие варианты:</p> |
| 3.3 | Тема 8 Основы снижения рисков | 17 | 1 | - | 2 | - | - | - | - | - | 14 | - | <p><u>Подготовка домашнего задания:</u></p> |

| | | | | | | | | | | | | | |
|-----|-----------------------------------|------|---|---|---|---|---|---|---|---|------|---|---|
| | | | | | | | | | | | | | <p>Подготовка домашнего задания направлена на отработку умений решения профессиональных задач. Домашнее задание выдается студентам по изученному в разделе "Теория и практика оценки и снижения предпринимательских рисков" материалу. Дополнительно студенту необходимо изучить литературу и разобрать примеры выполнения подобных заданий. Проверка домашнего задания проводится по представленным письменным работам.</p> <p><u>Подготовка к аудиторным занятиям:</u> Проработка лекции, выполнение и подготовка к защите лаб. работы</p> <p><u>Проведение исследований:</u> Работа выполняется по индивидуальному заданию. Для проведения исследования применяется следующие материалы:</p> <p><u>Подготовка к текущему контролю:</u> Повторение материала по разделу "Теория и практика оценки и снижения предпринимательских рисков"</p> <p><u>Изучение материалов литературных источников:</u> [3], 45-76 [4], 57-87 [5], 24-76 [9], 113-114 [16], 116-186</p> |
| 4 | Способы управления рисками | 29.7 | 2 | - | 4 | - | - | - | - | - | 23.7 | - | <p><u>Подготовка к текущему контролю:</u> Повторение материала по разделу "Способы управления рисками"</p> <p><u>Подготовка к аудиторным занятиям:</u> Проработка лекции, выполнение и подготовка к защите лаб. работы</p> <p><u>Подготовка к практическим занятиям:</u> Изучение материала по разделу "Способы управления рисками" подготовка к выполнению заданий на практических</p> |
| 4.1 | Тема 9. Методы управления рисками | 12.7 | 1 | - | 2 | - | - | - | - | - | 9.7 | - | |
| 4.2 | Тема 10. Учет рисков в управлении | 17 | 1 | - | 2 | - | - | - | - | - | 14 | - | |

| | | | | | | | | | | | | | |
|--|----------------------|--------|----|---|----|-------|------|------|---|-----|--------|-------|---|
| | | | | | | | | | | | | | занятиях <u>Подготовка доклада, выступления:</u> Задание связано с углубленным изучением разделов дисциплины и самостоятельным поиском материалов для раскрытия темы доклада. Материалы выполненной работы представляются в электронном виде или в форме распечатанных презентационных слайдов. В качестве тем докладов студентам предлагаются следующие варианты: <u>Подготовка домашнего задания:</u> Подготовка домашнего задания направлена на отработку умений решения профессиональных задач. Домашнее задание выдается студентам по изученному в разделе "Способы управления рисками" материалу. Дополнительно студенту необходимо изучить литературу и разобрать примеры выполнения подобных заданий. Проверка домашнего задания проводится по представленным письменным работам. <u>Изучение материалов литературных источников:</u> [1], 68-112 [2], 76-79 [7], 27-87 [10], 27-47 [15], 37-87 [16], 26-38 |
| | Экзамен | 35.90 | - | - | - | - | 2.00 | - | - | 0.4 | - | 33.50 | |
| | Курсовая работа (КР) | 26.40 | - | - | - | 8.00 | - | 4.00 | - | 0.4 | 14 | - | |
| | Всего за семестр | 216.00 | 16 | - | 16 | 8.00 | 2.00 | 4.00 | - | 0.8 | 135.7 | 33.50 | |
| | Итого за семестр | 216.00 | 16 | - | 16 | 10.00 | | 4.00 | | 0.8 | 169.20 | | |

Примечание: Лек – лекции; Лаб – лабораторные работы; Пр – практические занятия; КПП – аудиторные консультации по курсовым проектам/работам; ИККП – индивидуальные консультации по курсовым проектам/работам; ГК- групповые консультации по разделам дисциплины; СР – самостоятельная работа студента; ИКР – иная контактная работа; ТК – текущий контроль; ПА – промежуточная аттестация

3.2 Краткое содержание разделов

1. Понятие риска, его основные элементы и черты

1.1. Тема 1. Введение в проблематику риска.

Риски и неопределенности. Понятие и природа риска. Управление риском как научная дисциплина и методология науки о рисках. Структурные характеристики риска. Асимметрия в доступе к информации. Влияние рисков на комплексную безопасность хозяйствующего субъекта. Формы потерь от рисков. Риск и неопределённость, риск и предпринимательство, риск и доходность. Причины рисков..

1.2. Тема 2. Современные теории риска.

Функции рисков. Тенденция расширения сфер и зон рискованных ситуаций в современных условиях..

1.3. Тема 3. Основы классификации рисков

Классификации по видам, причинам и факторам, времени возникновения, стадиям проявления, характеру действий и последствиям (внутренние и внешние, внешнеэкономические и международного бизнеса, чистые и спекулятивные, систематические и несистематические, диверсифицируемые и недиверсифицируемые, страхуемые и нестрахуемые)..

2. Теория управления рисками

2.1. Тема 4 Риски по сфере деятельности

Отраслевые, политические и глобальные, экономические, финансовые, инвестиционные, инновационные, риски венчурного финансирования, производственно-технические, коммерческие, потери качества выпускаемой продукции, репутационные, аудиторские, в электроэнергетике, нефтегазовой отрасли. Описание рыночных рисков на основе модели Башелье-Самуельсона, У. Шарпа. Риски по объектам воздействия: риски проекта, финансовых инструментов, портфеля ценных бумаг, персонала, слияний и поглощений, оценки недвижимости, принятия управленческих решений. Структуризация рисков, определяемых видом предпринимательской деятельности, направление появления возможных рисков, дерево событий-последствий и составление карты (профиля) рисков организации. Определение и оценка степени подверженности организации конкретному виду риска. Анализ степени рискозащищённости организации. Модель причинно-следственной диаграммы рисков К. Исикавы..

2.2. Тема 5. Понятие управления рисками

Сущность и содержание, цель и задачи риск-менеджмента. Компоненты системы управления рисками: субъект и объект управления в риск-менеджменте. Стратегия и тактика управления риском. Программа действий по снижению риска. Принципы управления рисками. Эвристические правила риск-менеджмента. Концепции риск-менеджмента. Стандартизация в риск-менеджменте.

3. Теория и практика оценки и снижения предпринимательских рисков

3.1. Тема 6. Понятие оценки рисков.

Оценка толерантности риска: объективный и субъективный подходы к отношению и оценке рисков. Границы приемлемости риска. Статистические показатели оценки величины риска: оценка вероятности риска в заданном интервале, оценка меры (величины) риска - показатели среднего значения (ожидаемого и прогнозируемого значения, числовых

характеристик множества (мода, медиана), коэффициент риска, показатели вариации (дисперсии и стандартное отклонение, вариация), Показатели связи риска: ковариация, коэффициент корреляции..

3.2. Тема 7. Оценка риска в условиях неопределённости

Критерии крайнего оптимизма (максимакса), Вальда (максимина), Сэвиджа (минимакса), Гурвица (оптимизма-пессимизма), Лапласа (принцип недостаточного основания). Методы оценки рисков: экспертный, моделирования, эконометрический. Система балльных оценок, весовых коэффициентов, значений показателей. Рейтинги и финансовые индексы: индексы Доу-Джонс, Стандарт энд Пурс, индекс BERI, рейтинг «Euromoney», «Credit Risk International». Рейтинг акций, облигаций, кредитные рейтинги. Мониторинг рейтинговых позиций. Роль рейтинговой оценки риска в принятии решений, рекомендации по использованию. Методы оценки конкретных видов рисков. Оценка рисков проекта, финансовых инструментов, инвестиционного портфеля. Сравнительные, матричные методы в оценке страновых рисков..

3.3. Тема 8 Основы снижения рисков

Способ управления ими. Общая характеристика методов снижения риска и направлений действий по снижению риска в деятельности предприятия..

4. Способы управления рисками

4.1. Тема 9. Методы управления рисками

Техника внешнего хеджирования рисков: передача (трансфер) риска банку, фактору, форфейтору. Кросс-секторные инвестиции. Факторинговые операции, использование переводных векселей в управлении коммерческим риском. Передача риска страховой компании. Покрытие риска в рамках существующих систем страховой ответственности. Деятельность международных и национальных агентств по страхованию иностранных инвестиций в различных странах. Передача риска государству через гос. гарантии. Покрытие рисков кредитных операций..

4.2. Тема 10. Учет рисков в управлении

Методы управления конкретными видами рисков по секторам (производственный, банковский, инвестиционный, страховой, международный и др.). Методы управления политическими рисками в международном инвестировании. ГЭП-анализ и управление разрывами. Активы и пассивы, чувствительные к изменениям процентной ставки. Процентный риск и риск несбалансированной ликвидности. Структурное управление ГЭПом. Методы снижения рисков потери финансовой устойчивости предприятия. Методы снижения рисков персонала. Методы защиты от «недружественного» поглощения..

3.3. Темы практических занятий

1. Информационные системы поддержки принятия решений в риск-менеджменте.;
2. Методы измерения и оценки предпринимательских рисков. Что называется «кривой риска».;
3. Методы оценивания и измерения рисков, моделирование рисков (ожидаемое значение, отклонение, дисперсия, среднее квадратичное отклонение, размах вариации.;
4. Методы оценки конкретных видов рисков: оценка риска инвестиционных проектов, оценка риска потери финансовой устойчивости, оценка рисков корпоративного управления, оценка рисков кредитоспособности российских банковских заемщиков.;
5. Методы оценки риска персонала.;

6. Распорядительство и контроль риска.;
7. Решение задач и деловых ситуаций.;
8. Способы снижения предпринимательских рисков.;
9. Методы уклонения и принятия риска. Лимитирование рисков.;
10. Методы оценки риска банкротства.;
11. Планирование и организация риск-менеджмента.;
12. Управление предпринимательскими рисками (технология риск-менеджмента), компоненты системы управления рисками.;
13. Разработка программы действий по снижению риска: последовательность стадий, анализ и прогнозирование риска.;
14. Структуризация рисков, определяемых видом предпринимательской деятельности. Составление карты риска предприятия методом причинно-следственной диаграммы рисков К. Исикавы.;
15. Виды основных рисков и их характеристика.;
16. Классификация, виды и характеристика предпринимательских рисков.;
17. Влияние рисков на комплексную безопасность хозяйствующего субъекта.;
18. Причины и функции рисков.;
19. Риск и неопределённость, риск и предпринимательство, риск и доходность. Какова природа и виды неопределенности.;
20. Страхование рисков – передача и хеджирование рисков.;
21. Методы снижения рисков договорных отношений, потери финансовой устойчивости, персонала.;
22. Методы компенсации и диверсификации рисков.;
23. Принятие решения по рискам. Эвристические правила риск-менеджмента.;
24. Теоретические основы предпринимательских рисков..

3.4. Темы лабораторных работ

не предусмотрено

3.5 Консультации

Текущий контроль (ТК)

1. Консультации направлены на получение индивидуального задания для выполнения контрольных мероприятий по разделу "Понятие риска, его основные элементы и черты"
2. Консультации направлены на получение индивидуального задания для выполнения контрольных мероприятий по разделу "Теория управления рисками"
3. Консультации направлены на получение индивидуального задания для выполнения контрольных мероприятий по разделу "Теория и практика оценки и снижения предпринимательских рисков"
4. Консультации направлены на получение индивидуального задания для выполнения контрольных мероприятий по разделу "Способы управления рисками"

3.6 Тематика курсовых проектов/курсовых работ

7 Семестр

Курсовая работа (КР)

Темы:

- 1.Предложения по внедрению методов управление процентными рисками на примере ООО «Наименование»
- 2.Создание системы управления кредитными рисками ООО «Наименование»
- 3.Реинжиниринг управление финансовыми рисками ООО «Наименование»
- 4.Оценка рисков в управлении при переходе к цифровой экономике
- 5.Управление

коммерческими рисками ООО «Наименование» 6.Управление инвестиционными рисками
 ООО «Наименование» 7.Методы оценки суммарных рисков ООО «Наименование»
 8.Предложения по использованию финансовых рычагов в оценке суммарного риска 9.Оценка
 финансовых рисков ООО «Наименование» 10.Оценка страхового риска ООО
 «Наименование» 11.Оценка предпринимательских рисков ООО «Наименование»
 12.Предложения по минимизации рыночных рисков ООО «Наименование» 13.Оценка
 социально-политических рисков предприятия, занимающегося внешнеторговой
 деятельностью 14.Предложения по минимизации фискально-монетарных рисков ООО
 «Наименование» 15.Расчет риски развития ООО «Наименование»

График выполнения курсового проекта

| Неделя | 1 - 4 | 5 - 8 | 9 - 12 | 13 - 15 | Зачетная |
|---|-------|-------|--------|---------|--------------------------|
| Раздел курсового проекта | 1 | 2 | 3 | 4 | Защита курсового проекта |
| Объем раздела, % | 20 | 20 | 30 | 30 | - |
| Выполненный объем нарастающим итогом, % | 20 | 40 | 70 | 100 | - |

| Номер раздела | Раздел курсового проекта |
|---------------|--|
| 1 | Понятие риска, его основные элементы и черты |
| 2 | Теория управления рисками |
| 3 | Теория и практика оценки и снижения предпринимательских рисков |
| 4 | Способы управления рисками |

3.7. Соответствие разделов дисциплины и формируемых в них компетенций

| Запланированные результаты обучения по дисциплине (в соответствии с разделом 1) | Коды индикаторов | Номер раздела дисциплины (в соответствии с п.3.1) | | | | Оценочное средство (тип и наименование) |
|--|---------------------|---|---|---|---|--|
| | | 1 | 2 | 3 | 4 | |
| Знать: | | | | | | |
| методы анализа и оценки рисков | ИД-1ПК-1 | + | | + | + | Тестирование/КМ-1 |
| классификацию и структуризацию рисков для организаций | ИД-1ПК-1 | + | + | + | | Тестирование/КМ-1 |
| методы мониторинга рисков | ИД-2ПК-1 | + | + | | | Контрольная работа/КМ-2 |
| пути минимизации рисков, влияющих на экономические процессы | ИД-2ПК-1 | | + | + | + | Контрольная работа/КМ-3 |
| особенности представления материалов, связанных с управлением рисками | ИД-3ПК-1 | | | + | + | Контрольная работа/КМ-3 |
| нормативно-правовое регулирование рисков, роль государства в управлении рисками | ИД-3ПК-1 | | + | + | | Контрольная работа/КМ-2 |
| методы управления экономиками процессами | ИД-4ПК-1 | | | + | + | Контрольная работа/КМ-4 |
| требования к документообороту | ИД-4ПК-1 | | | + | | Контрольная работа/КМ-4 |
| Уметь: | | | | | | |
| документировать процесс управления рисками | ИД-1ПК-1 | | | + | + | Контрольная работа/КМ-4 |
| принимать оптимальные решения по минимизации потерь и ущерба | ИД-1ПК-1 | | | + | + | Контрольная работа/КМ-3 |
| обрабатывать полученные данные | ИД-2ПК-1 | + | + | | | Контрольная работа/КМ-2 |
| проводить анализ и управлять экономическими рисками | ИД-2ПК-1 | + | | | | Контрольная работа/КМ-2 |
| проводить оценку последствиям воздействия угроз экономической безопасности | ИД-3ПК-1 | + | | + | | Контрольная работа/КМ-3 |
| выполнять мониторинг рисков для конкретной организации | ИД-3ПК-1 | | + | + | + | Тестирование/КМ-1 |
| используя стандарты создать систему мониторинга рисков | ИД-4ПК-1 | | + | + | + | Тестирование/КМ-1 |
| собирать, обрабатывать и хранить документы, связанные с управлением рисками | ИД-4ПК-1 | | + | + | | Контрольная работа/КМ-4 |

4. КОМПЕТЕНТНОСТНО-ОРИЕНТИРОВАННЫЕ ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ КОНТРОЛЯ ОСВОЕНИЯ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (ТЕКУЩИЙ КОНТРОЛЬ УСПЕВАЕМОСТИ, ПРОМЕЖУТОЧНАЯ АТТЕСТАЦИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ)

4.1. Текущий контроль успеваемости

7 семестр

Форма реализации: Компьютерное задание

1. КМ-1 (Тестирование)
2. КМ-2 (Контрольная работа)
3. КМ-3 (Контрольная работа)
4. КМ-4 (Контрольная работа)

Балльно-рейтинговая структура дисциплины является приложением А.

Балльно-рейтинговая структура курсовой работы является приложением Б.

4.2 Промежуточная аттестация по дисциплине

Экзамен (Семестр №7)

Оценка определяется в соответствии с Положением о балльно-рейтинговой системе для студентов НИУ «МЭИ» на основании семестровой и экзаменационной составляющих.

Курсовая работа (КР) (Семестр №7)

Итог за курс

В диплом выставляется оценка за 7 семестр.

Примечание: Оценочные материалы по дисциплине приведены в фонде оценочных материалов ОПОП.

5. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

5.1 Печатные и электронные издания:

1. Аленичев, В. В. Страхование валютных рисков, банковских и экспортных коммерческих кредитов / В. В. Аленичев, Т. Д. Аленичева. – М. : Ист-Сервис, 1994. – 111 с. : 6500.00. ;
2. Анализ и оценка риска производственной деятельности : учебное пособие для вузов по направлениям и специальностям высшего профессионального образования в области техники и технологии / П. П. Кукин, и др. – М. : Высшая школа, 2007. – 328 с. - ISBN 978-5-06-005358-6. ;
3. Антонов, Г. Д. Управление рисками организации : учебник для вузов по направлению 38.03.02 "Менеджмент" (профиль "Производственный менеджмент"), по магистерской программе "Производственный менеджмент", а также для технологических направлений и специальностей в части экономико-организационной и управленческой подготовки / Г. Д. Антонов, О. П. Иванова, В. М. Тумин. – М. : ИНФРА-М, 2018. – 152 с. – (Высшее образование. Бакалавриат). - ISBN 978-5-16-013060-6. ;
4. Бабаскин, С. Я. Инновационный проект: методы отбора и инструменты анализа рисков : учебное пособие / С. Я. Бабаскин, Акад. нар. хоз-ва при Правительстве РФ. – М. : Дело, 2009. – 240 с. – (Образовательные инновации). - ISBN 978-5-7749-0533-1. ;
5. Воробьев, С. Н. Управление рисками в предпринимательстве / С. Н. Воробьев, К. В. Балдин. – М. : Дашков и К, 2006. – 772 с. - ISBN 5-947985-33-0. ;
6. Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры вузов по экономическим направлениям и специальностям / А. В.

- Воронцовский, С.-Петерб. гос. ун-т . – М. : Юрайт, 2016 . – 414 с. – (Бакалавр. Академический курс) .;
7. Джилад, Б. Конкурентная разведка. Как распознавать внешние риски и управлять ситуацией : пер. с англ. / Б. Джилад . – СПб. : Питер, 2010 . – 320 с. – (Практика менеджмента) . - ISBN 978-5-49807-304-0 .;
8. Интернет-технологии в банковском бизнесе: перспективы и риски : учебно-практическое пособие / Ю. Н. Юденков, и др. – М. : КноРус, 2010 . – 320 с. - ISBN 978-5-406-00054-0 .;
9. Кричевский, М. Л. Финансовые риски : учебное пособие по специальности "Финансы и кредит" / М. Л. Кричевский . – 2-е изд. стер . – М. : КноРус, 2013 . – 248 с. – (Бакалавриат) . - ISBN 978-5-406-02758-5 .;
10. Мамаева, Л. Н. Управление рисками : учебное пособие / Л. Н. Мамаева . – 2-е изд . – М. : Дашков и К, 2013 . – 256 с. - ISBN 978-5-394-02208-1 .;
11. Минзов, А. С. Управление рисками информационной безопасности : [монография] / А. С. Минзов, А. Ю. Невский, О. Р. Баронов ; ред. А. С. Минзов ; Нац. исслед. ун-т "МЭИ" (НИУ"МЭИ"), Инженерно-экономич. ин-т национального исслед. ун-та "МЭИ", Кафедра "Безопасности и Информационных Технологий" (БИТ) . – Москва : ВНИИгеосистем, 2019 . – 106 с. - ISBN 978-5-8481-0240-6 .;
12. Смоляк, С. А. Оценка эффективности инвестиционных проектов в условиях риска и неопределенности. Теория ожидаемого эффекта / С. А. Смоляк, Центр. экономико-математический ин-т Рос. акад. наук . – М. : Наука, 2002 . – 182 с. - ISBN 5-02-006175-1 .;
13. А. А. Арямов- "Общая теория риска (юридический, экономический и психологический анализ)", Издательство: "Российская академия правосудия", Москва, 2009 - (172 с.)
<https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=142638>;
14. А. Г. Бадалова, В. Г. Ларионов, Г. В. Ларионов, К. П. Москвитин, Н. В. Сироткина- "Страховое дело и инструменты страховой защиты в риск-менеджменте", Издательство: "Дашков и К°", Москва, 2016 - (135 с.)
<https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=452903>;
15. А. И. Леонтьев- "Риски функционирования и развития рынка жилья бизнес-класса крупнейшего города: выпускная квалификационная работа (магистратура)", Издательство: "б.и.", Екатеринбург, 2019 - (147 с.)
<https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=563503>;
16. А. С. Дегтярев- "Управление рисками и доходностью портфельных инвестиций", Издательство: "Лаборатория книги", Москва, 2012 - (136 с.)
<https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=142712>;
17. Ж. Ю. Петухова- "Управление финансовыми рисками в строительных организациях: выпускная квалификационная работа", Омск, 2017 - (77 с.)
<https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=462783>.

5.2 Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение:

1. СДО "Прометей";
2. Office / Российский пакет офисных программ;
3. Windows / Операционная система семейства Linux;
4. Майнд Видеоконференции;
5. Госзаказ;
6. Visual Studio;
7. Scilab;
8. MySQL;
9. Libre Office.

5.3 Интернет-ресурсы, включая профессиональные базы данных и информационно-справочные системы:

1. ЭБС Лань - <https://e.lanbook.com/>
2. ЭБС "Университетская библиотека онлайн" - http://biblioclub.ru/index.php?page=main_ub_red
3. Научная электронная библиотека - <https://elibrary.ru/>
4. База данных ВИНТИ online - <http://www.viniti.ru/>
5. База данных журналов издательства Elsevier - <https://www.sciencedirect.com/>
6. ЭБС "Консультант студента" - <http://www.studentlibrary.ru/>
7. Патентная база Orbit Intelligence компании Questel - <https://www.orbit.com/>
8. Электронная библиотека МЭИ (ЭБ МЭИ) - <http://elib.mpei.ru/login.php>
9. База открытых данных профессиональных стандартов Министерства труда и социальной защиты РФ - <http://profstandart.rosmintrud.ru/obshchiy-informatsionnyy-blok/natsionalnyy-reestr-professionalnykh-standartov/>
10. Национальный портал онлайн обучения «Открытое образование» - <https://openedu.ru>
11. Официальный сайт Федеральной службы по надзору в сфере образования и науки - <https://obrnadzor>
12. Федеральный портал "Российское образование" - <http://www.edu.ru>

6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

| Тип помещения | Номер аудитории, наименование | Оснащение |
|---|--|--|
| Учебные аудитории для проведения лекционных занятий и текущего контроля | М-510, Учебная лаборатория информационно-аналитический технологий - компьютерный класс | стул, стол письменный, мультимедийный проектор, экран, доска маркерная, компьютер персональный, кондиционер |
| | К-601, Учебная аудитория | парта со скамьей, стол преподавателя, стул, трибуна, доска меловая, мультимедийный проектор, экран |
| Учебные аудитории для проведения практических занятий, КР и КП | М-510, Учебная лаборатория информационно-аналитический технологий - компьютерный класс | стул, стол письменный, мультимедийный проектор, экран, доска маркерная, компьютер персональный, кондиционер |
| Учебные аудитории для проведения промежуточной аттестации | М-510, Учебная лаборатория информационно-аналитический технологий - компьютерный класс | стул, стол письменный, мультимедийный проектор, экран, доска маркерная, компьютер персональный, кондиционер |
| | Ж-120, Машинный зал ИВЦ | сервер, кондиционер |
| Помещения для самостоятельной работы | НТБ-303, Компьютерный читальный зал | стол компьютерный, стул, стол письменный, вешалка для одежды, компьютерная сеть с выходом в Интернет, компьютер персональный, принтер, кондиционер |
| | К-307, Учебная лаборатория "Открытое | стол преподавателя, стол компьютерный, стол учебный, стул, |

| | | |
|--|--|---|
| | программное обеспечение" | вешалка для одежды, тумба, компьютерная сеть с выходом в Интернет, мультимедийный проектор, экран, доска маркерная, сервер, компьютер персональный, кондиционер |
| | К-302, Учебная лаборатория "Информационно-аналитические технологии" | стол преподавателя, стол компьютерный, стул, мультимедийный проектор, экран, доска маркерная, сервер, компьютер персональный, кондиционер |
| Помещения для консультирования | М-510, Учебная лаборатория информационно-аналитический технологий - компьютерный класс | стул, стол письменный, мультимедийный проектор, экран, доска маркерная, компьютер персональный, кондиционер |
| Помещения для хранения оборудования и учебного инвентаря | К-202/2, Склад кафедры БИТ | стеллаж для хранения инвентаря, стол, стул, шкаф для документов, шкаф для хранения инвентаря, тумба, запасные комплектующие для оборудования |

БАЛЛЬНО-РЕЙТИНГОВАЯ СТРУКТУРА ДИСЦИПЛИНЫ

Управление экономическими рисками

(название дисциплины)

7 семестр

Перечень контрольных мероприятий текущего контроля успеваемости по дисциплине:

КМ-1 КМ-1 (Тестирование)

КМ-2 КМ-2 (Контрольная работа)

КМ-3 КМ-3 (Контрольная работа)

КМ-4 КМ-4 (Контрольная работа)

Вид промежуточной аттестации – Экзамен.

| Номер раздела | Раздел дисциплины | Индекс КМ: | КМ-1 | КМ-2 | КМ-3 | КМ-4 |
|---------------|--|------------|------|------|------|------|
| | | Неделя КМ: | 4 | 8 | 12 | 15 |
| 1 | Понятие риска, его основные элементы и черты | | | | | |
| 1.1 | Тема 1. Введение в проблематику риска. | | + | + | | |
| 1.2 | Тема 2. Современные теории риска. | | + | + | | |
| 1.3 | Тема 3. Основы классификации рисков | | | + | + | |
| 2 | Теория управления рисками | | | | | |
| 2.1 | Тема 4 Риски по сфере деятельности | | + | + | + | |
| 2.2 | Тема 5. Понятие управления рисками | | + | + | | + |
| 3 | Теория и практика оценки и снижения предпринимательских рисков | | | | | |
| 3.1 | Тема 6. Понятие оценки рисков. | | + | | + | + |
| 3.2 | Тема 7. Оценка риска в условиях неопределённости | | + | + | + | + |
| 3.3 | Тема 8 Основы снижения рисков | | | | + | + |
| 4 | Способы управления рисками | | | | | |
| 4.1 | Тема 9. Методы управления рисками | | + | | + | + |
| 4.2 | Тема 10. Учет рисков в управлении | | | | + | |
| Вес КМ, %: | | | 20 | 20 | 30 | 30 |

БАЛЛЬНО-РЕЙТИНГОВАЯ СТРУКТУРА КУРСОВОГО ПРОЕКТА/РАБОТЫ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Управление экономическими рисками

(название дисциплины)

7 семестр

Перечень контрольных мероприятий текущего контроля успеваемости по курсовой работе:

КМ-1 КМ-1-Тест. «Термины. Понятие и природа риска»

КМ-2 КМ-2-Контрольное задание №1

КМ-3 КМ-3-Контрольное задание №2

КМ-4 КМ-4-Деловая игра №1

Вид промежуточной аттестации – защита КР.

| Номер раздела | Раздел курсового проекта/курсовой работы | Индекс КМ: | КМ-1 | КМ-2 | КМ-3 | КМ-4 |
|---------------|--|------------|------|------|------|------|
| | | Неделя КМ: | 4 | 8 | 12 | 15 |
| 1 | Понятие риска, его основные элементы и черты | | + | | | |
| 2 | Теория управления рисками | | | + | | |
| 3 | Теория и практика оценки и снижения предпринимательских рисков | | | | + | |
| 4 | Способы управления рисками | | | | | + |
| Вес КМ, %: | | | 20 | 20 | 30 | 30 |