

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

Направление подготовки/специальность: 38.03.02 Менеджмент

Наименование образовательной программы: Финансовый менеджмент

Уровень образования: высшее образование - бакалавриат

Форма обучения: Заочная

Рабочая программа дисциплины
УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ

| | |
|---|--|
| Блок: | Блок 1 «Дисциплины (модули)» |
| Часть образовательной программы: | Вариативная |
| № дисциплины по учебному плану: | Б1.В.11.06.01 |
| Трудоемкость в зачетных единицах: | 6 семестр - 4; |
| Часов (всего) по учебному плану: | 144 часа |
| Лекции | 6 семестр - 12 часов; |
| Практические занятия | 6 семестр - 12 часов; |
| Лабораторные работы | не предусмотрено учебным планом |
| Консультации | проводится в рамках часов аудиторных занятий |
| Самостоятельная работа | 6 семестр - 119,7 часов; |
| в том числе на КП/КР | не предусмотрено учебным планом |
| Иная контактная работа | проводится в рамках часов аудиторных занятий |
| включая: Тестирование Домашнее задание | |
| Промежуточная аттестация: | |
| Зачет с оценкой | 6 семестр - 0,3 часа; |

Москва 2020

ПРОГРАММУ СОСТАВИЛ:

Преподаватель

(должность)

| | | |
|--|--|-------------------------------|
| | Подписано электронной подписью ФГБОУ ВО «НИУ «МЭИ» | |
| | Сведения о владельце ЦЭП МЭИ | |
| | Владелец | Бадалова А.Г. |
| | Идентификатор | R590a803a-BadalovaAG-a6343ac5 |

(подпись)

А.Г. Бадалова

(расшифровка
подписи)

СОГЛАСОВАНО:

Руководитель
образовательной программы

(должность, ученая степень, ученое звание)

| | | |
|--|--|--------------------------------|
| | Подписано электронной подписью ФГБОУ ВО «НИУ «МЭИ» | |
| | Сведения о владельце ЦЭП МЭИ | |
| | Владелец | Епифанов В.А. |
| | Идентификатор | Rad930396-YepifanovVA-60810d9c |

(подпись)

В.А. Епифанов

(расшифровка
подписи)

Заведующий выпускающей
кафедры

(должность, ученая степень, ученое звание)

| | | |
|--|--|-------------------------------|
| | Подписано электронной подписью ФГБОУ ВО «НИУ «МЭИ» | |
| | Сведения о владельце ЦЭП МЭИ | |
| | Владелец | Кетоева Н.Л. |
| | Идентификатор | R56dba1ba-KetoyevaNL-5403d8c5 |

(подпись)

Н.Л. Кетоева

(расшифровка
подписи)

1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель освоения дисциплины: Приобретение студентами теоретических знаний в области управления рисками и формирование компетенций, позволяющих принимать эффективные управленческие решения с учетом риска

Задачи дисциплины

- обучение основам управления рисками, методам выявления и оценки рисков, способам управления рисками, организации риск-менеджмента в организации;
- обучение особенностям принятия управленческих решений в условиях риска и неопределенности;
- формирование навыков анализа условий осуществления хозяйственной 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-5 способностью анализировать взаимосвязи между функциональными стратегиями компаний с целью подготовки сбалансированных управленческих решений | | знать: - инструменты анализа существующих методов контроля и управления рисками; инструменты анализа последствий рисков. уметь: - применять инструменты анализа существующих методов контроля и управления рисками; инструменты анализа последствий рисков. |

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ ВО

Дисциплина относится к части, формируемой участниками образовательных отношений блока дисциплин основной профессиональной образовательной программе Финансовый менеджмент (далее – ОПОП), направления подготовки 38.03.02 Менеджмент, 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 4 зачетных единицы, 144 часа.

| № 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 | Характеристика риска как объекта управления. Классификация рисков | 48 | 6 | 4 | - | 4 | - | - | - | - | - | 40 | - | <u>Самостоятельное изучение теоретического материала:</u> Изучение дополнительного материала по разделу "Характеристика риска как объекта управления. Классификация рисков" | |
| 1.1 | Характеристика риска | 24 | | 2 | - | 2 | - | - | - | - | - | 20 | - | | <u>Изучение материалов литературных источников:</u> [3], 15-47 |
| 1.2 | Классификация рисков | 24 | | 2 | - | 2 | - | - | - | - | - | 20 | - | | |
| 2 | Методы оценки рисков | 24 | | 2 | - | 2 | - | - | - | - | - | 20 | - | <u>Подготовка к текущему контролю:</u> Повторение материала по разделу "Методы оценки рисков" | |
| 2.1 | Методы выявления, оценки, прогнозирования и анализа рисков | 24 | | 2 | - | 2 | - | - | - | - | - | 20 | - | | <u>Изучение материалов литературных источников:</u> [1], 59-74 |
| 3 | Методы и инструменты управленческого воздействия на риски | 54 | | 6 | - | 6 | - | - | - | - | - | 42 | - | <u>Подготовка к контрольной работе:</u> Изучение материалов по разделу Методы и инструменты управленческого воздействия на риски и подготовка к контрольной работе | |
| 3.1 | Методы управления и воздействия на риски | 27 | | 3 | - | 3 | - | - | - | - | - | 21 | - | | <u>Самостоятельное изучение теоретического материала:</u> Изучение дополнительного материала по разделу "Методы и инструменты управленческого воздействия на риски" |
| 3.2 | Инструменты при управлении рисками предприятия | 27 | | 3 | - | 3 | - | - | - | - | - | 21 | - | | <u>Изучение материалов литературных источников:</u> [2], 98-121 |
| | Зачет с оценкой | 18.0 | | - | - | - | - | - | - | - | 0.3 | - | 17.7 | | |

| | | | | | | | | | | | | | | |
|--|-------------------------|--------------|--|-----------|----------|-----------|----------|----------|----------|----------|------------|------------|-------------|--|
| | Всего за семестр | 144.0 | | 12 | - | 12 | - | - | - | - | 0.3 | 102 | 17.7 | |
| | Итого за семестр | 144.0 | | 12 | - | 12 | - | - | - | - | 0.3 | 102 | 17.7 | |

Примечание: Лек – лекции; Лаб – лабораторные работы; Пр – практические занятия; КПр – 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. Характеристика риска как объекта управления. Классификация рисков

1.1. Характеристика риска

Основные цели и задачи риск - менеджмента. Риск и неопределенность..

1.2. Классификация рисков

Виды рисков. Система управления рисками на предприятии.

2. Методы оценки рисков

2.1. Методы выявления, оценки, прогнозирования и анализа рисков

Методы выявления, оценки, прогнозирования и анализа рисков.

3. Методы и инструменты управленческого воздействия на риски

3.1. Методы управления и воздействия на риски

Методы управления и воздействия на риски.

3.2. Инструменты при управлении рисками предприятия

Инструменты и механизм страховой защиты при управлении рисками предприятия.

3.3. Темы практических занятий

1. Функция управления риском;
2. Введение в риск-менеджмент;
3. Основные подходы к классификации рисков;
4. Стратегические риски;
5. Операционные риски организации;
6. Финансовые риски;
7. Природные и экологические риски;
8. Риски, связанные с человеческим фактором;
9. Диагностика и картографирование рисков;
10. Основные методы оценки рисков;
11. Методы (способы) управления рисками;
12. Неопределенность и риск.

3.4. Темы лабораторных работ

не предусмотрено

3.5 Консультации

3.6 Тематика курсовых проектов/курсовых работ

Курсовой проект/ работа не предусмотрены

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 | |
| Знать: | | | | | |
| инструменты анализа существующих методов контроля и управления рисками; инструменты анализа последствий рисков | ПК-5(Компетенция) | + | | | Домашнее задание/Классификация рисков Тестирование/Основные подходы к классификации рисков Тестирование/Теоретические основы классификации рисков |
| Уметь: | | | | | |
| применять инструменты анализа существующих методов контроля и управления рисками; инструменты анализа последствий рисков | ПК-5(Компетенция) | | + | + | Тестирование/Внутренние риски: методика анализа Домашнее задание/Классификация рисков |

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

4.1. Текущий контроль успеваемости

6 семестр

Форма реализации: Выступление (доклад)

1. Классификация рисков (Домашнее задание)

Форма реализации: Письменная работа

1. Внутренние риски: методика анализа (Тестирование)
2. Основные подходы к классификации рисков (Тестирование)
3. Теоретические основы классификации рисков (Тестирование)

Балльно-рейтинговая структура дисциплины является приложением А.

4.2 Промежуточная аттестация по дисциплине

Зачет с оценкой (Семестр №6)

Среднее арифметическое между оценками за текущий контроль и промежуточной аттестацией

В диплом выставляется оценка за 6 семестр.

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

5. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

5.1 Печатные и электронные издания:

1. Васин, С. М. Управление рисками на предприятии : учебное пособие по специальности "Менеджмент организации" / С. М. Васин, В. Шутов . – М. : КноРус, 2015 . – 300 с. - ISBN 978-5-406-04372-1 .;
2. 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 .;
3. А. А. Киселев- "Риск-менеджмент в управлении организациями: учебник для бакалавриата", Издательство: "Директ-Медиа", Москва, Берлин, 2019 - (173 с.) <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=575459>.

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.

5.3 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. Национальная электронная библиотека - <https://rusneb.ru/>
5. ЭБС "Консультант студента" - <http://www.studentlibrary.ru/>

6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

| Тип помещения | Номер аудитории, наименование | Оснащение |
|---|---|--|
| Учебные аудитории для проведения лекционных занятий и текущего контроля | К-520, Аудитория для проведения интерактивных занятий кафедры МЭП | кресло рабочее, парта со скамьей, стол преподавателя, стул, трибуна, вешалка для одежды, доска меловая, компьютерная сеть с выходом в Интернет, мультимедийный проектор, экран, кондиционер, мел, маркер, стилус |
| Учебные аудитории для проведения практических занятий, КР и КП | К-511, Аудитория для проведения интерактивных занятий кафедры МЭП | парта со скамьей, стул, трибуна, вешалка для одежды, доска меловая, компьютерная сеть с выходом в Интернет, мультимедийный проектор, экран, кондиционер, мел, маркер, стилус |
| Учебные аудитории для проведения промежуточной аттестации | К-509, Аудитория для проведения интерактивных занятий кафедры МЭП | кресло рабочее, парта со скамьей, стол преподавателя, стул, трибуна, вешалка для одежды, доска меловая, компьютерная сеть с выходом в Интернет, мультимедийный проектор, экран, кондиционер, мел, маркер, стилус |
| Помещения для самостоятельной работы | К-526, Компьютерный класс ИВЦ | стол, стул, компьютерная сеть с выходом в Интернет, мультимедийный проектор, доска маркерная, компьютер персональный, кондиционер |
| | К-522, Компьютерный класс ИВЦ | стол, стул, компьютерная сеть с выходом в Интернет, доска маркерная, компьютер персональный, кондиционер, телевизор |
| Помещения для консультирования | К-507, Учебная аудитория | парта со скамьей, стул, трибуна, вешалка для одежды, доска меловая, мультимедийный проектор, экран, кондиционер |
| | К-516, Кабинет сотрудников кафедры МЭП | кресло рабочее, рабочее место сотрудника, стол, стул, шкаф для документов, шкаф для одежды, тумба, компьютерная сеть с выходом в Интернет, многофункциональный центр, ноутбук, компьютер персональный, принтер, холодильник, кондиционер |
| | К-514, Кабинет сотрудников кафедры МЭП | кресло рабочее, рабочее место сотрудника, стол, стул, шкаф для документов, шкаф для одежды, тумба, компьютерная сеть с выходом в Интернет, колонки звуковые, многофункциональный центр, компьютер персональный, принтер, кондиционер |
| | К-513, Кабинет | кресло рабочее, рабочее место сотрудника, |

| | | |
|--|--|---|
| | сотрудников кафедры МЭП | стол, стул, шкаф для документов, шкаф для одежды, тумба, компьютерная сеть с выходом в Интернет, экран интерактивный, колонки звуковые, мультимедийный проектор, доска маркерная, многофункциональный центр, ноутбук, компьютер персональный, принтер, холодильник, кондиционер |
| | К-518, Кабинет сотрудников кафедры МЭП | кресло рабочее, рабочее место сотрудника, стол, стул, шкаф для документов, шкаф для одежды, тумба, компьютерная сеть с выходом в Интернет, колонки звуковые, доска маркерная, многофункциональный центр, ноутбук, компьютер персональный, принтер, кондиционер |
| Помещения для хранения оборудования и учебного инвентаря | К-521/2, Склад кафедры БИТ | шкаф, хозяйственный инвентарь, запасные комплектующие для оборудования |

БАЛЛЬНО-РЕЙТИНГОВАЯ СТРУКТУРА ДИСЦИПЛИНЫ

Управление рисками

(название дисциплины)

6 семестр

Перечень контрольных мероприятий текущего контроля успеваемости по дисциплине:

- КМ-1 Основные подходы к классификации рисков (Тестирование)
 КМ-2 Теоретические основы классификации рисков (Тестирование)
 КМ-3 Внутренние риски: методика анализа (Тестирование)
 КМ-4 Классификация рисков (Домашнее задание)

Вид промежуточной аттестации – Зачет с оценкой.

| Номер раздела | Раздел дисциплины | Индекс КМ: | КМ-1 | КМ-2 | КМ-3 | КМ-4 |
|---------------|--|------------|------|------|------|------|
| | | Неделя КМ: | 4 | 8 | 12 | 14 |
| 1 | Характеристика риска как объекта управления. Классификация рисков | | | | | |
| 1.1 | Характеристика риска | | + | + | | + |
| 1.2 | Классификация рисков | | + | + | | + |
| 2 | Методы оценки рисков | | | | | |
| 2.1 | Методы выявления, оценки, прогнозирования и анализа рисков | | | | + | + |
| 3 | Методы и инструменты управленческого воздействия на риски | | | | | |
| 3.1 | Методы управления и воздействия на риски | | | | + | + |
| 3.2 | Инструменты при управлении рисками предприятия | | | | + | + |
| Вес КМ, %: | | | 25 | 25 | 25 | 25 |