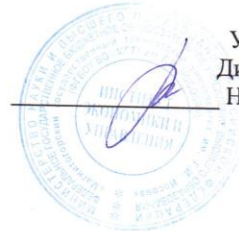




МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Магнитогорский государственный технический университет им. Г.И. Носова»



УТВЕРЖДАЮ  
Директор ИЭУ  
Н.Р. Балынская

21.02.2020 г.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

***ТЕХНОЛОГИЯ И ИНСТРУМЕНТАРИЙ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ***

Направление подготовки (специальность)  
38.04.02 МЕНЕДЖМЕНТ

Направленность (профиль/специализация) программы  
Управление развитием компании

Уровень высшего образования - магистратура  
Программа подготовки - академический магистратура

Форма обучения  
заочная

Институт/ факультет	Институт экономики и управления
Кафедра	Менеджмента
Курс	2

Магнитогорск  
2019 год


Рабочая программа составлена на основе ФГОС ВО по направлению подготовки 38.04.02 МЕНЕДЖМЕНТ (уровень магистратуры) (приказ Минобрнауки России от 30.03.2015 г. № 322)

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры Менеджмента  
10.02.2020, протокол № 6

Зав. кафедрой  Д.Б. Симаков

Рабочая программа одобрена методической комиссией ИЭиУ  
21.02.2020 г. протокол № 3

Председатель  Н.Р. Бальнская

Рабочая программа составлена:  
профессор кафедры Менеджмента, д-р пед. наук  Е.В. Романов

Рецензент:  
директор ООО "БНЭО", канд. экон. наук  Ю.Н. Кондрух

---

**Лист актуализации рабочей программы**

---

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для реализации в 2020 - 2021 учебном году на заседании кафедры Менеджмента

Протокол от 03 09 2020 г. № 1  
Зав. кафедрой  Д.Б. Симаков

---

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для реализации в 2021 - 2022 учебном году на заседании кафедры Менеджмента

Протокол от \_\_\_\_\_ 20\_\_ г. № \_\_  
Зав. кафедрой \_\_\_\_\_ Д.Б. Симаков

---

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для реализации в 2022 - 2023 учебном году на заседании кафедры Менеджмента

Протокол от \_\_\_\_\_ 20\_\_ г. № \_\_  
Зав. кафедрой \_\_\_\_\_ Д.Б. Симаков

---

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для реализации в 2023 - 2024 учебном году на заседании кафедры Менеджмента

Протокол от \_\_\_\_\_ 20\_\_ г. № \_\_  
Зав. кафедрой \_\_\_\_\_ Д.Б. Симаков

### 1 Цели освоения дисциплины (модуля)

формирование представления о построении системы риск-менеджмента на современных предприятиях (организациях), способствовать приобретению навыков в использовании технологий и инструментария управления рисками при решении практических задач.

### 2 Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Дисциплина Технология и инструментарий управления рисками входит в вариативную часть учебного плана образовательной программы.

Для изучения дисциплины необходимы знания (умения, владения), сформированные в результате изучения дисциплин/ практик:

Управление знаниями

Управление изменениями

Экономика и управление компанией

Инвестирование развития бизнеса

Управление стоимостью бизнеса

Знания (умения, владения), полученные при изучении данной дисциплины будут необходимы для изучения дисциплин/практик:

Теория и практика бизнес-планирования

Принятие управленческих решений

Подготовка к защите и защита выпускной квалификационной работы

Управление эффективностью бизнесом

### 3 Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины (модуля) и планируемые результаты обучения

В результате освоения дисциплины (модуля) «Технология и инструментарий управления рисками» обучающийся должен обладать следующими компетенциями:

Структурный элемент компетенции	Планируемые результаты обучения
ПК-4 способностью использовать количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес-процессами, готовить аналитические материалы по результатам их применения	
Знать	- количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес процессами; - состав и структуру бизнес-процессов
Уметь	- формулировать типовые задачи в прикладных исследованиях; - обосновывать способы поиска эффективного решения; - рассчитывать количественные и качественные показатели
Владеть	- методами подготовки аналитических материалов
ПК-5 владением методами экономического и стратегического анализа поведения экономических агентов и рынков в глобальной среде	
Знать	- методики системного стратегического анализа; - области практической реализации результатов системного стратегического анализа

Уметь	<ul style="list-style-type: none"><li>- выбирать эффективные решения на основе результатов стратегического анализа;</li><li>- составлять программу позиционирования предприятия на рынке</li></ul>
Владеть	<ul style="list-style-type: none"><li>- методиками согласования результатов стратегического анализа с подходами по выбору стратегии организации;</li><li>- навыками определения направлений развития организации на основе согласования решений по результатам стратегического анализа, использования матриц стратегического выбора и подходами к выбору стратегий развития, конкуренции и действий</li></ul>



<p>1.1 Управление риском как отрасль знания. Логические и исторические предпосылки создания теории управления риском. Роль и место риска, как экономической категории. Сущность риска, основные элементы, причины возникновения. Объекты и субъекты риска. Общая классификация опасностей. Классификация рисков. Критерии классификации (по времени возникновения, по факторам возникновения, по характеру учета, по характеру последствий, по сфере возникновения). Краткая характеристика основных видов риска в различных сферах экономической деятельности. Основные принципы управления риском (избегание, снижение, принятие, отказ). Этапы процесса управления риском (выявление о оценка, сравнение методов воздействия на риск, выбор методов воздействия на риск). Склонность к риску. Что лежит в основе рискового поведения человека. Психологические факторы, определяющие поведение человека в условиях риска. Определение склонности к риску</p>	2			1	15	Работа с литературой и сетевыми ресурсами	Текущий контроль успеваемости	ПК-4, ПК-5
Итого по разделу				1	15			
2. Методы определения и оценки риска								





<p>3.1 Функции управления рисками руководителей высшего звена. Функции управления рисками в деятельности отдельных подразделений организации. Функции специализированного органа управления рисками. Меры риск-менеджмента. Структура программы управления рисками. Макет программы управления рисками и ее финансирование. Построение программы управления рисками. Разработка мер реагирования: избегание, снижение, принятие рисков. Способы управления рисками: организационный, финансовый, договорной подходы. Финансовый аспект управления риска-ми: коэффициентный анализ рисковой позиции фирмы. Выработка и принятие решений по стратегии управления рисками. Разработка механизмов минимизации и устранения рисков. Механизм финансирования рисков. До-событийное и послесобытийное финансирование. Затраты на риск.</p>	2			2/2И	15	Работа с литературой и сетевыми ресурсами; подготовка к защите контрольной работы	Текущий контроль успеваемости	ПК-4, ПК-5
Итого по разделу				2/2И	15			
4. Развитие моделей и методов управления риском								

<p>4.1 Формализация ситуации риска. Матрица решений, дерево решений, денежные потоки, сценарии, графы как способы формализации ситуации риска. Проблема построения функций отклика для отражения воздействия факторов риска на объект риска. Ожидаемое значение и среднеквадратичное отклонение как количественные меры риска. Интегральные меры риска.</p> <p>Формализация предпочтений субъекта при выборе рисконесущей альтернативы. Проблема выбора рисконесущей альтернативы. Функции ожидаемой полезности и функции рискового предпочтения. Выбор в условиях неопределенности.</p> <p>Способы формализации предпочтений субъекта в теории инвестиционных портфелей.</p> <p>Развитие способов оценки рисков: VaR, EaR, методы Risk Metrics и пр.</p> <p>Ограничение гипотез эффективного рынка. Рыночные и нерыночные риски. Учет рисков в современных портфельных теориях. Механизмы диверсификации и хеджирования: теория и практика.</p> <p>Способы построения профилей рисков для разных видов субъектов риска. Способы построения карт рисков и матриц принятия рискованных решений</p>	2		1	17	Работа с литературой и сетевыми ресурсами	Итоговый тест; Защита контрольной работы	ПК-4, ПК-5
Итого по разделу			1	17			
Итого за семестр			6/2И	62		зачёт	
Итого по дисциплине			6/2И	62		зачет	ПК-4,ПК-5

## 5 Образовательные технологии

Одной из задач в подготовке будущих магистров является подготовка компетентно-го, конкурентоспособного специалиста, способного к продуктивной профессиональной деятельности в условиях турбулентной внешней среды, умеющего применять полученные знания при решении широкого круга профессиональных задач. Подготовка магистра нацелена на совершенствование системообразующего умения – самостоятельно учиться, «добывать» новые знания и формирование «мягких» социальных навыков (умений сотрудничать и работать в команде и т.д.)

В связи с этим в учебном процессе помимо традиционных форм проведения занятий используются также активные и интерактивные формы.

Проектирование технологии преподавания дисциплины «Технология и инструментарий управления рисками» основывается на следующих принципах проектирования технологии обучения:

1. Сочетание фундаментального и прикладного характера знания, представленного в содержании обучения.

2. Оптимальное сочетание вербальных и невербальных средств представления информации на основе ее «сжатия» (свертывания).

3. Сочетание репродуктивных и продуктивных методов деятельности студентов на основе постепенного наращивания проблемности в обучении.

4. Соответствии форм обучения и организации учебного процесса содержанию и ведущему методу обучения.

5. Использование новых информационных технологий в обучении.

6. Повышение объективности оценки учебных достижений студентов на основе сочетания традиционных и тестовых методов контроля.

Для реализации компетентностного подхода предлагается интегрировать в учебный процесс интерактивные образовательные технологии, включая информационные и ком-муникационные технологии (ИКТ), при осуществлении различных видов учебной работы:

- педагогическую технологию «Обучение на ошибках», предполагающую использование в учебном процесса задач с ложной «установкой»;

- мониторинг (взаимное) обучение;

- учебную дискуссию;

- электронные средства обучения (слайд-практики, компьютерные тесты);

- дистанционные (сетевые) технологии.

Использование мониторинга (взаимного) обучения позволяет:

- актуализировать и обобщить имеющиеся у студента знания по теме или проблеме,

- вызвать устойчивый интерес к изучаемой теме, мотивировать обучающегося к по-лучению новой информации,

- побудить студента к активной аудиторной и внеаудиторной работе;

- Как для «обучаемого», так и для «обучающего» важным представляется этап «педагогической рефлексии», который ставит своей целью:

- целостное осмысление, обобщение полученной информации,

- присвоение нового знания, новой информации студентом,

- формирование у каждого студента собственного отношения к изучаемому материалу.

В этом контексте предполагается проведение дискуссий, привязанных к анализу существующего практического опыта различных организаций в управлении рисками на основе кейсов.

Для проведения контрольно-диагностических мероприятий предлагается использовать компьютерные контролирующие тесты. Средством, побуждающим к активному «добыванию» нового знания являются задания на самостоятельное

«конструирование» «батареи» тестов по курсу.

Текущий контроль знаний (рейтинг-контроль) осуществляется в виде тестирования или выполнения мини контрольных работ.

Таким образом, применение интерактивных образовательных технологий придает инновационный характер практически всем видам учебных занятий

## **6 Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающихся**

Представлено в приложении 1.

## **7 Оценочные средства для проведения промежуточной аттестации**

Представлены в приложении 2.

## **8 Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины (модуля)**

### **а) Основная литература:**

1. Пимонова, Т. К. Риск-менеджмент : учебное пособие / Т. К. Пимонова ; МГТУ. - Магнитогорск : МГТУ, 2017. - 59 с. : ил., табл., схемы. - URL: <https://magtu.informsystema.ru/uploader/fileUpload?name=3503.pdf&show=dcatalogues/1/1514316/3503.pdf&view=true> (дата обращения: 04.10.2019). - Макрообъект. - Текст : электронный. - Имеется печатный аналог.

2. Немцев, В. Н. Основы рискологии : учебно-методическое пособие [для вузов] / В. Н. Немцев, М. Г. Абилова ; МГТУ. - Магнитогорск : МГТУ, 2019. - 1 электрон. опт. диск (CD-ROM). - Загл. с титул. экрана. - URL: <https://magtu.informsystema.ru/uploader/fileUpload?name=3811.pdf&show=dcatalogues/1/1529978/3811.pdf&view=true> (дата обращения: 15.10.2019). - Макрообъект. - Текст : электронный. - Сведения доступны также на CD-ROM.

### **б) Дополнительная литература:**

1. Управление рисками и страхование : учебное пособие / В. Н. Немцев, С. Г. Журавин, А. В. Ивлев и др. ; МГТУ. - Магнитогорск : МГТУ, 2016. - 1 электрон. опт. диск (CD-ROM). - Загл. с титул. экрана. - URL: <https://magtu.informsystema.ru/uploader/fileUpload?name=2570.pdf&show=dcatalogues/1/1130376/2570.pdf&view=true> (дата обращения: 04.10.2019). - Макрообъект. - Текст : электронный. - Сведения доступны также на CD-ROM.

2. Пахалов, А. Риск-менеджмент. Дополнительные задачи. /А. Пахалов; МГУ им. М.В. Ломоносова.- М: МГУ им. М.В. Ломоносова, 2019. - URL: <https://www.econ.msu.ru/sys/raw.php?o=56119&p=attachment> (дата обращения: 04.10.2019). - Макрообъект. - Текст : электронный.

### **в) Методические указания:**

1. Вотчель, Л. М. Риски предпринимательской деятельности : практикум / Л. М. Вотчель, В. В. Викулина ; МГТУ. - Магнитогорск : МГТУ, 2019. - 1 электрон. опт. диск (CD-ROM). - Загл. с титул. экрана. - URL: <https://magtu.informsystema.ru/uploader/fileUpload?name=3810.pdf&show=dcatalogues/1/1529979/3810.pdf&view=true> (дата обращения: 15.10.2019). - Макрообъект. - Текст : электронный. - Сведения доступны также на CD-ROM.

2. Пимонова Т.К.. Риск-менеджмент [Текст]: практикум: учеб. пособие/Т.К.Пимонова – Магнитогорск: Изд-во Магнитогорск. гос. техн. ун-та им. Г.И. Носова, 2017. – 96 с.

### **г) Программное обеспечение и Интернет-ресурсы:**

### Программное обеспечение

Наименование ПО	№ договора	Срок действия лицензии
MS Windows 7 Professional(для классов)	Д-1227-18 от 08.10.2018	11.10.2021
MS Windows 7 Professional (для классов)	Д-757-17 от 27.06.2017	27.07.2018
MS Office 2007 Professional	№ 135 от 17.09.2007	бессрочно
Kaspersky Endpoint Security для бизнеса-Стандартный	Д-300-18 от 21.03.2018	28.01.2020
7Zip	свободно распространяемое ПО	бессрочно

### Профессиональные базы данных и информационные справочные системы

Название курса	Ссылка
Электронная база периодических изданий East View Information Services, ООО «ИВИС»	<a href="https://dlib.eastview.com/">https://dlib.eastview.com/</a>
Национальная информационно-аналитическая система – Российский индекс научного цитирования (РИНЦ)	URL: <a href="https://elibrary.ru/project_risc.asp">https://elibrary.ru/project_risc.asp</a>
Поисковая система Академия Google (Google Scholar)	URL: <a href="https://scholar.google.ru/">https://scholar.google.ru/</a>
Информационная система - Единое окно доступа к информационным ресурсам	URL: <a href="http://window.edu.ru/">http://window.edu.ru/</a>
Федеральное государственное бюджетное учреждение «Федеральный институт промышленной собственности»	URL: <a href="http://www1.fips.ru/">http://www1.fips.ru/</a>

### 9 Материально-техническое обеспечение дисциплины (модуля)

Материально-техническое обеспечение дисциплины включает:

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа:Мультимедийные средства хранения, передачи и представления информации.

Учебные аудитории для проведения практических занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации:Мультимедийные средства хранения, передачи и представления информации.

Комплекс тестовых заданий для проведения промежуточных и рубежных контролей.

Помещения для самостоятельной работы: обучающихся:Персональные компьютеры с пакетом MS Office, выходом в Интернет и с доступом в электронную информационно-образовательную среду университета

Помещения для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования:Шкафы для хранения учебно-методической документации, учебного оборудования и учебно-наглядных пособий.