



МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

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



УТВЕРЖДАЮ

Директор ИЭиУ

Е.С. Замбрицкая

13.02.2023 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

Форма обучения
заочная

Институт/ факультет	Институт экономики и управления
Кафедра	Менеджмента
Курс	2

Магнитогорск
2023 год

Рабочая программа составлена на основе ФГОС ВО - магистратура по направлению подготовки 38.04.02 Менеджмент (приказ Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 952)

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры Менеджмента 07.02.2023, протокол № 6

Зав. кафедрой  Ю.В. Литовская

Рабочая программа одобрена методической комиссией ИЭиУ 13.02.2023 г. протокол № 3

Председатель  Е.С. Замбрицкая

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 2024 - 2025 учебном году на заседании кафедры Менеджмента

Протокол от _____ 20__ г. № ____
Зав. кафедрой _____ Ю.В. Литовская

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для реализации в 2025 - 2026 учебном году на заседании кафедры Менеджмента

Протокол от _____ 20__ г. № ____
Зав. кафедрой _____ Ю.В. Литовская

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для реализации в 2026 - 2027 учебном году на заседании кафедры Менеджмента

Протокол от _____ 20__ г. № ____
Зав. кафедрой _____ Ю.В. Литовская

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 часть учебного плана формируемую участниками образовательных отношений образовательной программы.

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

Учебная - практика по получению первичных профессиональных умений и навыков

Стратегия устойчивого развития компании

Экономика организации

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

Производственная - научно-исследовательская работа

Управление стоимостью бизнеса

Управление эффективностью бизнеса

Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы

Производственная - преддипломная практика

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:

Код индикатора	Индикатор достижения компетенции
ПК-1	Способен осуществлять контроль в достижении запланированных финансовых и операционных показателей, эффективности использования персонала организации
ПК-1.1	Осуществляет планирование основных направлений внутреннего контроля и контрольных процедур в достижении запланированных основных показателей деятельности организации
ПК-1.2	Проводит оценку качества и обоснованности завершающих документов по результатам внутреннего контроля
ПК-1.3	Владеет способами и приемами оценка эффективности работы сотрудников в соответствии с утвержденными критериями

<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		1	22	Работа с литературой и сетевыми ресурсами	Текущий контроль успеваемости	ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3
Итого по разделу	1		1	22				
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	1		1/0,4И	23	Работа с литературой и сетевыми ресурсами; подготовка к защите контрольной работы	Текущий контроль успеваемости	ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3
Итого по разделу	1			1/0,4И	23			
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	1/0,2И	25,4	Работа с литературой и сетевыми ресурсами	Итоговый тест; Защита контрольной работы	ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3
Итого по разделу	1		1/0,2И	25,4			
Итого за семестр	4		4/1,6И	95,4		зачёт	
Итого по дисциплине	4		4/1,6И	95,4		зачет	

5 Образовательные технологии

Одной из задач в подготовке будущих магистров является подготовка компетентного, 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 компетентного подхода предлагается использовать интерактивные образовательные технологии, включая информационные и коммуникационные технологии (ИКТ), при осуществлении различных видов учебной работы:

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

- мониторинг (взаимное) обучение;

- учебную дискуссию;

- электронные средства обучения;

- 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 получению 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.

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 Office 2007 Professional	№ 135 от 17.09.2007	бессрочно
7Zip	свободно распространяемое ПО	бессрочно
FAR Manager	свободно распространяемое ПО	бессрочно

Профессиональные базы данных и информационные справочные системы

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

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.