

МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ АВТОНОМНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ ТРАНСПОРТА»
(РУТ (МИИТ))



Рабочая программа дисциплины (модуля),
как компонент образовательной программы
высшего образования - программы магистратуры
по направлению подготовки
38.04.02 Менеджмент,
утвержденной первым проректором РУТ (МИИТ)
Тимониным В.С.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Риск-менеджмент

Направление подготовки: 38.04.02 Менеджмент

Направленность (профиль): Управление проектами и программами в
инфраструктурном комплексе

Форма обучения: Очно-заочная

Рабочая программа дисциплины (модуля) в виде
электронного документа выгружена из единой
корпоративной информационной системы управления
университетом и соответствует оригиналу

Простая электронная подпись, выданная РУТ (МИИТ)
ID подписи: 3068
Подписал: заведующий кафедрой Ступникова Елена
Анатольевна
Дата: 23.04.2021

1. Общие сведения о дисциплине (модуле).

Целью освоения учебной дисциплины являются формирование у студентов теоретических знаний и практических навыков в области риск-менеджмента организации.

Задачами освоения дисциплины являются:

умение применять компетенции, связанные с пониманием фундаментальной сущности и общих закономерностей, характеризующих риски в экономике в целом и в конкретном бизнесе в частности, а также при осуществлении иной деятельности в профессиональной сфере, включая научно-исследовательскую и преподавательскую работу;

умение анализировать ситуации риска, оценивать и прогнозировать факторы риска;

освоение применения методов управления рисками и приобретение навыков разработки программ управления рисками предприятия.

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю).

Перечень формируемых результатов освоения образовательной программы (компетенций) в результате обучения по дисциплине (модулю):

ПК-1 - Способен управлять организациями, подразделениями, группами (командами) сотрудников, проектами и сетями;

УК-2 - Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла.

Обучение по дисциплине (модулю) предполагает, что по его результатам обучающийся будет:

Знать:

основные виды, факторы риска в бизнесе и причины их возникновения; методы анализа и оценки риска; методы минимизации и прогнозирования факторов риска.

Уметь:

выявлять внешние и внутренние факторы риска организации; анализировать ситуации риска в процессе реализации управленческих решений в организации; распознавать, анализировать, различать и оценивать во взаимосвязи различные факторы и ситуации риска в соответствии с этапами жизненного цикла в организации.

Владеть:

навыками идентификации факторов риска организации; навыками

проектирования структур риск-менеджмента; контроля управленческих процессов и разработки программ риск-менеджмента в организациях; навыками распределения полномочий и ответственности за риски в организациях.

3. Объем дисциплины (модуля).

3.1. Общая трудоемкость дисциплины (модуля).

Общая трудоемкость дисциплины (модуля) составляет 5 з.е. (180 академических часа(ов)).

3.2. Объем дисциплины (модуля) в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении учебных занятий:

Тип учебных занятий	Количество часов	
	Всего	Семестр №3
Контактная работа при проведении учебных занятий (всего):	32	32
В том числе:		
Занятия лекционного типа	16	16
Занятия семинарского типа	16	16

3.3. Объем дисциплины (модуля) в форме самостоятельной работы обучающихся, а также в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении промежуточной аттестации составляет 148 академических часа (ов).

3.4. При обучении по индивидуальному учебному плану, в том числе при ускоренном обучении, объем дисциплины (модуля) может быть реализован полностью в форме самостоятельной работы обучающихся, а также в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении промежуточной аттестации.

4. Содержание дисциплины (модуля).

4.1. Занятия лекционного типа.

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
1	<p>Понятийный аппарат риск-менеджмента</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Основные понятия теории рисков: факторы риска, индикаторы риска, рисковые события и т.п. - Экономическая природа и содержание риска в бизнесе. - Основные показатели и свойства риска. - Причины возникновения и модификации риска в бизнесе.
2	<p>Классификация факторов риска организаций.</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Основные характеристики рисков организации - Внешние факторы риска (страновой, валютный, налоговый, форс-мажорных обстоятельств и т.п.) - Внутренние факторы риска (организационный, ресурсный, портфельный, кредитный, инновационный и т.п.) - Факторы риска мезо-среды.
3	<p>Качественные методы анализа и оценки факторов риска организации</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Роль качественной оценки факторов риска - Идентификация факторов риска - Ранжирование рисков.
4	<p>Количественные методы анализа и оценки факторов риска организации</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Аналитические методы оценки рисков - Статистические методы анализа и оценки рисков - Экспертные методы оценки факторов риска.
5	<p>Модели оценки рисков</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Подходы к измерению рисков - Совокупный риск - Применение теории копул при измерении совокупного риска - Факторные модели оценки совокупного риска.
6	<p>Риск-менеджмент в организации</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Основные принципы управления риском в организации. Разукрупнение риска, распределение экспозиции во времени или пространстве, изоляция синергетических факторов. - Методы управления рисками в организации - Стратегия управления рисками с трюительной компании. Статическая и динамическая концепция управления рисками. Специфика управления рисками на разных этапах реализации строительных проектов - Психология риска. Склонность к предпринимательскому риску. Импульсивность, решительность, фатализм – как факторы принятия рискованных решений. Минимизация риска в неопределённой ситуации.
7	<p>Система риск-менеджмента в организации:</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Принципы системы риск-менеджмента - Структура системы риск-менеджмента - Ресурсное обеспечение системы управления рисками - Оценка эффективности системы риск-менеджмента.
8	<p>Стандарты риск-менеджмента</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Модель риск-менеджмента стандарта ISO 31000 - Модель риск-менеджмента стандарта COSO ERM

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
	- ГОСТ Р ИСО 31000-2019 Менеджмент риска.

4.2. Занятия семинарского типа.

Практические занятия

№ п/п	Тематика практических занятий/краткое содержание
1	Основные понятия риска В результате прохождения кейса студенты освоят понятийный аппарат теории риска и усвоят экономическую природу и содержание риска организации.
2	Риск-менеджмент в условиях нестабильности В результате студенты смогут выявить и усвоить взаимосвязь риска, вероятности и неопределенности, а также поймут природу условий нестабильности.
3	Идентификация факторов риска конкретной компании или конкретного проекта В результате студенты освоят навыки выявления факторов риска, построения классификаций в целях повышения эффективности управления рисками, ранжирования их по уровням угроз, установлении взаимосвязи между факторами и индикаторами факторов риска.
4	Выявление и анализ причин рискованных ситуаций в бизнесе В результате студенты научатся выявлять причины возникновения рискованных ситуаций в целях разработки системы индикаторов и реализации превентивных мер в системе риск-менеджмента компании.
5	Анализ внешних и внутренних факторов риска компании В результате студенты освоят методы анализа рисков внешней среды и возможные подходы к их минимизации в сфере бизнеса.
6	Разработка алгоритма управления факторами риска организации В результате студенты освоят методологические подходы к построению алгоритма управления факторами риска с учетом специфики бизнеса.
7	Ресурсное обеспечение системы управления рисками В результате студенты приобретут навыки выделения и эффективного распределения информационных, трудовых, материальных, финансовых ресурсов в рамках системы управления рисками.

4.3. Самостоятельная работа обучающихся.

№ п/п	Вид самостоятельной работы
1	Подготовка к практическим занятиям
2	Работа с лекционным материалом
3	Выполнение курсовой работы.
4	Подготовка к промежуточной аттестации.
5	Подготовка к текущему контролю.

4.4. Примерный перечень тем курсовых работ

Примерный перечень тем курсовых работ:

Анализ рисков организации и методы их идентификации.

Методы оценки рисков: статистический, аналитический и экспертный подходы.

Предпринимательские риски: сущность, методы оценки и управления.

Методы управления финансовыми рисками и выбор механизмов нейтрализации.

Кредитные риски и их влияние на экономическую активность.

Валютные риски и мировой валютный рынок.

Процентные риски и их роль в банковской системе.

Рыночные риски и методы их оценки и регулирования.

Риски ликвидности и анализ денежных потоков организации.

Риски развития и поиск эффективных путей развития предприятия.

Курсовая работа выполняется по индивидуальным вариантам, задаваемым преподавателем.

5. Перечень изданий, которые рекомендуется использовать при освоении дисциплины (модуля).

№ п/п	Библиографическое описание	Место доступа
1	Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 485 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12206-0.	https://urait.ru/bcode/469401 Текст : электронный (дата обращения: 12.05.2024).
2	Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 365 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-3502-8.	URL: https://urait.ru/bcode/469020 Текст : электронный (дата обращения: 12.05.2024)
3	Основы риск-менеджмента / М. Круи, Д. Гэлаи, В. Б. Минасян, Р. Марк. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 390 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02578-1.	URL: https://urait.ru/bcode/449729 Текст : электронны (дата обращения: 12.05.2024).

6. Перечень современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем, которые могут использоваться при освоении дисциплины (модуля).

Научно-техническая библиотека РУТ (МИИТ): <http://library.miiit.ru>

Федеральная служба государственной статистики: <https://www.gks.ru>

7. Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства, необходимого для освоения дисциплины (модуля).

Офисный пакет приложений Microsoft Office

8. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю).

Для проведения аудиторных занятий необходима аудитория с мультимедиа аппаратурой

9. Форма промежуточной аттестации:

Курсовая работа в 3 семестре.

Экзамен в 3 семестре.

10. Оценочные материалы.

Оценочные материалы, применяемые при проведении промежуточной аттестации, разрабатываются в соответствии с локальным нормативным актом РУТ (МИИТ).

Авторы:

профессор, доцент, д.н. кафедры
«Экономика транспортной
инфраструктуры и управление
строительным бизнесом»

Н.В. Капустина

Согласовано:

Заведующий кафедрой ЭТИиУСБ
Председатель учебно-методической
комиссии

Е.А. Ступникова

М.В. Ишханян