

МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ АВТОНОМНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ ТРАНСПОРТА»

УТВЕРЖДАЮ:

Директор ИЭФ



Ю.И. Соколов

23 мая 2019 г.

Кафедра «Экономика транспортной инфраструктуры и управление
строительным бизнесом»

Автор Чернигина Ирина Алексеевна, к.э.н., доцент

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Управление рисками в инвестиционных проектах

Направление подготовки:	38.03.02 – Менеджмент
Профиль:	Управление проектами
Квалификация выпускника:	Бакалавр
Форма обучения:	очная
Год начала подготовки	2018

Одобрено на заседании Учебно-методической комиссии института Протокол № 7 20 мая 2019 г. Председатель учебно-методической комиссии  М.В. Ишханян	Одобрено на заседании кафедры Протокол № 15 15 мая 2019 г. Заведующий кафедрой  Д.А. Мачерет
--	--

Рабочая программа учебной 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: 3344
Подписал: Заведующий кафедрой Мачерет Дмитрий
Александрович
Дата: 15.05.2019

Москва 2019 г.

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Целями освоения учебной дисциплины «Управление рисками в инвестиционных проектах» являются: формирование у студентов теоретических знаний и практических навыков в области управления рисками, умение применять компетенции, связанные с пониманием фундаментальной сущности и общих закономерностей, характеризующих риски в экономике в целом и в строительном бизнесе в частности, а также при осуществлении иной деятельности в профессиональной сфере, включая научно-исследовательскую и преподавательскую работу.

Основными видами формируемых у обучающихся компетенций в области управления рисками, являются способности проводить анализ рыночных и специфических рисков и использовать его результаты для принятия управленческих решений

2. МЕСТО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОП ВО

Учебная дисциплина "Управление рисками в инвестиционных проектах" относится к блоку 1 "Дисциплины (модули)" и входит в его вариативную часть.

2.1. Наименования предшествующих дисциплин

Для изучения данной дисциплины необходимы следующие знания, умения и навыки, формируемые предшествующими дисциплинами:

2.1.1. Теория менеджмента:

Знания: функции менеджмента, основные задачи менеджера и подходы в управлении, методы принятия управленческих решений

Умения: подготавливать организационные и распорядительные документы, необходимые для создания новых предпринимательских структур

Навыки: формулировать обязанности и полномочия должностей, входящих в построенную структуру управления организацией

2.1.2. Финансовый менеджмент:

Знания: • цели финансового менеджмента, объекты и субъекты; • порядок расчета показателей, характеризующих эффективность и интенсивность использования активов и пассивов, методики оценки стоимости активов и инвестиционной привлекательности, показатели для оценки инвестиционных проектов; • методы и приемы управления активами и пассивами, в том числе, приемы антикризисного управления;

Умения: • систематизировать и анализировать статистические данные и справочные материалы о состоянии и развитии финансовых рынков, управленческую и финансовую отчетность предприятия (организации);

Навыки: • современной методологией научных и прикладных исследований в области финансов, финансового рынка, денежного оборота, производственно-финансовой деятельности предприятия (фирмы), навыками ее практического использования; • навыками интерпретации статистической информации, характеризующей параметры производственной и финансовой деятельности предприятия (фирмы);

2.1.3. Экономика:

Знания: - основные понятия и модели микроэкономической теории, макроэкономики и мировой экономики;

Умения: -Проводить анализ отрасли, используя экономические модели.

Навыки: Экономическими методами анализа поведения потребителей , производителей, собственников ресурсов и государства.

2.2. Наименование последующих дисциплин

Результаты освоения дисциплины используются при изучении последующих учебных дисциплин:

2.2.1. Преддипломная практика

**3. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ),
СООТНЕСЕННЫЕ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ
ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ**

В результате освоения дисциплины студент должен:

№ п/п	Код и название компетенции	Ожидаемые результаты
1	ПК-6 способностью участвовать в управлении проектом, программой внедрения технологических и продуктовых инноваций или программой организационных изменений	Знать и понимать: основные методы и принципы проведения расчетов рыночных и специфических рисков, основные пути снижения степени воздействия рисков и методы нахождения наиболее безрисковых путей реализации проекта Уметь: принимать управленческие решения с учетом проведения анализа рисков Владеть: навыками в области определения, классификации рисков, методами расчета возможных потерь при наступлении неблагоприятных событий и выбора оптимального, с точки зрения конечного результата, пути ведения малого бизнеса

4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) В ЗАЧЕТНЫХ ЕДИНИЦАХ И АКАДЕМИЧЕСКИХ ЧАСАХ

4.1. Общая трудоемкость дисциплины составляет:

3 зачетные единицы (108 ак. ч.).

4.2. Распределение объема учебной дисциплины на контактную работу с преподавателем и самостоятельную работу обучающихся

Вид учебной работы	Количество часов	
	Всего по учебному плану	Семестр 7
Контактная работа	36	36,15
Аудиторные занятия (всего):	36	36
В том числе:		
лекции (Л)	18	18
практические (ПЗ) и семинарские (С)	18	18
Самостоятельная работа (всего)	72	72
ОБЩАЯ трудоемкость дисциплины, часы:	108	108
ОБЩАЯ трудоемкость дисциплины, зач.ед.:	3.0	3.0
Текущий контроль успеваемости (количество и вид текущего контроля)	ПК1, ПК2	ПК1, ПК2
Виды промежуточной аттестации (экзамен, зачет)	ЗЧ	ЗЧ

4.3. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам)

№ п/п	Семестр	Тема (раздел) учебной дисциплины	Виды учебной деятельности в часах/ в том числе интерактивной форме						Формы текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации
			Л	ЛР	ПЗ/ТП	КСР	СР	Всего	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
1	7	Раздел 1 Понятие риска. Экономическая природа и содержание риска. Основные показатели и свойства риска. Причины возникновения и модификации риска.	2		2		8	12	
2	7	Раздел 2 Классификация рисков. Классификация рисков. Классификация по: характеристике опасности; подверженности риску; уязвимости, взаимодействию с другими рисками, информации о риске, величине риска, размеру расходов. Специфические классификации рисков.	2				6	8	
3	7	Раздел 3 Характеристика рисков в различных сферах бизнеса. Характеристика рисков в различных сферах бизнеса. Внешние (страновой, валютный, налоговый, форс-мажорных обстоятельств) и внутренние (организационный, ресурсный, портфельный, кредитный, инновационный) риски строительного бизнеса	2		2		8	12	
4	7	Раздел 4 Методы анализа риска. Технократическое, экономическое и психологическое	2		4		10	16	ПК1

№ п/п	Семестр	Тема (раздел) учебной дисциплины	Виды учебной деятельности в часах/ в том числе интерактивной форме						Формы текущего контроля успеваемости и промежу- точной аттестации
			Л	ЛР	ПЗ/ТП	КСР	СР	Всего	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
		направления анализа риска							
5	7	Раздел 5 Методы оценки риска Аналитические, статистические и экспертные модели оценки риска	2		4		10	16	
6	7	Раздел 6 Основные принципы управления риском. Разукрупнение риска, распределение экспозиции во времени или пространстве, изоляция синергетических факторов.	2		2		10	14	
7	7	Раздел 7 Стратегия управления рисками. Статическая и динамическая концепция управления рисками	2				10	12	
8	7	Раздел 8 Психология риска. Склонность к предпринимательскому рisku. Импульсивность, решительность, фатализм – как факторы принятия рискованных решений. Минимизация риска в неопределённой ситуации.	4		4		10	18	ПК2
9	7	Зачет						0	ЗЧ
10		Всего:	18		18		72	108	

4.4. Лабораторные работы / практические занятия

Лабораторные работы учебным планом не предусмотрены.

Практические занятия предусмотрены в объеме 18 ак. ч.

№ п/п	№ семестра	Тема (раздел) учебной дисциплины	Наименование занятий	Всего часов/ из них часов в интерактивной форме
1	2	3	4	5
1	7	РАЗДЕЛ 1 Понятие риска. Экономическая природа и содержание риска. Основные показатели и свойства риска. Причины возникновения и модификации риска.	Экономическая природа и содержание риска. Основные показатели и свойства риска. Причины возникновения и модификации риска. Причины возникновения и модификации риска. Классификация риска по различным критериям.	2
2	7	РАЗДЕЛ 3 Характеристика рисков в различных сферах бизнеса.	Внешние (страновой, валютный, налоговый, форс-мажорных обстоятельств) и внутренние (организационный, ресурсный, портфельный, кредитный, инновационный) риски малого бизнеса	2
3	7	РАЗДЕЛ 4 Методы анализа риска. Технократическое, экономическое и психологическое направления анализа риска	Решение задач по вариантам	4
4	7	РАЗДЕЛ 5 Методы оценки риска Аналитические, статистические и экспертные модели оценки риска	Решение задач по вариантам	4
5	7	РАЗДЕЛ 6 Основные принципы управления риском. Разукрупнение риска, распределение экспозиции во времени или пространстве, изоляция синергетических факторов.	Трансферт риска, хеджирование, финансовая инженерия, укрупнение и разукрупнение риска как один из принципов управления им..	2

№ п/п	№ семестра	Тема (раздел) учебной дисциплины	Наименование занятий	Всего ча- сов/ из них часов в интерак- тивной форме
1	2	3	4	5
6	7	РАЗДЕЛ 8 Психология риска. Склонность к предпринимательскому рisku. Импульсивность, решительность, фатализм – как факторы принятия рискованных решений. Минимизация риска в неопределённой ситуации.	Тестирование на склонность к риску;	4
ВСЕГО:				18/0

4.5. Примерная тематика курсовых проектов (работ)

Курсовые проекты (работы) учебным планом не предусмотрены.

5. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

Преподавание дисциплины «Управление рисками в инвестиционных проектах» осуществляется в форме лекций и практических занятий.

Лекции проводятся в традиционной классно-урочной организационной форме, по типу управления познавательной деятельностью и на 50 % являются традиционными классически-лекционными (объяснительно-иллюстративные), и на 50 % с использованием интерактивных (диалоговых) технологий.

Практические занятия организованы с использованием технологий развивающего обучения. Часть практического курса выполняется в виде традиционных практических занятий (объяснительно-иллюстративное решение задач) в объёме 8 часов. Остальная часть практического курса (10 часов) проводится с использованием интерактивных (диалоговых) технологий, в том числе разбор и анализ конкретных ситуаций.

Самостоятельная работа студента организована с использованием традиционных видов работы и интерактивных технологий. К традиционным видам работы (29 часов) относятся отработка лекционного материала и отработка отдельных тем по учебным пособиям. К интерактивным (диалоговым) технологиям (29 часов) относится отработка отдельных тем по интернет-ресурсам и написание эссе.

Оценка полученных знаний, умений и навыков основана на рейтинговой технологии.

Фонды оценочных средств освоенных компетенций включают как вопросы теоретического характера для оценки знаний, так и задания практического содержания (решение ситуационных задач, анализ конкретных ситуаций, работа с данными) для оценки умений и навыков. Теоретические знания проверяются путём применения таких организационных форм, как индивидуальные и групповые опросы.

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДЛЯ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

№ п/п	№ семестра	Тема (раздел) учебной дисциплины	Вид самостоятельной работы студента. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы	Всего часов
1	2	3	4	5
1	7	РАЗДЕЛ 1 Понятие риска. Экономическая природа и содержание риска. Основные показатели и свойства риска. Причины возникновения и модификации риска.	Работа с основной и дополнительной литературой и интернет-источниками.	8
2	7	РАЗДЕЛ 2 Классификация рисков.	Работа с основной и дополнительной литературой и интернет-источниками.	6
3	7	РАЗДЕЛ 3 Характеристика рисков в различных сферах бизнеса.	Работа с основной и дополнительной литературой и интернет-источниками.	8
4	7	РАЗДЕЛ 4 Методы анализа риска. Технократическое, экономическое и психологическое направления анализа риска	Работа с основной и дополнительной литературой и интернет-источниками.	10
5	7	РАЗДЕЛ 5 Методы оценки риска Аналитические, статистические и экспертные модели оценки риска	Работа с основной и дополнительной литературой и интернет-источниками.	10
6	7	РАЗДЕЛ 6 Основные принципы управления риском. Разукрупнение риска, распределение экспозиции во времени или пространстве, изоляция синергетических факторов.	Работа с основной и дополнительной литературой и интернет-источниками.	10
7	7	РАЗДЕЛ 7 Стратегия управления рисками. Статическая и динамическая концепция управления рисками	Работа с основной и дополнительной литературой и интернет-источниками.	10
8	7	РАЗДЕЛ 8 Психология риска. Склонность к предпринимательскому риску. Импульсивность, решительность, фатализм – как факторы принятия	Работа с основной и дополнительной литературой и интернет-источниками.	10

		рискованных решений. Минимизация риска в неопределённой ситуации.		
ВСЕГО:				72

7. ПЕРЕЧЕНЬ ОСНОВНОЙ И ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

7.1. Основная литература

№ п/п	Наименование	Автор (ы)	Год и место издания Место доступа	Используется при изучении разделов, номера страниц
1	Общая теория рисков	Вишняков Яков Дмитриевич; Радаев Николай Николаевич	Академия, 2015 МИИТ НТБ 658.3 В55 ч.з..1-1, фб-3	Раздел 1, Раздел 2, Раздел 3, Раздел 4, Раздел 6, Раздел 7, Раздел 8, Раздел 9
2	Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски	Тактаров Г.А., Григорьева Е.М.	М. : Финансы и статистика, 2014 ЭБС "Издательство "Лань" http://e.lanbook.com/book/69226	Раздел 1, Раздел 2, Раздел 3, Раздел 4, Раздел 6, Раздел 7, Раздел 8, Раздел 9

7.2. Дополнительная литература

№ п/п	Наименование	Автор (ы)	Год и место издания Место доступа	Используется при изучении разделов, номера страниц
3	Управление системными финансовыми рисками в условиях глобализации	Саввина О.В.	ФиС М. , 2015 ЭБС "Издательство "Лань" http://e.lanbook.com/book/72414	Раздел 1, Раздел 2, Раздел 3, Раздел 4, Раздел 6, Раздел 7, Раздел 8, Раздел 9
4	Управление рисками в малом бизнесе	И.А.Чернигина	М: МИИТ, , 2014 Кафедральная библиотека, 90	Раздел 1, Раздел 2, Раздел 3, Раздел 4, Раздел 6, Раздел 7, Раздел 8, Раздел 9

8. ПЕРЕЧЕНЬ РЕСУРСОВ ИНФОРМАЦИОННО-ТЕЛЕКОММУНИКАЦИОННОЙ СЕТИ "ИНТЕРНЕТ", НЕОБХОДИМЫЕ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

1. <http://library.mii.ru/> - электронно-библиотечная система Научно-технической библиотеки МИИТ.
2. <http://rzd.ru/> - сайт ОАО «РЖД».
3. <http://elibrary.ru/> - научно-электронная библиотека.
4. Поисковые системы: Yandex, Google, Mail.

9. ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ИНФОРМАЦИОННЫХ СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ, ИСПОЛЪЗУЕМЫХ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

Для проведения лекционных занятий необходима специализированная лекционная аудитория с мультимедиа аппаратурой и интерактивной доской.

Для проведения практических занятий необходимы компьютеры с рабочими местами в компьютерном классе. Компьютеры должны быть обеспечены стандартными лицензионными программными продуктами и обязательно программным продуктом Microsoft Office не ниже Microsoft Office 2007 (2013).

10. ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

Для проведения аудиторных занятий и самостоятельной работы требуется:

1. Рабочее место преподавателя с персональным компьютером, подключённым к сетям INTERNET и INTRANET.
2. Специализированная лекционная аудитория с мультимедиа аппаратурой и интерактивной доской.
3. Компьютерный класс с кондиционером. Рабочие места студентов в компьютерном классе, подключённые к сетям INTERNET и INTRANET
4. Для проведения практических занятий: компьютерный класс; кондиционер; компьютеры с минимальными требованиями – Pentium 4, ОЗУ 4 ГБ, HDD 100 ГБ, USB 2.0.

11. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Обучающимся необходимо помнить, что качество полученного образования в немалой степени зависит от активной роли самого обучающегося в учебном процессе.

Обучающийся должен быть нацелен на максимальное усвоение подаваемого лектором материала, после лекции и во время специально организуемых индивидуальных встреч он может задать лектору интересующие его вопросы.

Лекционные занятия составляют основу теоретического обучения и должны давать систематизированные основы знаний по дисциплине, раскрывать состояние и перспективы развития соответствующей области науки, концентрировать внимание обучающихся на наиболее сложных и узловых вопросах, стимулировать их активную познавательную деятельность и способствовать формированию творческого мышления.

Главная задача лекционного курса – сформировать у обучающихся системное представление об изучаемом предмете, обеспечить усвоение будущими специалистами основополагающего учебного материала, принципов и закономерностей развития соответствующей научно-практической области, а также методов применения полученных знаний, умений и навыков.

Основные функции лекций: 1. Познавательно-обучающая; 2. Развивающая; 3.

Ориентирующе-направляющая; 4. Активизирующая; 5. Воспитательная; 6.

Организирующая; 7. Информационная.

Выполнение практических заданий служит важным связующим звеном между теоретическим освоением данной дисциплины и применением ее положений на практике.

Они способствуют развитию самостоятельности обучающихся, более активному освоению учебного материала, являются важной предпосылкой формирования профессиональных качеств будущих специалистов.

Проведение практических занятий не сводится только к органическому дополнению лекционных курсов и самостоятельной работы обучающихся. Их вместе с тем следует

рассматривать как важное средство проверки усвоения обучающимися тех или иных положений, даваемых на лекции, а также рекомендуемой для изучения литературы; как форма текущего контроля за отношением обучающихся к учебе, за уровнем их знаний, а следовательно, и как один из важных каналов для своевременного подтягивания отстающих обучающихся.

При подготовке специалиста важны не только серьезная теоретическая подготовка, знание основ управления рисками в строительстве, но и умение ориентироваться в разнообразных практических ситуациях, ежедневно возникающих в его деятельности. Этому способствует форма обучения в виде практических занятий. Задачи практических занятий: закрепление и углубление знаний, полученных на лекциях и приобретенных в процессе самостоятельной работы с учебной литературой, формирование у обучающихся умений и навыков работы с исходными данными, научной литературой и специальными документами. Практическому занятию должно предшествовать ознакомление с лекцией на соответствующую тему и литературой, указанной в плане этих занятий.

Самостоятельная работа может быть успешной при определенных условиях, которые необходимо организовать. Ее правильная организация, включающая технологии отбора целей, содержания, конструирования заданий и организацию контроля, систематичность самостоятельных учебных занятий, целесообразное планирование рабочего времени позволяет привить студентам умения и навыки в овладении, изучении, усвоении и систематизации приобретаемых знаний в процессе обучения, привить навыки повышения профессионального уровня в течение всей трудовой деятельности.

Каждому студенту следует составлять еженедельный и семестровый планы работы, а также план на каждый рабочий день. С вечера всегда надо распределять работу на завтра. В конце каждого дня целесообразно подводить итог работы: тщательно проверить, все ли выполнено по намеченному плану, не было ли каких-либо отступлений, а если были, по какой причине это произошло. Нужно осуществлять самоконтроль, который является необходимым условием успешной учебы. Если что-то осталось невыполненным, необходимо изыскать время для завершения этой части работы, не уменьшая объема недельного плана.

Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения учебной дисциплины, рассмотрены через соответствующие знания, умения и владения. Для проверки уровня освоения дисциплины предлагаются вопросы к экзамену и написание эссе.

Фонд оценочных средств является составной частью учебно-методического обеспечения процедуры оценки качества освоения образовательной программы и обеспечивает повышение качества образовательного процесса и входит, как приложение, в состав рабочей программы дисциплины.

Основные методические указания для обучающихся по дисциплине указаны в разделе основная и дополнительная литература.