



Основная профессиональная образовательная программа  
38.04.02 Менеджмент  
(Общий и стратегический менеджмент)

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации

**ИВАНОВСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ**

Кафедра менеджмента

ОДОБРЕНО:

Руководитель ОП

А. С. Лифшиц А. С. Лифшиц  
(подпись)

« 13 » июня 20 18 г.

**Рабочая программа дисциплины**  
**Риск-менеджмент**

Уровень высшего образования:	магистратура
Квалификация выпускника:	магистр
Направление подготовки:	38.04.02 Менеджмент
Направленность (профиль) образовательной программы:	Общий и стратегический менеджмент
Тип образовательной программы:	программа академической магистратуры

Иваново



Основная профессиональная образовательная программа  
38.04.02 Менеджмент  
(Общий и стратегический менеджмент)

## 1. Цели освоения дисциплины

Целью освоения дисциплины является формирование у студентов устойчивых знаний о методах оценки, анализа и управления рисками организации, а также умений и навыков использования этих инструментов в процессе управления социо-экономическими системами.

## 2. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина «Риск-менеджмент» (Б1.В.ДВ.03.01) относится к дисциплинам по выбору вариативной части учебного плана по программе магистратуры по направлению 38.04.02 Менеджмент (направленность Общий и стратегический менеджмент).

Она базируется на результатах изучения таких дисциплин как «Управленческая экономика», «Управление фирмой» (магистратура) и результатов освоения ряда учебных программ бакалавриата по направлениям «Менеджмент», «Экономика» и иных.

Для успешного усвоения дисциплины студент должен:

### Знать:

- основные математические методы, применимые при анализе, моделировании и прогнозировании предпринимательской деятельности и принятии управленческих решений

### Уметь:

- оценивать экономические и социальные условия осуществления предпринимательской деятельности

### Владеть:

- навыками количественного и качественного анализа информации при принятии управленческих решений.

Освоение данной дисциплины как предшествующей необходимо при изучении следующих дисциплин: «Управление затратами» («Управление эффективностью»), «Система менеджмента качества», прохождению производственной практики (практики по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности (организационно-управленческая)), а также производственной практики (преддипломной).

## 3. Планируемые результаты обучения по дисциплине

### 3.1. Компетенции, формированию которых способствует дисциплина

При освоении дисциплины формируются следующие компетенции в соответствии с ФГОС ВО по данному направлению подготовки:

*профессиональные (ПК):*

а) аналитическая деятельность:

- способность использовать количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес-процессами, готовить аналитические материалы по результатам их применения (ПК-4);

- способность использовать современные методы управления корпоративными финансами для решения стратегических задач (ПК-6).

### 3.2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с формируемыми компетенциями

В результате освоения дисциплины обучающийся должен:

#### Знать:

- сущность и классификацию рисков (ПК-4);
- концепцию интегрированного управления рисками и стандарты риск- менеджмента (ПК-4);
- алгоритмы управления рисками предприятия (ПК-4);

#### Уметь:

- разрабатывать системы риск-менеджмента (ПК-6);



Основная профессиональная образовательная программа  
38.04.02 Менеджмент  
(Общий и стратегический менеджмент)

- интегрировать систему риск-менеджмента в систему управления (ПК-6);
- проводить анализ эффективности деятельности предприятия с учетом факторов риска(ПК-4).
- выявлять проблемы управленческого характера при анализе конкретных ситуаций, предлагать способы их решения с учетом критериев социально-экономической эффективности, оценки рисков и возможных социально-экономических последствий (ПК-6);
- использовать источники экономической, социальной и управленческой информации (ПК-4);

**Владеть:**

- методами защиты от рисков (ПК-6);
- моделями оценки и анализа рисков (ПК-4).

**4. Объем и содержание дисциплины**

Объем дисциплины по очной и очно-заочной форме обучения составляет 4 зачетные единицы (144 академических часов).

**4.1. Содержание дисциплины по разделам (темам), соотнесенное с видами и трудоемкостью занятий лекционно-семинарского типа**

Объем иной контактной работы и самостоятельной работы обучающегося по дисциплине указан в учебном плане образовательной программы.

№ п/п	Разделы (темы) дисциплины	Семестр	Виды занятий, их объем (в ак. часах, по очной / очно-заочной форме обучения)		Формы текущего контроля успеваемости (по очной и очно-заочной форме обучения)  Формы промежуточной аттестации
			Занятия лекцион- ного типа	Занятия практи- ческого типа	
1.	Вводный. Введение в проблематику дисциплины, представление рабочей программы, осмысление требований к организации процесса обучения, самостоятельной работы и форм аттестации	2	1	1	Входная диагностика: тест с последующим обсуждением результатов. Список вопросов, интересующих студента по содержанию дисциплины (сдается в письменном виде)
2.	Тема 1. Место и роль рисков в управлении деятельностью предприятия	2	1	3	Доклады Кейс Коллоквиум
3.	Тема 2. Концепции управления рисками	2	2	4	Кейс Контрольная работа №1
4.	Тема 3. Анализ и оценка рисков	2	2	6	Расчетно-аналитические задания Задание по самостоятельной работе
5.	Тема 4. Методы управления риском	2	-	2	Доклады Кейс
6.	Тема 5. Управление рисками в ходе подготовки и проведения деловых встреч (бесед)	2	-	2	Доклады
7.	Тема 6. Управление предпринимательскими рисками неустановленной природы.	2	2	2	Коллоквиум Контрольная работа №2
Итого за семестр:			8	20	Экзамен



#### **4.2. Развернутое описание содержания дисциплины по разделам (темам)**

Вводный. Введение в проблематику дисциплины, представление рабочей программы, осмысление требований к организации процесса обучения, самостоятельной работы и форм аттестации.

##### **Тема 1. Место и роль рисков в управлении деятельностью предприятия**

Содержание понятия «неопределенность». Изменение состояния объекта. Виды неопределенности. Понятие риска. Риск и шанс. Классификация рисков по сфере возникновения. Классификация рисков по периоду существования. Экономические риски и убытки. Концепция предпринимательского риска. Виды потерь в предпринимательстве и их оценка.

##### **Тема 2. Концепции управления рисками**

Историческое развитие риск-менеджмента. Содержание основных подходов к управлению деловыми рисками. Современные тенденции в управлении рисками и задача выбора стратегии. Концепция адаптивного динамического управления рисками. Служба риск-менеджмента. Основные стратегические направления снижения риска. Современные требования к спектру управленческих антирисковых действий. Контроль процесса управления рисками.

##### **Тема 3. Анализ и оценка рисков**

Стандарты в риск-менеджменте. Стандарты оценки результатов. Стандарты оценки деятельности. «ГОСТ Р 51897-2011/Руководство ИСО 73:2009. Национальный стандарт Российской Федерации. Менеджмент риска. Термины и определения». «ГОСТ Р ИСО 9004-2010. Национальный стандарт Российской Федерации. Менеджмент для достижения устойчивого успеха организации. Подход на основе менеджмента качества». Risk management standard. 2002 г. Enterprise Risk Management – Integrated Framework. 2004 г. International Convergence of Capital Measurement and Capital Standards: a Revised Framework. 2004 г. Модель внутрифирменного стандарта риск-менеджмента.

Методы анализа рисков по стандарту FERMA. Идентификация рисков. Общие принципы анализа риска. Динамический риск. Статический риск. Количественный и качественный анализ рисков. Методы анализа рисков: статистический; экспертных оценок; аналитический; оценки финансовой устойчивости и платежеспособности; оценки целесообразности затрат; анализ последствий накопления риска; метод использования аналогов; комбинированный метод.

Методы оценки уровня риска: экспертные и статистические. Расчет последствий: опасности и возможности. Расчет вероятностей: опасности. Расчет вероятностей: возможности. Приемлемость риска. Зоны риска и кривая риска. Переменные риска. Анализ чувствительности модели.

##### **Тема 4. Методы управления риском**

Понятия и виды методов управления рисками. Юридические методы управления рисками. Административные методы риск-менеджмента. Сущность экономических методов управления рисками. Понятие и содержание социальных методов управления рисками. Особенности применения психологических методов управления рисками. Производственные методы риск-менеджмента. Использование научно-прикладных методов управления в системе риск-менеджмента.

##### **Тема 5. Управление рисками в ходе подготовки и проведения деловых встреч (бесед)**

Цели и основные формы проведения деловых встреч (бесед). Основные этапы подготовки и проведения деловой беседы. Стратегия и тактика ведения деловой беседы. Некоторые особенности семантики «официальных ответов» и тактики ведения дискуссии на пресс-конференциях.

##### **Тема 6. Управление предпринимательскими рисками неуставной природы.**



Основная профессиональная образовательная программа  
38.04.02 Менеджмент  
(Общий и стратегический менеджмент)

Методы прогнозирования «природно-неопределенных» рискованных ситуаций. Классические и современные методы принятия управленческих решений в условиях «природного» риска. Методы управления рисками при подборе персонала.

### 5. Образовательные технологии

С целью формирования и развития заявленных компетенций используются технологии смешанного обучения, которые включают традиционные образовательные технологии, технология интерактивного обучения, информационно-коммуникационную технологию.

В рамках традиционной образовательной технологии на занятиях используются следующие формы: лекция, самостоятельная работа обучающихся, консультирование преподавателем, контроль знаний.

В рамках технологии интерактивного обучения на занятиях применяются следующие формы: работа в группах, технология развития критического мышления, технология учебной дискуссии, решение расчетно-аналитических задач.

При чтении лекций используется диалоговая форма с использованием элементов практических занятий, постановкой и решением проблемных задач и т.д. В рамках лекционных занятий заслушиваются и обсуждаются подготовленные студентами доклады.

Информационно-коммуникационная технология реализуется с помощью ЭИОС «Мой университет».

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

Организация самостоятельной работы студентов строится на основе изучения основной, дополнительной литературы, электронных ресурсов в соответствии с тематическим планированием дисциплины, а также подготовки к практическим занятиям, текущему и промежуточному контролю (таблица 4.1.).

Методические материалы для самостоятельной подготовки студентов приводятся в Приложении 1 к рабочей программе: <https://uni.ivanovo.ac.ru/workprograms/materials/9241?type=2>

### 7. Характеристика оценочных средств для текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

Система контроля по дисциплине включает входной, текущий (формы отражены в таблице 4.1) и промежуточный контроль по дисциплине (экзамен).

Входной контроль включает 10 тестовых вопросов на оценку «зачтено» и «не зачтено». Оценка «зачтено» выставляется студенту, если он набрал 6 и более правильных ответов; оценка «не зачтено» выставляется, если студент набрал 5 и менее 5 правильных ответов.

Для текущего контроля проводятся коллоквиумы, оцениваются задания по самостоятельной работе, а также решение расчетно-аналитических задач, контрольные работы по темам, включающие тестовые задания и задачи.

Всего по текущей работе студент может набрать 60 баллов, в том числе:

- выполнение заданий на практических занятиях, ответы по коллоквиуму – 20 баллов;
- контрольные работы – 20 баллов;
- выполнение самостоятельной работы – 20 баллов;

Промежуточный контроль знаний студентов по дисциплине осуществляется путем проведения устного экзамена, который включает два теоретических вопроса (20 баллов) и одно расчетно-аналитическое задание (20 баллов).

Итоговый балл формируется суммированием баллов за текущую работу в семестре и промежуточную аттестацию. Приведение суммарной балльной оценки производится следующим образом:

Оценка по 4-балльной шкале	Значение в баллах по 100-балльной шкале
----------------------------	---



Основная профессиональная образовательная программа  
38.04.02 Менеджмент  
(Общий и стратегический менеджмент)

Отлично	85-100
Хорошо	70-84
Удовлетворительно	52-69
Неудовлетворительно	51 балл и менее

Комплект типовых заданий и задач представлен в составе Приложения 2 «Фонд оценочных средств» по дисциплине «Риск-менеджмент».

## 8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

Основная литература:

1. Управление рисками: учебное пособие / К.В. Балдин, С.Н. Воробьев, - Москва: Юнити-Дана, 2015. - 512 с. - ISBN 5-238-00861-9; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=117545>

2. Фомичев, А.Н. Риск-менеджмент: учебник / А.Н. Фомичев. - 4-е изд. - Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2016. - 372 с. : ил. - (Учебные издания для бакалавров). - Библиогр. в кн. - ISBN 978-5-394-02676-8 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=453893>

Дополнительная литература:

1. Страховое дело и инструменты страховой защиты в риск-менеджменте : учебное пособие / А.Г. Бадалова, В.Г. Ларионов, Г.В. Ларионов и др. - Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2016. - 135 с. : граф., табл., схем., ил. - Библиогр. в кн. - ISBN 978-5-394-02706-2 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=452903>

Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:

1. Система электронной поддержки образовательного процесса «Мой университет» <https://uni.ivanovo.ac.ru>
2. Рисковик. com. Профессиональный портал для риск-менеджеров//<http://www.riskovik.com>
3. Техэксперт. Электронный фонд правовой и нормативно-технической информации//<http://docs.cntd.ru>
4. Научная электронная библиотека Elibrary.ru URL: <http://elibrary.ru/defaultx.asp> (Свободный доступ).
5. Интернет-журнал "Экономика, предпринимательство и право" URL: <http://www.creativeconomy.ru/publishers/> (Свободный доступ).
6. Единая межведомственная информационно-статистическая система //URL: <http://www.fedstat.ru/indicators/start.do> (Свободный доступ).
7. Центральная база статистических данных URL: <http://cbsd.gks.ru/> (Свободный до-ступ).
8. Официальный интернет портал правовой информации URL: <http://pravo.gov.ru/> (Свободный доступ).

Профессиональные базы данных и информационно-справочные системы:

1. ЭБС «Университетская библиотека онлайн» // [www.biblioclub.ru](http://www.biblioclub.ru)
2. Электронная библиотека ИвГУ//<http://lib.ivanovo.ac.ru>
3. Электронный каталог НБ ИвГУ//<http://lib.ivanovo.ac.ru/index.php/ek>
4. СПС КонсультантПлюс URL: <http://www.consultant.ru/>.
5. Единая межведомственная информационно-статистическая система <https://www.fedstat.ru/>
6. База данных по теориям и моделям менеджмента // [https://www.12manage.com/index\\_ru.html](https://www.12manage.com/index_ru.html)
7. Корпоративный менеджмент: финансы, бизнес-планы, управление компанией//<https://www.cfin.ru>
8. Проверка и анализ российских юридических лиц и предпринимателей//<https://www.rusprofile.ru/>
9. Русское общество по управлению рисками// <http://rrms.ru/about/>



Основная профессиональная образовательная программа  
38.04.02 Менеджмент  
(Общий и стратегический менеджмент)

10. Информационно- управленческий «Портал «У»: электронная библиотека статей, учебников, пособий и монографий по менеджменту и экономике// <https://port-u.ru>
11. Интернет-сообщество менеджеров России // <https://www.e-xecutive.ru/management>
12. Федеральный образовательный портал по экономике, социологии, менеджменту// <http://ecsocman.hse.ru/>
13. База данных с текстами ведущих европейских и американских периодических изданий// <https://www.jstor.org/>
14. Глобальный издатель, связывающий исследования и практику бизнеса и управления // <https://www.emerald.com/insight/>

**Программное обеспечение:**

операционная система Microsoft Windows, Internet Explorer, Microsoft Defender, Adobe Acrobat Reader, КонсультантПлюс, Moodle.

**9. Материально-техническое обеспечение дисциплины**

Учебные аудитории:

- для проведения занятий лекционного типа с комплектом специализированной учебной мебели и техническими средствами обучения, служащими для предоставления учебной информации большой аудитории;
- для проведения занятий семинарского типа, текущего контроля и промежуточной аттестации с комплектом специализированной учебной мебели и техническими средствами обучения;
- для проведения групповых и индивидуальных консультаций с комплектом специализированной учебной мебели и техническими средствами обучения;

Помещение для самостоятельной работы, оснащенное комплектом специализированной учебной мебели, компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в ЭИОС.

Демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия для занятий лекционного типа, обеспечивающие тематические иллюстрации: демонстрационное оборудование, электронные пособия (презентации); аудио-визуальные пособия (аудиозаписи, видеоматериалы и т.п.), наглядные и печатные пособия.





Основная профессиональная образовательная программа  
38.04.02 Менеджмент  
(Общий и стратегический менеджмент)

**Автор рабочей программы дисциплины:** профессор, доцент, доктор экономических наук  
Миролюбова Анастасия Александровна

Программа рассмотрена и утверждена на заседании кафедры менеджмента  
« 05 » мая 20 18 г., протокол № 11

Программа обновлена  
протокол заседания кафедры № 1 от « 02 » сентября 20 19 г.

Согласовано:

Руководитель ОП  А. С. Лифшиц  
(подпись)

Программа обновлена  
протокол заседания кафедры № \_\_\_\_\_ от « \_\_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20 \_\_\_\_\_ г.

Согласовано:

Руководитель ОП \_\_\_\_\_ А. С. Лифшиц  
(подпись)