

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Карякин Андрей Виссарионович
Должность: Руководитель НТИ НИЯУ МИФИ
Дата подписания: 03.03.2023 08:10:04
Уникальный программный ключ:
2e905c9a64921ebc9b6e02a1d35ca143f7838874

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«Национальный исследовательский ядерный университет «МИФИ»

Новоуральский технологический институт –
филиал федерального государственного автономного образовательного
учреждения высшего образования «Национальный исследовательский ядерный
университет «МИФИ»

УТВЕРЖДЕНА
Ученым советом НТИ НИЯУ МИФИ
Протокол № 4 от 30.08.2021 г.

Рабочая программа учебной дисциплины "Анализ и оценка риска"

Направление подготовки (специальность)	38.03.02 Менеджмент
Профиль подготовки (специализация)	Управление инвестиционными проектами
Квалификация (степень) выпускника	бакалавр
Форма обучения	очно-заочная

Семестр	8
Трудоемкость, ЗЕТ	4 ЗЭТ
Трудоемкость, ч.	144 ч.
Аудиторные занятия, в т.ч.:	36 ч.
- лекции	18 ч.
- практические занятия	18 ч.
Самостоятельная работа	63 ч.
Контроль	45
Форма итогового контроля	экзамен

Учебную программу составил зав. кафедрой Грицова Ольга Александровна

СОДЕРЖАНИЕ

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ	4
2. МЕСТО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП ВО.....	4
3. ФОРМИРУЕМЫЕ КОМПЕТЕНЦИИ И ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ	4
4 ВОСПИТАТЕЛЬНЫЙ ПОТЕНЦИАЛ ДИСЦИПЛИНЫ.....	5
5 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ.....	5
6 ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ	7
7 ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ.....	7
8 УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ	8
9 МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ.....	9
10 УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ ДЛЯ СТУДЕНТОВ И ПРЕПОДАВАТЕЛЕЙ.....	9

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина имеет важное значение для подготовки бакалавров по направлению «Менеджмент». Цель занятий по дисциплине - Формирование у студентов знаний о методах оценки, анализа и управления рисками, а также умений и навыков использования этих инструментов в проектной деятельности.

Задачи преподавания дисциплины вытекают из необходимости изложения как теоретических основ, так и практических методов в решении вопросов анализа и оценки рисков проектов.

2. МЕСТО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП ВО

В соответствии с Образовательной программой подготовки бакалавров «Управление инвестиционными проектами» по направлению 38.03.02 «Менеджмент» данная учебная дисциплина входит в часть, формируемую участниками образовательных отношений профессионального модуля и является дисциплиной по выбору.

Изучение дисциплины базируется на сумме знаний и практических навыков, полученных студентами в ходе изучения таких дисциплин, как «Теория менеджмента: теория организации», «Стратегический менеджмент», «Методы принятия управленческих решений», «Управление проектами».

Изучение данной дисциплины является необходимым для выполнения выпускной квалификационной работы.

3. ФОРМИРУЕМЫЕ КОМПЕТЕНЦИИ И ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ

Профессиональные компетенции (ПК) в соответствии с задачами и объектами (областями знаний) профессиональной деятельности:

Задача профессиональной деятельности (ЗПД)	Объект или область знания	Код и наименование профессиональной компетенции	Код и наименование индикатора достижения профессиональной компетенции
разработка проектов, направленных на развитие организации, а также оценка их эффективности	инвестиционные проекты	ПК-7.1 способен проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании проектов	З-ПК-7.1 Знать: принципы, способы и методы оценки рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений У-ПК-7.1 Уметь: оценивать риски, доходность и эффективность принимаемых финансовых и инвестиционных решений В-ПК-7.1 Владеть: методами анализа рисков, оценкой вероятности их наступления

4 ВОСПИТАТЕЛЬНЫЙ ПОТЕНЦИАЛ ДИСЦИПЛИНЫ

Цели и задачи воспитания, воспитательный потенциал дисциплин

Направления/цели воспитания	Задачи воспитания (код)	Воспитательный потенциал дисциплин
Профессиональное воспитание	формирование ответственности за профессиональный выбор, профессиональное развитие и профессиональные решения (B18)	формирование у студентов ответственности за свое профессиональное развитие посредством выбора студентами индивидуальных образовательных траекторий, организации системы общения между всеми участниками образовательного процесса, в том числе с использованием новых информационных технологий.

5 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

5.1 Структура учебной дисциплины

Раздел учебной дисциплины	Неделя семестра	Виды учебной деятельности					Формы контроля	
		Лекции	Практические занятия	СРС				
				Подготовка к коллоквиуму	Написание реферата	Подготовка доклада		
Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов	1	1	2		27	6	Дкл	
	2,3	2	-	6				
	4,5	2	4	6			Дкл Кол1	
	6,7	2	-	6				
Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента	8,9	2	4					Дкл Кол2
	10,11	2	-					
	12,13	2	4	6			Дкл Кол3	
	14,15	2	-					
	16,17	2	-					
	18	1	4	6			Дкл Кол4 Кол5	
Итого		18	18	30	27	6		
Контроль	45							

Обозначения: Дкл - Доклад, Кол – Коллоквиум

5.2. Содержание учебной дисциплины

Темы и содержание лекционных занятий

1. Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов (7 часов)

Понятие и сущность риска. Определение, функции, организация и правила управления рисками. Информационное обеспечение управления рисками. Классификация рисков. Анализ и оценка степени риска.

Оценка риска проекта на основе анализа безубыточности. Выбор оптимального проекта развития предприятия в условиях неопределённости и риска минимаксными методами.

2. Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента (11 часов)

Управление рисками, возникающими при инвестировании. Риск-менеджмент. Анализ риска в инвестиционной программе. Анализ рисков современного предприятия. Основные понятия и принципы оценки эффективности инвестиций. Рациональный выбор инвестиционного портфеля. Оценка эффективности проекта в условиях риска (оценка риска) с использованием статистических методов. Страхование как метод снижения рисков. Хеджирование как метод снижения риска.

Практические занятия (18 часов) проводятся в следующих формах:

- 1) в форме занятий, на которых происходит обсуждение и защита рефератов;
- 2) в форме коллоквиумов, проводимых по темам лекций с целью закрепления пройденного теоретического материала.

Темы рефератов, а также вопросы для подготовки к коллоквиумам представлены в фонде оценочных средств дисциплины.

Самостоятельная работа обучающихся (63 часа)

Самостоятельная работа студента по учебной дисциплине регламентируется «Положением об организации самостоятельной работы студентов в НТИ НИЯУ МИФИ».

Структура времени самостоятельной работы студентов

- 1 Подготовка к выполнению тестовых заданий
- 2 Написание реферата
- 3 Подготовка доклада
- 4 Изучение дополнительного материала по теме лекций

Перечень учебно-методического обеспечения.

Учебно-методическое обеспечение учебной работы студентов включает:

- 1) слайды для проведения лекций;
- 2) фонд оценочных средств:
 - комплект тестовых заданий;
 - вопросы для подготовки к коллоквиумам;
 - контрольные вопросы для подготовки к сдаче экзамена;
 - методические рекомендации для преподавателя;
- 3) учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов включает:
 - методические рекомендации по организации самостоятельной работы обучающихся НТИ НИЯУ МИФИ.
 - стандарт организации СТО НТИ-2-2014. Требования к оформлению текстовой документации;

6 ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

Рекомендации для преподавателя по использованию информационно-образовательных технологий содержатся в «Положении об организационных формах и технологиях образовательного процесса в НТИ НИЯУ МИФИ».

При реализации программы дисциплины используются различные образовательные технологии. Аудиторные занятия проводятся в форме лекций, практических занятий. Для контроля усвоения студентами разделов данной дисциплины применяются тестовые технологии.

Для повышения уровня знаний студентов в течение семестра организуются консультации, во время которых:

- проводится объяснение непонятных для студентов разделов теоретического курса;
- проводятся консультации по написанию реферата;
- принимаются задолженности по тестовым и практическим работам и т.д.

Реализация компетентного подхода предусматривает широкое использование в учебном процессе активных и интерактивных форм проведения занятий, предполагающих активную обратную связь между преподавателем и студентами.

В процессе изучения дисциплины используются интерактивные формы обучения при проведении практических занятий:

- выступление студентов с докладом;
- дискуссии;
- презентации

7 ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Фонд оценочных средств по дисциплине обеспечивает проверку освоения планируемых результатов обучения (компетенций и их индикаторов) посредством мероприятий рубежного и промежуточного контроля по дисциплине.

Связь между формируемыми компетенциями и формами контроля их освоения представлена в таблице

№ п/п	Наименование	Аттестация	Максимальный балл	Индикаторы освоения дисциплины
1	Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов	Коллоквиум	15	З-ПК-7.1 У-ПК-7.1 В-ПК-7.1
2	Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента	Коллоквиум	15	
3	Написание реферата	Реферат	20	
4	Защита реферата	Доклад	10	
5	Экзамен	Тестовое задание на экзамен	40	
ИТОГО			100	

Средства текущего контроля и промежуточной аттестации по дисциплине представлены в ФОС. Шкала каждого контрольного мероприятия лежит в пределах от 0 до установленного максимального балла включительно. Итоговая аттестация по

дисциплине оценивается по 100-балльной шкале и представляет собой сумму баллов, заработанных студентом при выполнении контрольных мероприятий. Полученные баллы переводятся в 5-балльную систему по следующей шкале:

переводятся в 5-балльную систему по следующей шкале:				
Оценка по 5 балльной шкале	Зачет	Сумма баллов по дисциплине	Оценка (ECTS)	Градация
5 (отлично)	Зачтено	90-100	A	Отлично
4 (хорошо)		85-89	B	Очень хорошо
		75-84	C	Хорошо
		70-74	D	Удовлетворительно
		65-69		
3 (удовлетворительно)		60-64	E	Посредственно
2 (неудовлетворительно)	Не зачтено	Ниже 60	F	Неудовлетворительно

8 УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

8.1 Перечень литературы, необходимой для освоения дисциплины

1 Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе : учебник и практикум для вузов / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 381 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00375-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/489052>

2 Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 485 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12206-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/489580>

8.2 Учебно-методическое обеспечение дисциплины

1 Фонд оценочных средств. - Новоуральск, НТИ НИЯУ МИФИ

8.3 Перечень ресурсов информационно-коммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины

Наименование ресурса	Электронный адрес ресурса
1) Официальный сайт НТИ НИЯУ МИФИ	http://nti.mephi.ru
2) ЭБС Юрайт	http://urait.ru

9 МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Учебная дисциплина обеспечена учебно-методической документацией и материалами. Её содержание представлено в локальной сети учебного заведения и находится в режиме свободного доступа для студентов. Доступ студентов для самостоятельной подготовки осуществляется через компьютеры библиотеки и компьютерных классов НТИ НИЯУ МИФИ.

Материально-техническое обеспечение аудиторных занятий:

- 1) комплект электронных презентаций/слайдов,
- 2) аудитория, оснащенная презентационной техникой (проектор, экран, компьютер)

10 УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ ДЛЯ СТУДЕНТОВ И ПРЕПОДАВАТЕЛЕЙ

Вводная часть

Цель данной дисциплины — дать учащимся ключевые представления об управлении рисками в современных организациях.

Основной упор на лекциях необходимо делать на понимание излагаемого материала и умения его использования при подготовке для сдачи экзамена, к практическим занятиям и при выполнении самостоятельных работ.

Для освоения учебной дисциплины специальных образовательных технологий не требуется. Лекционная часть курса обеспечивает получение необходимых знаний; практические занятия посвящены решению конкретных учебных задач.

Методические указания к лекциям, практическим занятиям.

Преподавателям на каждой лекции рекомендуется очень кратко повторять пройденный материал предыдущих лекций. При этом следует останавливаться на сложных для понимания студентами ключевых элементах дисциплины.

Студентам перед текущей лекцией (заранее) рекомендуется очень кратко повторять пройденный материал предыдущих лекций. При этом следует сосредоточить свое внимание на сложных для понимания ключевых элементах дисциплины.

Основной упор на изучаемых лекциях необходимо делать именно на понимание представленного материала и на умение его использовать при выполнении практических контрольных работ.

Изучение текущего материала рекомендуется проводить, опираясь на следующие пособия [1, 2].

В рамках дисциплины предусмотрено проведение практических занятий, на которых учащиеся должны, используя представленный на лекциях материал, закрепить знания по изучаемой дисциплине. Практика показала, что следует быть готовым заранее к различным приемам вовлечения студентов в творческий процесс освоения учебного материала.