

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего
образования

"Национальный исследовательский ядерный университет "МИФИ" (НИЯУ МИФИ)

НОВОУРАЛЬСКИЙ ТЕХНОЛОГИЧЕСКИЙ ИНСТИТУТ

УТВЕРЖДАЮ

и.о. руководителя

 Г.С. Зиновьев

«07» февраля 2019 г.

Рабочая программа учебной дисциплины "Анализ и оценка риска"

Направление подготовки 38.03.02 Менеджмент

Профиль Управление инвестиционными проектами

Квалификация выпускника бакалавр

Форма обучения очно-заочная

г. Новоуральск, 2019

Семестр	8
Трудовоемкость, ЗЕТ	4 ЗЭТ
Трудовоемкость, 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

Индекс дисциплины в Рабочем учебном плане (РУП): Б1.В.04.ДВ.01.02

Учебную программу составил зав. кафедрой Грицова Ольга Александровна

Учебная программа рассмотрена на заседании кафедры «Экономики и управления» НТИ НИЯУ МИФИ «01» февраля 2019г., протокол №1 и рекомендована для подготовки бакалавров.

Заведующий кафедрой



 «01» февраля 2019г.

О.А. Грицова

СОДЕРЖАНИЕ

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ	4
2. МЕСТО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП ВО.....	4
3. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ И ИХ СООТНОШЕНИЕ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ.....	4
4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ.....	5
5. ИНФОРМАЦИОННО-ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ	8
6. СРЕДСТВА ДЛЯ КОНТРОЛЯ И ОЦЕНКИ	9
7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ	9
8. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ.....	11

Рабочая программа составлена в соответствии с Образовательным стандартом высшего образования Национального исследовательского ядерного университета «МИФИ» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент, утвержденным ученым советом университета, Протокол №№ 18/03 от 31.05.2018 г. с изменениями и дополнениями, утвержденными Ученым советом университета, Протокол № 20/08 от 22.09.2020 г. и рабочим учебным планом (РУП) по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент (профиль – «Управление инвестиционными проектами»).

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 рабочим учебным планом по направлению подготовки 38.03.02 «Менеджмент» данная учебная дисциплина относится к профессиональному модулю части, формируемой участниками образовательных отношений. Данная учебная дисциплина относится к дисциплинам 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. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ И ИХ СООТНОШЕНИЕ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Данный раздел устанавливает сквозное соотношение между планируемым результатом (ПР) в данной учебной дисциплине (УД) и образовательной программе (ОП). В таблице представлены компетенции, освоение которых происходит в результате освоения содержания дисциплины, перечень планируемых результатов обучения по данной дисциплине, а также соотношение между ними.

<p>Код компетенции Планируемый результат освоения образовательной программы, относящиеся к учебной дисциплине (ПР ОП)</p>	<p>Планируемый результат обучения по учебной дисциплине (ПР УД)</p>
<p>ПК-3 Способен владеть навыками разработки инвестиционных проектов и оценки их экономической эффективности 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</p>	<p>– знать содержание, цели, задачи и принципы разработки системы управления рисками организации; инструменты и методы управления рисками; общую терминологию в области управления рисками; методологию процесса управления рисками; методы выявления, оценки и анализа уровня рисков, управления рисками; стратегический анализ, разработку и осуществление стратегии организации, направленной на обеспечение конкурентоспособности.</p> <p>– уметь применять аналитические приемы определения целесообразности принятия решений в области управления рисками; классифицировать риски, выявлять особенности их возникновения и управления; проводить выбор между способами передачи рисков, осуществлять соответствующие расчеты к ним; оценивать результативность принятых управленческих решений; выбирать подходящий математический инструментарий для решения задач анализа и оценки рисков; использовать математические и статистические методы расчета уровня рисков; определять привлекательность инвестиционного портфеля; пользоваться инструментами риск-менеджмента; пользоваться навыками стратегического анализа, разработки и осуществления стратегии организации, направленной на обеспечение конкурентоспособности; идентифицировать товары для выявления и предупреждения их фальсификации.</p> <p>– владеть методологией экономического исследования; современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных; методами и приемами анализа экономических явлений и процессов с помощью стандартных теоретических и эконометрических моделей; современными методиками расчета и анализа показателей риска; навыками самостоятельной работы, самоорганизации и организации выполнения поручений; навыками идентификации товаров для выявления и предупреждения их фальсификации; навыками стратегического анализа, разработки и осуществления стратегии организации, направленной на обеспечение конкурентоспособности.</p>

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

4.1. Структура учебной дисциплины

Раздел учебной дисциплины	Неделя семестра	Виды учебной деятельности				Формы контроля	Ссылка на ПР УД		
		Лекции	Практические занятия	СРС					
				Подготовка к коллоквиуму	Написание реферата			Подготовка доклада	
Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов	1	1	2		27	6	Дкл	3.1, У1, У.2, В.1	
	2,3	2	-	6				3.1, У1, У.2, В.1	
	4,5	2	4	6			Дкл Кол1	3.1, У1, У.2, В.1	
	6,7	2	-	6				3.3, У1, У.2, В.1	
Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента	8,9	2	4					Дкл Кол2	3.2, У1, У.2, В.1
	10,11	2	-						3.2, У1, У.2, В.1
	12,13	2	4	6	Дкл Кол3	3.2, У1, У.2, В.1			
	14,15	2	-				3.2, У1, У.2, В.1		
	16,17	2	-				3.2, У1, У.2, В.1		
	18	1	4	6	Дкл Кол4 Кол5	3.2, У1, У.2, В.1			
Итого		18	18	30	27	6			
Контроль		45							

Обозначения: Дкл - Доклад, Кол – Коллоквиум

4.2. Содержание учебной дисциплины

Темы и содержание лекционных занятий

1. Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов

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

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 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

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;

5. ИНФОРМАЦИОННО-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

6. СРЕДСТВА ДЛЯ КОНТРОЛЯ И ОЦЕНКИ

Для оценки достижений студента используется рейтинговая система оценок.

Распределение баллов текущего рейтинга по видам деятельности

№ п/п	Наименование	Аттестация	Максимальный балл
1	Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов	Коллоквиум	15
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

Полученные баллы переводятся в 5-балльную систему по следующей шкале

Оценка по 5 бальной 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
3 (удовлетворительно)		65-69	E	Посредственно
60-64				
2 (неудовлетворительно)	Не зачтено	Ниже 60	F	Неудовлетворительно

7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

7.1 Основная литература

1 Черняк, В. З. Управление инвестиционными проектами : учебное пособие для вузов / В. З. Черняк. — Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2017. — 351 с. — ISBN 5-238-00680-2. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/74946.html>. — Режим доступа: для авторизир. пользователей

2 Анализ и оценка рисков : методические указания к практическому занятию по дисциплине «Управление рисками в образовании» / составители Е. В. Савенкова. — Москва : Московский педагогический государственный университет, 2018. — 24 с. — ISBN 978-5-4263-0652-3. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. —

URL: <http://www.iprbookshop.ru/97807.html>. — Режим доступа: для авторизир. пользователей

Дополнительная литература

1 Черняк, В. З. Управление инвестиционными проектами : учебное пособие для вузов / В. З. Черняк. — Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2017. — 351 с. — ISBN 5-238-00680-2. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/74946.html>. — Режим доступа: для авторизир. пользователей

7.3 Методическое обеспечение

1 Фонд оценочных средств. - Новоуральск, НТИ НИЯУ МИФИ

7.4 Информационное обеспечение

1 <http://nsti.ru>

2 научная библиотека e-librari

3 ЭБС «Лань»

4 ЭБС «IPRbooks»

8. 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)

на 2019/2020 уч.год

В рабочую программу вносятся следующие изменения:
нет изменений

Рабочая программа пересмотрена и одобрена на заседании кафедры

«01» июля 2019г., протокол №4

Заведующий кафедрой _____  О.А. Грицова

на 2020/2021 уч.год

В рабочую программу вносятся следующие изменения:
нет изменений

«01» июля 2020г., протокол №4

Заведующий кафедрой _____  О.А. Грицова

на 2021/2022 уч.год

В рабочую программу вносятся следующие изменения:

Рабочая программа пересмотрена и одобрена на заседании кафедры «__» _____ 20__ г.

Заведующий кафедрой ЭиУ

на 2018/2019 уч.год

Заведующий кафедрой _____  О.А. Грицова

на 2019/2020 уч.год

Заведующий кафедрой _____  О.А. Грицова

на 2020/2021 уч.год

Заведующий кафедрой _____  О.А. Грицова

на 2021/2022 уч.год

Заведующий кафедрой _____  О.А. Грицова