

УТВЕРЖДАЮ
Первый проректор, проректор по
УР

_____ А.Е. Рудин

«21» 02 _ 2023 года

Рабочая программа дисциплины

Б1.В.14 Риск-менеджмент

Учебный план: 2023-2024 38.03.02 ИБК Креат мен в диз и моде ОЗО №1-3-60.plx

Кафедра: **29** Менеджмента

Направление подготовки:
(специальность) 38.03.02 Менеджмент

Профиль подготовки: Креативный менеджмент в дизайне и моде
(специализация)

Уровень образования: бакалавриат

Форма обучения: очно-заочная

План учебного процесса

| Семестр (курс для ЗАО) | Контактная работа обучающихся | | Сам. работа | Контроль, час. | Трудоё мкость, ЗЕТ | Форма промежуточной аттестации | |
|---------------------------|----------------------------------|-------------------|----------------|-------------------|--------------------------|--------------------------------------|-------|
| | Лекции | Практ. занятия | | | | | |
| 4 | УП | 8 | 4 | 92 | 4 | 3 | Зачет |
| | РПД | 8 | 4 | 92 | 4 | 3 | |
| Итого | УП | 8 | 4 | 92 | 4 | 3 | |
| | РПД | 8 | 4 | 92 | 4 | 3 | |

Рабочая программа дисциплины составлена в соответствии с федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент, утверждённым приказом Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 970

Составитель (и):

кандидат экономических наук, Доцент

Касаткин Б.П.

От кафедры составителя:

Заведующий кафедрой менеджмента

Титова Марина
Николаевна

От выпускающей кафедры:

Заведующий кафедрой

Титова Марина
Николаевна

Методический отдел:

1 ВВЕДЕНИЕ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1 Цель дисциплины: Сформировать компетенции обучающегося в области анализа и управления рисками в разных сферах деятельности, принятия решений по выбору наиболее эффективных методов управления и минимизации рисков.

1.2 Задачи дисциплины:

- раскрыть этапы и тенденции мирового опыта исследования рисков, теории рискологии
- раскрыть принципы выбора методов выявления риска, его оценки и определения пределов допустимого риска;
- продемонстрировать особенности разработки методов управления риском,
- раскрыть методы анализа, оценки и планирования последствий реализации рисков

1.3 Требования к предварительной подготовке обучающегося:

Предварительная подготовка предполагает создание основы для формирования компетенций, указанных в п. 2, при изучении дисциплин:

Не предусмотрены

Инновационный менеджмент

2 КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

| |
|---|
| ПК-2: Способен разрабатывать и усовершенствовать кросс-функциональный процесс организации или административный регламент организации креативной сферы |
| Знать: Методы идентификации риска организации креативной сферы, методы анализа и оценки риска (анализ существующих контролей и методов по управлению рисками и их достаточность, анализ последствий рисков, анализ возможностей и оценка вероятности, неопределенности и чувствительности) с учетом поведения потребителей экономических благ на локальных и глобальных рынках |
| Уметь: Определять содержание процесса оценки риска в соответствии с внутренней и внешней средой функционирования организации, а также особые обстоятельства и ограничения; идентифицировать изменения уровня рисков; |
| Владеть: Навыками подготовки предложений по конкретным направлениям изучения рынка с целью определения перспектив развития организации, осуществление координации проведения исследований, направленных на повышение эффективности его производственно-хозяйственной деятельности на основе создания инвестиционных проектов с наименьшей вероятностью риска |
| ПК-8: Способен разрабатывать методическую и нормативную базу системы управления рисками и принципы управления рисками в рамках отдельных бизнес-процессов и функциональных направлений |
| Знать: Законодательство Российской Федерации и отраслевые стандарты по управлению рисками |
| Уметь: Осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики |
| Владеть: Навыками применения методов организации и проведения анализа и оценки рисков; разработки мероприятий по управлению рисками |

3 РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

| Наименование и содержание разделов, тем и учебных занятий | Семестр (курс для ЗАО) | Контактная работа | | СР (часы) | Инновац. формы занятий | Форма текущего контроля |
|--|---------------------------|-------------------|---------------|--------------|------------------------------|-------------------------------|
| | | Лек. (часы) | Пр. (часы) | | | |
| Раздел 1. Общие принципы и понятия риск-менеджмента, история возникновения рискологии | 4 | | | | | Д,Р,О |
| Тема 1. История развития рискологии. Зарубежный опыт риск-менеджмента. Неопределенность. Неопределенность и риск предпринимательской деятельности. | | 2 | | 12 | ГД | |
| Тема 2. Понятие риска. Риск и неопределенность. Характеристики и элементы риска. | | 2 | | 12 | РИ | |
| Тема 3. Классификация рисков. Критерии классификации. Риски в различных сферах деятельности. | | 2 | | 12 | АС | |
| Тема 4. Идеология риск – менеджмента. Управление риском. Цели и методы управления риском. Этапы процесса управления риском. | | 2 | | 12 | ГД | |
| Раздел 2. Применение инструментов риск – менеджмента | | | | | | Д,Р,О |

| | | | | | | |
|---|-------|---|----|----|----|--|
| Тема 5. Методы выявления наличия риска. Проблемно-ориентировочные таблицы, экстраполяционные модели, методы экспертного прогнозирования при выявлении риска. Визуализация риска. Определение уровня приемлемого риска и его пороговых значений. Методика рискованного капитала. | | | 1 | 8 | ГД | |
| Тема 6. Оценка риска. Идентификация и анализ предпринимательского риска. Качественные и количественные методы оценки риска. Объективные и субъективные методы оценки риска. | | | 1 | 12 | РИ | |
| Тема 7. Пути снижения риска. Выбор методов снижения предпринимательского риска, их сущность и значение. Страхование. | | | 1 | 12 | АС | |
| Тема 8. Принятие рисков, ограничение рисков, уклонение от риска. Хеджирование риска, страхование рисков, продажа рисков, обеспечение рисков. | | | 1 | 12 | ГД | |
| Итого в семестре (на курсе для ЗАО) | 8 | 4 | 92 | | | |
| Консультации и промежуточная аттестация (Зачет) | 0,25 | | | | | |
| Всего контактная работа и СР по дисциплине | 12,25 | | 92 | | | |

4 КУРСОВОЕ ПРОЕКТИРОВАНИЕ

Курсовое проектирование учебным планом не предусмотрено

5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

5.1 Описание показателей, критериев и системы оценивания результатов обучения

5.1.1 Показатели оценивания

| Код компетенции | Показатели оценивания результатов обучения | Наименование оценочного средства |
|-----------------|--|---|
| ПК-2 | Перечисляет методы идентификации риска организации креативной сферы, методы анализа и оценки риска с учетом поведения потребителей экономических благ на локальных и глобальных рынках Выявляет и анализирует содержание процесса оценки риска в соответствии с внутренней и внешней средой функционирования организации; Проводит оценку предложений по конкретным направлениям изучения рынка с целью определения перспектив развития организации на основе создания инвестиционных проектов с наименьшей вероятностью риска | Вопросы для устного собеседования Практико-ориентированные задания |
| ПК-8 | Перечисляет отраслевые стандарты по управлению рисками; Выявляет и анализирует ошибки и неточности в расчетах по методикам управления рисками с учетом отраслевой специфики; Проводит оценку эффективности применения методов организации проведения анализа и оценки рисков. | Вопросы для устного собеседования Практико-ориентированные задания |

5.1.2 Система и критерии оценивания

| | | |
|------------------|--|-------------------|
| Шкала оценивания | Критерии оценивания сформированности компетенций | |
| | Устное собеседование | Письменная работа |

| | | |
|------------|--|--|
| Зачтено | Полный, исчерпывающий ответ, явно демонстрирующий глубокое понимание предмета в оцениваемой области. Все заданные вопросы освещены в необходимой полноте и с требуемым качеством. Ошибки отсутствуют. Самостоятельная работа проведена в достаточном объеме, но ограничивается только основными рекомендованными источниками информации. | |
| Не зачтено | Неспособность ответить на вопрос без помощи экзаменатора. Незнание значительной части принципиально важных элементов дисциплины. Многочисленные грубые ошибки. Отсутствие одного или нескольких обязательных элементов задания, либо многочисленные грубые ошибки в работе, либо грубое нарушение правил оформления или сроков представления работы. | |

5.2 Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности

5.2.1 Перечень контрольных вопросов

| № п/п | Формулировки вопросов |
|--------|---|
| Курс 4 | |
| 1 | 1. Основные черты и элементы риска |
| 2 | 2. Риски, их особенности и классификация |
| 3 | 3. Критерии классификации рисков |
| 4 | 4. Внутренние и внешние риски |
| 5 | 5. Предпринимательские риски, основные черты и классификация |
| 6 | 6 Финансовые и коммерческие риски |
| 7 | 7 Внешние риски: страновой, валютный, налоговый и др. |
| 8 | 8 Внутренние риски: организационный, ресурсный, портфельный, кредитный и инновационный |
| 9 | 9 Процесс управления рисками: цели, задачи и стадии управления |
| 10 | 10 Методы управления рисками |
| 11 | 11 Страхование как метод снижения риска |
| 12 | 12 Основные понятия и виды страхования |
| 13 | 13 Способы выявления наличия риска, анализ и визуализация риска |
| 14 | 14 Применение проблемно-ориентировочных таблиц, математического прогнозирования, сценарного метода и метода Дельфи для выявления риска. |
| 15 | 15 Методы анализа риска |
| 16 | 16 Качественная и количественная оценка риска |
| 17 | 17 Основные математические инструменты теории вероятностей, применяемые для оценки риска |

5.2.2 Типовые тестовые задания

Не предусмотрено

5.2.3 Типовые практико-ориентированные задания (задачи, кейсы)

1 Задача: Имеются два варианта вложения капитала. В первом варианте из 100 случаев в 55 был получен доход 100 тыс. р., в 45 случаях – 80 тыс. р. Во втором варианте из 160 случаев в 10 был получен доход 300 тыс. р., в 80 случаях – 110 тыс. р., в 70 случаях - 20 тыс. р. Необходимо выбрать наиболее доходный вариант вложения капитала.

2 Задача: Вы располагаете определенным капиталом и рассматриваете альтернативные возможности вложения его либо в производство кинофильма, либо в торговлю.

Вероятность успеха вложения капитала в кинофильм – 0,2, то же в торговлю – 0,7.

Вероятность неуспеха вложения капитала в кинофильм – 0,8, то же в торговлю – 0,3.

В случае успеха кинофильм дает 90 % прибыли, торговля – 30 %.

В случае неуспеха кинофильм дает 10 %, торговля – 20 %.

Куда выгоднее вложить капитал?

3 Задача: На территории предприятия произошла авария водопровода. Общая длина трубопровода - 150 м, в том числе 50 м трубы приходится на труднодоступные места.

Каков риск того, что ремонт придется производить на труднодоступном участке?

4 Задача: Покупатель хочет купить у продавца товар на 10 млн р. Они оба обращаются в страховое общество, которое страхует сделку и покупателя и продавца. Страховой тариф составляет 10 %. Определить общую сумму страховой премии.

5 Задача: Определить количество застрахованных объектов на предприятии, если страховая сумма по договору страхования составила 40 млн р. По страховому случаю было выплачено возмещение 12 млн р. Число пострадавших объектов - 4 при тяжести ущерба 0,6.

5.3 Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, владений (навыков и (или) практического опыта деятельности)

5.3.1 Условия допуска обучающегося к промежуточной аттестации и порядок ликвидации академической задолженности

Проведение промежуточной аттестации регламентировано локальным нормативным актом СПбГУПТД «Положение о проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся»

5.3.2 Форма проведения промежуточной аттестации по дисциплине

Устная Письменная Компьютерное тестирование Иная

5.3.3 Особенности проведения промежуточной аттестации по дисциплине

В течение семестра выполняется контрольная работа

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

6.1 Учебная литература

| Автор | Заглавие | Издательство | Год издания | Ссылка |
|--|---|--|-------------|---|
| 6.1.1 Основная учебная литература | | | | |
| Таскаева, Н. Н., Прохорова, Ю. С. | Антикризисное управление и риск-менеджмент | Москва: МИСИ-МГСУ, ЭБС АСВ | 2020 | http://www.iprbookshop.ru/101862.html |
| Барбаумов, В. Е., Рогов, М. А., Щукин, Д. Ф., Ситникова, Н. Ю., Бурков, П. В., Тихомиров, С. Н., Лобанов, А. А., Замковой, С. В., Шпрингель, В. К., Голембиовский, Д. Ю., Лобанова, А. А., Чугунова, А. В. | Энциклопедия финансового риск- менеджмента | Москва: Альпина Бизнес Букс | 2020 | http://www.iprbookshop.ru/96867.html |
| 6.1.2 Дополнительная учебная литература | | | | |
| Цибульникова, В. Е. | Риск-менеджмент в образовании | Москва: Московский педагогический государственный университет | 2016 | http://www.iprbookshop.ru/72529.html |
| Чигиринова М. В. | Риск-менеджмент. Самостоятельная работа. Контрольные работы | СПб.: СПбГУПТД | 2018 | http://publish.sutd.ru/tp_ext_inf_publish.php?id=2018351 |

| | | | | |
|------------------|---|---|------|---|
| Чигиринова М. В. | Риск-менеджмент. Практические занятия. Самостоятельная работа | СПб.: СПбГУПТД | 2017 | http://publish.sutd.ru/tp_ext_inf_publish.php?id=2017619 |
| Фомичев А.Н. | Риск-менеджмент | Москва: Дашков и К | 2016 | https://ibooks.ru/reading.php?short=1&productid=355383 |
| Пасько, Е. А. | Риск-менеджмент в корпоративном бизнесе | Ставрополь: Северо-Кавказский федеральный университет | 2016 | http://www.iprbookshop.ru/69431.html |

6.2 Перечень профессиональных баз данных и информационно-справочных систем

1. База данных Минэкономразвития РФ «Информационные системы Министерства в сети Интернет» [Электронный ресурс]. URL: <http://economy.gov.ru/minec/about/systems/infosystems/>
2. База программных средств налогового учета [Электронный ресурс]. URL: <https://www.nalog.ru/m39/program/>
3. Федеральный образовательный портал «Экономика Социология Менеджмент» [Электронный ресурс]. URL: <http://ecsocman.hse.ru>
4. Базы данных информационного портала Restko.ru (Информационные системы рынка рекламы, маркетинга, PR – Базы рынка рекламы [Электронный ресурс]. URL: <https://www.restko.ru/>

6.3 Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения

MicrosoftOfficeProfessional

Microsoft Windows

6.4 Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине

| Аудитория | Оснащение |
|--------------------|---|
| Компьютерный класс | Мультимедийное оборудование, компьютерная техника с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду |
| Учебная аудитория | Специализированная мебель, доска |