

МИНОБРНАУКИ РОССИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»
(ТвГТУ)

УТВЕРЖДАЮ
Проректор
по учебной работе
_____ Э.Ю. Майкова
« _____ » _____ 2021г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА
дисциплины части, формируемой участниками образовательных отношений
Блока 1 «Дисциплины (модули)»
«Риск-менеджмент в деталях предприятия»

Направление подготовки магистров – 38.04.02 Менеджмент
Направленность (профиль) – Производственный менеджмент.
Типы задач профессиональной деятельности: организационно-
управленческий.

Форма обучения – очная и очно-заочная

Факультет управления и социальных коммуникаций
Кафедра «Менеджмент»

Тверь 2021

Рабочая программа дисциплины соответствует ОХОП подготовки магистров в части требований к результатам обучения по дисциплине и учебному плану.

Разработчик программы к.э.н. доцент

О.А. Белоусов

Программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры Информационные системы «__» _____ 20__ г., протокол № ____.

Заведующий кафедрой

О.П. Разинькова

Согласовано:

Начальник учебно-методического
отдела УМУ

Д.А. Барчуков

Начальник отдела
комплектования
зональной научной библиотеки

О.Ф. Жмыхова

1. Цели и задачи дисциплины

Целью изучения дисциплины «Риск-менеджмент в деятельности предприятия» является комплексное рассмотрение рисков разной природы, знание и управление которыми необходимы для выполнения функций риск-менеджера на предприятиях и фирмах различных форм собственности.

Задачи дисциплины:

- приобретение теоретической подготовки в области анализа методов управления рисками, классификации рисков разной природы;
- формирование умений по составлению программы управления риском; использованию различных мер риска в контексте экономических методик (применение дисперсий, вычисление рискового капитала, измерение экономической добавленной стоимости); учета риска при управлении бизнес-процессами; принимать решения в процессах, связанных с созданием эффективной системы риск-менеджмента и ее функционированием;
- овладение методом анализа различных экономических ситуаций с точки зрения управления риском.

2. Место дисциплины в структуре ООП

Дисциплина " Риск-менеджмент в деятельности предприятия " относится к части, формируемой участниками образовательных отношений Блока 1 ОП ВО. Освоение дисциплины опирается на теоретические знания, полученные магистрантом при изучении дисциплин: «Современные парадигмы эволюции менеджмента», «Современные проблемы науки и управления», «Управленческая экономика», «Управление проектами», «Финансовый менеджмент».

Приобретенные знания в рамках дисциплины необходимы для формирования наряду с другими изучаемыми дисциплинами целостного представления о направлении «Менеджмент», а также при написании магистерской диссертации.

3. Планируемые результаты обучения по дисциплине

3.1 Планируемые результаты обучения по дисциплине

Компетенция, закреплённая за дисциплиной в ОХОП:

ПК-2. Способен руководить разработкой системы интегральных показателей производственной, сбытовой, финансовой деятельности машиностроительной организации, корректировкой плановых показателей в ходе координационной работы со службами.

Индикаторы компетенций, закреплённых за дисциплиной в ОХОП:

ИПК-2.4. Руководит разработкой системы интегральных показателей деятельности машиностроительной организации и корректирует плановые показатели в ходе координационной работы со службами, организует разработку мероприятий по эффективному использованию капитальных вложений, материальных, трудовых и финансовых ресурсов, повышению конкурентоспособности выпускаемой продукции, производительности труда, снижению издержек на производство и реализацию продукции, повышению рентабельности производства, увеличению прибыли, устранению потерь и

непроизводительных расходов.

Компетенция, закреплённая за дисциплиной в ОХОП:

ПК-4. Способен руководить корректировкой планов производственных, сбытовых, экономических и финансовых служб в случае ограничения их исходных планов по причине неувязки с планами по другим областям деятельности.

Индикаторы компетенций, закрепленных за дисциплиной в ОХОП:

ИПК-4.1. Корректирует планы производственных служб в случае ограничения их исходных планов по причине неувязки с планами по другим областям деятельности с целью организации рациональной хозяйственной деятельности, выявляет и использует резервы производства с целью достижения наибольшей эффективности работы предприятия.

ИПК-4.2. Корректирует планы сбытовых служб в случае ограничения их исходных планов по причине неувязки с планами по другим областям деятельности в соответствии с потребностями рынка и возможностями получения необходимых ресурсов.

ИПК-4.3. Корректирует планы экономических и финансовых служб в случае ограничения их исходных планов по причине неувязки с планами по другим областям деятельности.

ИПК-2.4.

Показатели оценивания индикаторов достижения компетенций

Знать:

31. Принципы руководства разработкой системы интегральных показателей деятельности машиностроительной организации и корректировки плановых показателей в ходе координационной работы со службами, организации разработки мероприятий по эффективному использованию капитальных вложений, материальных, трудовых и финансовых ресурсов, повышения конкурентоспособности выпускаемой продукции, производительности труда, снижения издержек на производство и реализацию продукции, повышения рентабельности производства, увеличения прибыли, устранения потерь и непроизводительных расходов

Уметь:

У1. Осуществлять руководство разработкой системы интегральных показателей деятельности машиностроительной организации и корректировкой плановых показателей в ходе координационной работы со службами, организацией разработки мероприятий по эффективному использованию капитальных вложений, материальных, трудовых и финансовых ресурсов, повышением конкурентоспособности выпускаемой продукции, производительности труда, снижением издержек на производство и реализацию продукции, повышением рентабельности производства, увеличением прибыли, устранением потерь и непроизводительных расходов

Иметь опыт практической подготовки:

ПП1: Осуществления руководства разработкой системы интегральных показателей деятельности машиностроительной организации и корректировкой

плановых показателей в ходе координационной работы со службами, организации разработки мероприятий по эффективному использованию капитальных вложений, материальных, трудовых и финансовых ресурсов, повышения конкурентоспособности выпускаемой продукции, производительности труда, снижения издержек на производство и реализацию продукции, повышения рентабельности производства, увеличения прибыли, устранения потерь и непроизводительных расходов

ИПК-4.1.

Показатели оценивания индикаторов достижения компетенций

Знать:

32. Принципы корректировки планов производственных служб в случае ограничения их исходных планов по причине неувязки с планами по другим областям деятельности с целью организации рациональной хозяйственной деятельности, выявления и использования резервов производства с целью достижения наибольшей эффективности работы предприятия

Уметь:

У2. корректировать планы производственных служб в случае ограничения их исходных планов по причине неувязки с планами по другим областям деятельности с целью организации рациональной хозяйственной деятельности, выявить и использовать резервы производства с целью достижения наибольшей эффективности работы предприятия

Иметь опыт практической подготовки:

ПП2: корректировки планов производственных служб в случае ограничения их исходных планов по причине неувязки с планами по другим областям деятельности с целью организации рациональной хозяйственной деятельности, выявления и использования резервов производства с целью достижения наибольшей эффективности работы предприятия

ИПК-4.2.

Показатели оценивания индикаторов достижения компетенций

Знать:

33. Принципы корректировки планов сбытовых служб в случае ограничения их исходных планов по причине неувязки с планами по другим областям деятельности в соответствии с потребностями рынка и возможностями получения необходимых ресурсов

Уметь:

У3. корректировать планы сбытовых служб в случае ограничения их исходных планов по причине неувязки с планами по другим областям деятельности в соответствии с потребностями рынка и возможностями получения необходимых ресурсов

Иметь опыт практической подготовки:

ПП3: корректировки планов сбытовых служб в случае ограничения их исходных планов по причине неувязки с планами по другим областям

деятельности в соответствии с потребностями рынка и возможностями получения необходимых ресурсов

ИПК-4.3.

Показатели оценивания индикаторов достижения компетенций

Знать:

ЗЗ. Принципы корректировки планов экономических и финансовых служб в случае ограничения их исходных планов по причине неувязки с планами по другим областям деятельности

Уметь:

УЗ. корректировать планы экономических и финансовых служб в случае ограничения их исходных планов по причине неувязки с планами по другим областям деятельности

Иметь опыт практической подготовки:

ППЗ: корректировки планов экономических и финансовых служб в случае ограничения их исходных планов по причине неувязки с планами по другим областям деятельности

3.2. Технологии, обеспечивающие формирование компетенций

Проведение лекций, практических и самостоятельных работ.

4. Трудоёмкость дисциплины и виды учебной работы

ОЧНАЯ ФОРМА ОБУЧЕНИЯ

Таблица 1а. Распределение трудоёмкости дисциплины по видам учебной работы

Вид учебной работы	Зачётных единиц	Академические часы
Общая трудоёмкость дисциплины	2	72
Аудиторные занятия (всего)		26
в том числе:		
Лекции		13
Практические занятия (ПЗ)		13
Лабораторные работы (ЛР)		не предусмотрены
Самостоятельная работа обучающихся (всего)		46
в том числе:		
Курсовая работа		не предусмотрена
Курсовой проект		не предусмотрен
Расчетно-графические работы		не предусмотрены
Другие виды самостоятельной работы: - подготовка к практическим работам и к их защите		46
Контроль текущий и промежуточный (бально-рейтинговый, зачёт)		0
Практическая подготовка при реализации дисциплины (всего)		13
Практические занятия (ПЗ)		13
Лабораторные работы (ЛР)		не предусмотрены

Курсовая работа		не предусмотрена
Курсовой проект		не предусмотрен

ОЧНО-ЗАОЧНАЯ ФОРМА ОБУЧЕНИЯ

Таблица 16. Распределение трудоёмкости дисциплины по видам учебной работы

Вид учебной работы	Зачётных единиц	Академические часы
Общая трудоёмкость дисциплины	2	72
Аудиторные занятия (всего)		18
в том числе:		
Лекции		8
Практические занятия (ПЗ)		10
Лабораторные работы (ЛР)		не предусмотрены
Самостоятельная работа обучающихся (всего)		54
в том числе:		
Курсовая работа		не предусмотрена
Курсовой проект		не предусмотрен
Расчетно-графические работы		не предусмотрены
Другие виды самостоятельной работы: - подготовка к практическим работам и к их защите		54
Контроль текущий и промежуточный (бально-рейтинговый, зачёт)		0
Практическая подготовка при реализации дисциплины (всего)		10
Практические занятия (ПЗ)		10
Лабораторные работы (ЛР)		не предусмотрены
Курсовая работа		не предусмотрена
Курсовой проект		не предусмотрен

5. Структура и содержание дисциплины

5.1. Структура дисциплины

ОЧНАЯ ФОРМА ОБУЧЕНИЯ

Таблица 2а. Модули (разделы) дисциплины, трудоёмкость в часах и виды учебной работы.

Наименование модуля	Труд-ть	Лекц ии	Прак тич. занят ия	Лаб. работ ы	Сам. работа
1. Основные понятия управления рисками. Эволюция развития риск-менеджмента	7	1	1	-	5

2. Классические и современные теории рисков	7,5	1,5	1,5	-	4,5
3. Типы фирм с повышенной степенью риска	7	1	1	-	5
4. Методы управления рисками	7,5	1,5	1,5	-	4,5
5. Система управления рисками фирмы	7	1	1	-	5
6. Особенности управления финансовыми операционными и бизнес рисками фирмы	7,5	1,5	1,5	-	4,5
7. Риски в маркетинге	7	1	1	-	5
8. Страхование предпринимательских рисков	7,5	1,5	1,5	-	4,5
9. Комплексный риск менеджмент	7	1,5	1,5	-	4
10. Измерение и оценка эффективности управления рисками фирмы	7	1,5	1,5	-	4
Всего на дисциплину	72	13	13	-	46

ОЧНО-ЗАОЧНАЯ ФОРМА ОБУЧЕНИЯ

Таблица 26. Модули (разделы) дисциплины, трудоёмкость в часах и виды учебной работы.

Наименование модуля	Труд-ть	Лекц ии	Практ ич. занят ия	Лаб. работ ы	Сам. работа
1. Основные понятия управления рисками. Эволюция развития риск-менеджмента	7	0,5	1	-	5,5
2. Классические и современные теории рисков	7,5	1	1	-	5,5
3. Типы фирм с повышенной степенью риска	7	0,5	1	-	5,5
4. Методы управления рисками	7,5	1	1	-	5,5
5. Система управления рисками фирмы	7	0,5	1	-	5,5
6. Особенности управления финансовыми операционными и бизнес рисками фирмы	7,5	1	1	-	5,5
7. Риски в маркетинге	7	0,5	1	-	5,5
8. Страхование предпринимательских рисков	7,5	1	1	-	5,5

9. Комплексный риск менеджмент	7	1	1	-	5
10. Измерение и оценка эффективности управления рисками фирмы	7	1	1	-	5
Всего на дисциплину	72	8	10	-	54

5.2 Содержание дисциплины

МОДУЛЬ 1 «Основные понятия управления рисками. Эволюция развития риск-менеджмента»

Понятие и ситуация риска. Неопределенность и ситуация риска. Природа неопределённости. Классификации риска. Основные и второстепенные функции риск-менеджмента. Эволюция риск-менеджмента. Цели комплексного риск-менеджмента. Факторы, способствовавшие развитию риск-менеджмента как самостоятельной дисциплины и сферы деятельности.

МОДУЛЬ 2 «Классические и современные теории рисков»

Классическая теория предпринимательского риска (Дж. Милль, Н. Сениор). Основы неоклассической теории предпринимательского риска (А. Маршалл и А. Пигу). Кейсианская экономическая школа. Подход Ф. Найта. Проблемы риска в отечественной экономической науке в теоретических работах А.П. Альгина, С.Н. Кошеленко, И.М. Сыроежина, Д.Н. Назарова, Д.В. Тулина.

МОДУЛЬ 3 «Типы фирм с повышенной степенью риска»

Понятие кримтипологии фирмы. Причины появления фирм с повышенной степенью риска. Типичные отличительные черты фирм с повышенной степенью риска. Фирмы личных услуг. «Фирмы-зомби». «Жиро-фирмы»: аккумуляторы и операторы. «Псевдофирмы». Фирмы-конструктивы: основные виды. «Фантомные фирмы» и их специфика. Собственность партнерской фирмы

МОДУЛЬ 4 «Методы управления рисками»

Две стороны риска: вероятность потерь и величина потерь. Методы управления рисками: методы минимизации и возмещения потерь. Количественные методы оценки рисков: метод аналогий, анализ вероятностных распределений потоков платежей, метод сценариев, метод корректировки нормы дисконта, метод ставки процента с оплатой за риск. Принятие решений на основе математического ожидания и дисперсии. Дисперсия как мера риска. Показатели корреляции и ковариации. Оценка по историческим данным, экспертный метод, натуральное моделирование. Метод многофакторного анализа риска. Метод оценки стоимости риска — VaR (Value-at-Risk). Методология VaR. Метод оценки рисков Stress Testing. Основные задачи и принципы стрессового тестирования. Подходы к организации стресс-тестирования в кредитных организациях (на основе обзора международной финансовой практики)

МОДУЛЬ 5 «Система управления рисками фирмы»

Этапы управления рисками. Процесс управления рисками: целеполагание, маркетинг, менеджмент. Системный подход в управлении рисками. Классификация решений управления рисками. Организация управления рисками. Снижение

рисков: на этапе планирования операции или проектирования образцов; на этапе принятия решений, с использованием критериев оценки эффективности решения (критерии Вальда и Сэвиджа); на этапе выполнения операции и эксплуатации технических систем. Риск-решения традиционного, системного, ситуационного, социально-этичного менеджмента. Типовые алгоритмы риск-решений. Алгоритм принятия решений при традиционном, системном и ситуационном риск-менеджменте комиссия и тантьема.

МОДУЛЬ 6 «Особенности управления финансовыми операционными и бизнес рисками фирмы»

Сущность, критерии и особенности финансовых рисков. Классификации финансовых рисков. Риск нарушения равновесия финансового развития. Риск неплатежеспособности предприятия. Страхование риска потери прибыли. Основные элементы при расчете размеров ущерба: текущие расходы и упущенная прибыль. Управление активами и пассивами в коммерческой структуре. Стратегия управления активами и пассивами. Содержание стратегии управления и ее взаимосвязь с устойчивостью банка. Организационная функция управления активами и пассивами. Риск ликвидности. Факторы, влияющие на уровень риска ликвидности. Методы управления ликвидностью. Управление риском ликвидности: лимит текущей и перспективной ликвидности. Разрывы срочной структуры (лестница сроков). Достаточность капитала банков. Внутренние риски: кредитные, процентные, валютные, рыночные риски и риски финансовых услуг. Внешние риски (международные, страновые, республиканские, региональные): страховые риски, риски стихийных бедствий, правовые (законодательные) риски, конкурентные риски, политические, социальные, экономические, финансовые риски, риски перевода, организационные и отраслевые риски. Банковские риски. Управление кредитным риском. Банковские риски: операционные, технологические, стратегические, бухгалтерские, административные риски, риски инноваций, риски злоупотреблений, риски безопасности. Система внутреннего контроля в банках: основы, принципы и инструменты. Сущность, особенности, классификации операционных и трансляционных рисков. Валютный риск и его разновидности: экономический риск, риск перевода, риск сделок. Управление валютным риском. Процентный риск. Управление в лицензии.

МОДУЛЬ 7 «Риски в маркетинге»

Сущность и особенности маркетинговых рисков. Виды маркетинговых рисков: внешние и внутренние риски, объективные и субъективные. Управление рисками при проведении маркетинговых исследований. Проблемы ценообразования: недооценка двойственной роли сознания в решении о покупке, игнорирование степени осознания потребности в новом товаре, неадекватная ценовая политика, попадание в «неплатёжеспособный рыночный сегмент», ценовая не пластичность, конвертационные риски. Риски, вызванные конкуренцией фирм на рынке. Сбыт продукции риски, с ним связанные. Выполнение маркетинговых работ: телефонный маркетинг, веер-маркетинг, маркетинг плотным взаимодействием.

МОДУЛЬ 8 «Страхование предпринимательских рисков»

Понятие страхования. Признаки экономической категории страхования. Предпосылки для страхования рисков. Страховой договор, страховая премия. Лицензируемые виды страхования. Франшиза: понятие, виды и влияние на страховое возмещение. Сущность и особенности страхования предпринимательских рисков. Классификации страхования предпринимательских рисков: страхование на случай простоя и страхование рисков, связанных с нарушением контрагентами договорных обязательств.

МОДУЛЬ 9 «Комплексный риск менеджмент»

Предпосылки формирования современной парадигмы риск-менеджмента на уровне предприятия. Концепция комплексной системы управления рисками предприятий (Enterprise-wide risk-management, EWRM). Концепция EVA (Economic Value Added) и оценка эффективности деятельности компании. Экономическая добавленная стоимость. Понятие «свободные денежные потоки» (Free Cash Flow). Дисконтирование денежных потоков (Discounted Cash Flow). Способы расчета и интерпретация показателя EVA. Расчет чистых операционных активов. Определение величины операционного результата хозяйствования (NOPAT). EVA в качестве показателя финансового анализа. Оценка EVA как показателя стоимости. Анализ ценности риска. Концепция RAROC (Risk-Adjusted Return on Capital - скорректированная на риск доходность капитала). История RAROC. Экономический капитал и виды риска. Экономическая прибыль. Ценность метода управления рисками.

МОДУЛЬ 10 «Измерение и оценка эффективности управления рисками фирмы»

Многообразие существующих теоретических и практических подходов к оценке эффективности управления в рамках фирмы. Три уровня системы управления и его эффективности. Питер Друккер: ключевые факторы успеха фирмы. Основные факторы эффективности: действенность, экономичность, качество, производительность, качество трудовой жизни, прибыльность, нововведения. Системный подход в оценке эффективности управления фирмой. Предпосылки становления и принципы системного подхода. Условия применения системного подхода. Показатели и основные группы критериев эффективности управления фирмой. Основные аспекты адаптации как свойств эффективного управления фирмой; оценка реальной эффективности управления; направления оценки экономичности. Изменения в технологическом базисе производства. Изменения в качестве рабочей силы. Внешние и внутренние социально-экономические условия. Цели повышения эффективности управления. Экспертные методы. Метод простой ранжировки, метод задания весовых коэффициентов, метод последовательных сравнений и метод парных сравнений.

5.3 Практические занятия

ОЧНАЯ ФОРМА ОБУЧЕНИЯ

Таблица 3а. Практические занятия и их трудоёмкость.

Порядковый номер модуля. Цель практического занятия	Тематика практического занятия	Трудоем- кость, ч
--	---	------------------------------

Порядковый номер модуля. Цель практического занятия	Тематика практического занятия	Трудоём- кость, ч
Модуль 1 Цель: изучение основных понятий риск-менеджмента, истории зарождения и перспектив развития	1. Классификации рисков. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
Модуль 2 Цель: рассмотрение классических и современных теорий рисков	1. Неоклассическая теория предпринимательского риска. 2. Кейсианская экономическая школа. 3. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1,5
Модуль 3 Цель: изучение особенностей типов фирм с повышенной степенью риска	1. Отличительные черты фирм с повышенной степенью риска. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
Модуль 4 Цель: изучение методов управления рисками	1. Методы оценки рисков. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1,5
Модуль 5 Цель: изучение системы управления рисками фирмы	1. Типовые алгоритмы риск-решений. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
Модуль 6 Цель: ознакомление с особенностями управления финансовыми операционными и бизнес рисками предприятия	1. Критерии и особенности финансовых рисков. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1,5
Модуль 7 Цель: изучение основных маркетинговых рисков	1. Управление рисками в маркетинговых исследованиях. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
Модуль 8 Цель: рассмотрение страхования предпринимательских рисков	1. Современная парадигма риск-менеджмента на уровне предприятия. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1,5
Модуль 9 Цель: изучение концепций комплексных систем риск менеджмента	1. Концепции комплексных систем риск менеджмента 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1,5
Модуль 10 Цель: измерение и оценка эффективности управления рисками фирмы	1. Показатели и основные группы критериев эффективности управления фирмой. 2. Экспертные методы. 3. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1,5

ОЧНО-ЗАОЧНАЯ ФОРМА ОБУЧЕНИЯ

Таблица 3б. Практические занятия и их трудоёмкость.

Порядковый номер модуля. Цель практического занятия	Тематика практического занятия	Трудоём- кость, ч
Модуль 1 Цель: изучение основных понятий риск-менеджмента, истории зарождения и перспектив развития	1. Классификации рисков. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
Модуль 2 Цель: рассмотрение классических и современных теорий рисков	1. Неоклассическая теория предпринимательского риска. 1. Кейсианская экономическая школа. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
Модуль 3 Цель: изучение особенностей типов фирм с повышенной степенью риска	1. Отличительные черты фирм с повышенной степенью риска. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
Модуль 4 Цель: изучение методов управления рисками	1. Методы оценки рисков. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
Модуль 5 Цель: изучение системы управления рисками фирмы	1. Типовые алгоритмы риск-решений. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
Модуль 6 Цель: ознакомление с особенностями управления финансовыми операционными и бизнес рисками предприятия	1. Критерии и особенности финансовых рисков. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
Модуль 7 Цель: изучение основных маркетинговых рисков	1. Управление рисками в маркетинговых исследованиях. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
Модуль 8 Цель: рассмотрение страхования предпринимательских рисков	1. Современная парадигма риск-менеджмента на уровне предприятия. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
Модуль 9	1. Концепции комплексных систем риск	1

Порядковый номер модуля. Цель практического занятия	Тематика практического занятия	Трудоем- кость, ч
Цель: изучение концепций комплексных систем риск менеджмента	менеджмента 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	
Модуль 10 Цель: измерение и оценка эффективности управления рисками фирмы	1. Показатели и основные группы критериев эффективности управления фирмой. 2. Экспертные методы. 3. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1

6. Самостоятельная работа обучающихся и текущий контроль успеваемости

6.1 Цели самостоятельной работы

Формирование способностей к самостоятельному познанию и обучению, поиску литературы, обобщению, оформлению и представлению полученных результатов, их критическому анализу, поиску новых и неординарных решений, аргументированному отстаиванию своих предложений, умений подготовки выступлений и ведения дискуссий.

6.2 Организация и содержание самостоятельной работы

Самостоятельная работа заключается в изучении отдельных тем курса по заданию преподавателя по рекомендуемым им источникам, в подготовке к практическим занятиям, текущему контролю успеваемости, зачета.

Предусмотрено 35 практических занятий, которые защищаются посредством тестирования или устного опроса (по желанию обучающегося). Максимальная оценка за выполненную работу — 10 баллов.

Выполнение всех практических работ обязательно. В случае невыполнения практической работы по уважительной причине студент имеет право выполнить письменный реферат по согласованной с преподавателем теме модуля, по которому пропущена практическая работа.

Возможная тематическая направленность реферативной работы для каждого учебно-образовательного модуля представлена в таблице 4.

Таблица 4. Темы рефератов

№ п/п	Модуль	Возможная тематика самостоятельной реферативной работы
1	Модуль 1	Эволюция взглядов на риск
		Неопределенность и ее природа
		Классификации рисков
		Цели и функции риск-менеджмента
2	Модуль 2	Развитие классической теории предпринимательского риска
		Основы неоклассической теории предпринимательского риска
		Кейсианская экономическая школа

№ п/п	Модуль	Возможная тематика самостоятельной реферативной работы
		Проблемы риска в отечественной экономической науке
3	Модуль 3	Понятие и отличительные черты фирм с повышенной степенью риска
		«Фирмы-зомби»
		«Жиро-фирмы»
		«Псевдофирмы»
		Фирмы-конструктивы
		«Фантомные фирмы»
		Партнерские фирмы
4	Модуль 4	Количественные методы оценки рисков
		Принятие решений на основе математического ожидания и дисперсии
		Оценка по историческим данным, экспертный метод, натуральное моделирование
		Метод многофакторного анализа риска
		Метод оценки стоимости риска (Value-at-Risk)
		Stress Testing: основные задачи и принципы
		Подходы к организации стресс-тестирования в кредитных организациях
5	Модуль 5	Системный подход в управлении рисками
		Классификация решений управления рисками
		Критерии Вальда и Сэвиджа
		Риск-решения традиционного, системного, ситуационного, социально-этичного менеджмента
		Типовые алгоритмы риск-решений
6	Модуль 6	Сущность, критерии и особенности финансовых рисков
		Классификации финансовых рисков
		Страхование риска потери прибыли
		Управление активами и пассивами в коммерческой структуре
		Риск ликвидности
		Внутренние и внешние риски

№ п/п	Модуль	Возможная тематика самостоятельной реферативной работы
		Банковские риски
		Операционные и трансляционные риски
		Валютный риск и его разновидности
		Процентный риск
7	Модуль 7	Классификация маркетинговых рисков
		Управление рисками в маркетинговых исследованиях
		Риски, вызванные конкуренцией фирм на рынке
		Конвертационные риски
8	Модуль 8	Сущность и особенности страхования предпринимательских рисков
		Классификации страхования предпринимательских рисков
		Страховой договор, страховая премия
		Лицензируемые виды страхования
		Франшиза
9	Модуль 9	Современная парадигма риск-менеджмента на уровне предприятия
		Концепция комплексной системы управления рисками предприятий (EWRM)
		Концепция EVA
		Понятие «свободные денежные потоки». Дисконтирование денежных потоков
		Концепция RAROC
10	Модуль 10	Факторы эффективности
		Предпосылки становления и принципы системного подхода
		Показатели и основные группы критериев эффективности управления фирмой
		Экспертные методы

Оценивание реферата по содержанию и качеству выполнения осуществляется путем устного опроса.

7. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

7.1 Основная литература

1. Вяткин, В.Н. Риск-менеджмент : учебник : в составе учебно-методического комплекса / В.Н. Вяткин, В.А. Гамза, Ф.В. Маевский. - 2-е изд. - Москва : Юрайт, 2022. - (Высшее образование). - Образовательная платформа Юрайт. - Текст : электронный. - Режим доступа: по подписке. - Дата обращения:

- 07.07.2022. - ISBN 978-5-9916-3502-8. - URL: <https://urait.ru/bcode/489098> . - (ID=109444-0)
2. Фомичев, А.Н. Риск-менеджмент : учебник : в составе учебно-методического комплекса / А.Н. Фомичев. - 8-е изд. ; перераб. - Москва : Дашков и К, 2021. - (Учебные издания для бакалавров). - ЭБС Лань. - Текст : электронный. - Режим доступа: по подписке. - Дата обращения: 09.08.2022. - ISBN 978-5-394-04273-7. - URL: <https://e.lanbook.com/book/229715> . - (ID=114297-0)

7.2 Дополнительная литература

1. Круи, М. Основы риск-менеджмента = The essentials of risk management / М. Круи, Д. Галай, Р. Марк; научный редактор В.Б. Минасян. - Москва : Юрайт, 2022. - (Высшее образование). - Образовательная платформа Юрайт. - Текст : электронный. - Режим доступа: по подписке. - Дата обращения: 07.07.2022. - ISBN 978-5-534-02578-1. - URL: <https://urait.ru/bcode/488656> . - (ID=106244-0)
2. Ермасова, Н.Б. Риск-менеджмент организации : учеб.-практ. пособие : в составе учебно-методического комплекса / Н.Б. Ермасова. - М. : Дашков и К, 2013. - 379 с. - (УМК-У). - Текст : непосредственный. - ISBN 978-5-394-01777-3 : 253 p. - (ID=96876-3)
3. Риск-менеджмент инвестиционного проекта : учебник для вузов по экон. спец. / под ред.: М.В. Грачевой, А.Б. Секерина. - М. : ЮНИТИ-ДАНА, 2009. - 544 с. - Текст : непосредственный. - ISBN 978-5-238-01506-4 : 350 p. - (ID=76631-10)
4. Гончаренко, Л.П. Риск-менеджмент : учеб. пособие / Л.П. Гончаренко, С.А. Филин; Российская экономическая школа имени Г.В. Плеханова ; под ред. Е.Ф. Олейникова. - 3-е изд. ; стер. - М. : КноРус, 2008. - 213 с. - Библиогр. : с. 214 - 215. - Текст : непосредственный. - ISBN 5-390-00128-8 : 81 p. - (ID=75831-14)
5. Балдин, К.В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учебное пособие для вузов / К.В. Балдин, И.И. Передеряев, Р.С. Голов. - 5-е изд. ; стер. - Москва : Дашков и К, 2021. - ЭБС Лань. - Текст : электронный. - Режим доступа: по подписке. - Дата обращения: 12.09.2022. - ISBN <https://e.lanbook.com/book/171857>. - URL: <https://e.lanbook.com/book/229964> . - (ID=74507-0)
6. Касьяненко, Т.Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе : учебник и практикум для вузов : в составе учебно-методического комплекса / Т.Г. Касьяненко, Г.А. Маховикова. - 2-е изд. ; перераб. и доп. - Москва : Юрайт, 2022. - (Высшее образование) (УМК-У). - Образовательная платформа Юрайт. - Текст : электронный. - Режим доступа: по подписке. - Дата обращения: 07.07.2022. - ISBN 978-5-534-00375-8. - URL: <https://urait.ru/bcode/489052> . - (ID=106296-0)
7. Савенкова, Е.В. Анализ и оценка рисков : методические указания / Е.В. Савенкова; Савенкова Е.В.; составитель Е.В. Савенкова. - 2018 ; Москва : МПГУ. - Текст : электронный. - ISBN 978-5-4263-0652-3. - URL: <https://e.lanbook.com/book/122348> . - (ID=146002-0)

7.3 Методические материалы

1. Вопросы для подготовки к зачету по дисциплине "Риск-менеджмент в деятельности фирмы". Направление подготовки 38.04.02 Менеджмент. Профиль: Производственный менеджмент : в составе учебно-методического комплекса / Тверской гос. техн. ун-т, Каф. МЕН ; разработ. О.А. Белоусов. - Тверь : ТвГТУ, 2016. - (УМК-В). - Текст : электронный. - URL: <https://elib.tstu.tver.ru/MegaPro/GetDoc/Megapro/122570> . - (ID=122570-0)

2. Методические указания по выполнению практических работ по дисциплине "Риск-менеджмент в деятельности фирмы". Направление подготовки 38.04.02 Менеджмент. Профиль: Производственный менеджмент : в составе учебно-методического комплекса / Тверской гос. техн. ун-т, Каф. МЕН ; разработ. О.А. Белоусов. - Тверь : ТвГТУ, 2016. - (УМК-П). - Текст : электронный. - URL: <https://elib.tstu.tver.ru/MegaPro/GetDoc/Megapro/122569> . - (ID=122569-0)

3. Оценочные средства промежуточной аттестации в форме зачета по дисциплине "Риск-менеджмент в деятельности фирмы". Направление подготовки 38.04.02 Менеджмент. Профиль: Производственный менеджмент : в составе учебно-методического комплекса / Тверской гос. техн. ун-т, Каф. МЕН ; разработ. О.А. Белоусов. - Тверь : ТвГТУ, 2016. - (УМК-Э). - Текст : электронный. - Режим доступа: с разрешения преподавателя. - (ID=122571-0)

4. Тезисы лекций по дисциплине "Риск-менеджмент в деятельности фирмы". Направление подготовки 38.04.02 Менеджмент. Профиль: Производственный менеджмент : в составе учебно-методического комплекса / Тверской гос. техн. ун-т, Каф. МЕН ; разработ. О.А. Белоусов. - Тверь : ТвГТУ, 2016. - (УМК-Л). - Текст : электронный. - URL: <https://elib.tstu.tver.ru/MegaPro/GetDoc/Megapro/122568> . - (ID=122568-0)

5. Учебно-методический комплекс дисциплины части, формируемой участниками образовательных отношений Блока 1 "Дисциплины (модули)" "Риск-менеджмент в деятельности предприятия". Направление подготовки 38.04.02 Менеджмент. Направленность (профиль): Производственный менеджмент : ФГОС 3++ / Тверской гос. техн. ун-т, Каф. Менеджмент ; сост. О.А. Белоусов. - Тверь, 2022. - (УМК). - Текст : электронный. - 0-00. - URL: <https://elib.tstu.tver.ru/MegaPro/GetDoc/Megapro/114592> . - (ID=114592-1)

7.4 Программное обеспечение по дисциплине

Операционная система Microsoft Windows: лицензии № ICM-176609 и № ICM-176613 (Azure Dev Tools for Teaching).

Microsoft Office 2007 Russian Academic: OPEN No Level: лицензия № 41902814.

7.5. Специализированные базы данных, справочные системы, электронно-библиотечные системы, профессиональные порталы в Интернет

ЭБС и лицензионные ресурсы ТвГТУ размещены:

1. Ресурсы: <https://lib.tstu.tver.ru/header/obr-res>
2. ЭК ТвГТУ: <https://elib.tstu.tver.ru/MegaPro/Web>

3. ЭБС "Лань": <https://e.lanbook.com/>
4. ЭБС "Университетская библиотека онлайн": <https://www.biblioclub.ru/>
5. ЭБС «IPRBooks»: <https://www.iprbookshop.ru/>
6. Электронная образовательная платформа "Юрайт" (ЭБС «Юрайт»): <https://urait.ru/>
7. Научная электронная библиотека eLIBRARY: <https://elibrary.ru/>
8. Информационная система "ТЕХНОРМАТИВ". Конфигурация "МАКСИМУМ" : сетевая версия (годовое обновление) : [нормативно-технические, нормативно-правовые и руководящие документы (ГОСТы, РД, СНИПы и др.)]. Диск 1, 2, 3, 4. - М. :Технорматив, 2014. - (Документация для профессионалов). - CD. - Текст : электронный. - 119600 р. – (105501-1)
9. База данных учебно-методических комплексов: <https://lib.tstu.tver.ru/header/umk.html>

УМК размещен: <https://elib.tstu.tver.ru/MegaPro/GetDoc/Megapro/114592>

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины

При изучении дисциплины «Риск-менеджмент в деятельности предприятия» используются современные средства обучения: наглядные пособия, диаграммы, схемы.

Возможна демонстрация лекционного материала с помощью оверхед-проектора (кодоскопа) и мультипроектора.

9. Оценочные средства для проведения промежуточной аттестации

9.1 Оценочные средства промежуточной аттестации в форме экзамена

Учебным планом экзамен по дисциплине не предусмотрен.

9.2. Оценочные средства промежуточной аттестации в форме зачёта

Шкала оценивания промежуточной аттестации — «зачтено», «не зачтено».

1. Вид промежуточной аттестации в форме зачета: по результатам текущего контроля знаний обучающегося без дополнительных контрольных испытаний.

2. Критерии проставления зачета.

Иные нормы, регламентирующие процедуру проведения экзамена, представлены в Положении о текущем контроле успеваемости и промежуточной аттестации студентов.

9.3. Оценочные средства для проведения промежуточной аттестации в форме курсовой работы

Учебным планом курсовой проект и курсовая работа не предусмотрены.

10. Методические рекомендации по организации изучения дисциплины

Студенты перед началом изучения дисциплины ознакомлены с системами кредитных единиц и балльно-рейтинговой оценки, которые опубликованы и размещены на сайте вуза или кафедры.

В учебный процесс внедрена субъект-субъектная педагогическая технология, при которой в расписании каждого преподавателя определяется время консультаций студентов по закрепленному за ним модулю дисциплины.

Рекомендуется обеспечить студентов, изучающих дисциплину, электронными учебниками, учебно-методическим комплексом по дисциплине, включая методические указания к выполнению практических работ, а также всех видов самостоятельной работы.

11. Внесение изменений и дополнений в рабочую программу дисциплины

Кафедра ежегодно обновляет содержание рабочих программ дисциплин, которые оформляются протоколами заседаний дисциплин, форма которых утверждена Положением о рабочих программах дисциплин, соответствующих ФГОС ВО.