

МИНОБРНАУКИ РОССИИ



Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«Российский государственный гуманитарный университет»

(ФГБОУ ВО «РГГУ»)

ИНСТИТУТ ЭКОНОМИКИ, УПРАВЛЕНИЯ И ПРАВА

ФАКУЛЬТЕТ УПРАВЛЕНИЯ

Кафедра моделирования в экономике и управлении

УПРАВЛЕНИЕ В УСЛОВИЯХ НЕОПРЕДЕЛЕННОСТИ И РИСКА

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Направление 38.04.01 «Экономика»

Направленность «Экономика фирмы»

Уровень квалификации выпускника - *магистр*

Форма обучения: *заочная*

РПД адаптирована для лиц
с ограниченными возможностями
здоровья и инвалидов

Москва 2019

УПРАВЛЕНИЕ В УСЛОВИЯХ НЕОПРЕДЕЛЕННОСТИ И РИСКА

Рабочая программа дисциплины

Составитель:

канд. техн. наук, с.н.с., профессор *В.В. Муромцев*

УТВЕРЖДЕНО

Протокол заседания кафедры

№ 16 от 18.06.2019 г.

ОГЛАВЛЕНИЕ

| | |
|--|-----------|
| РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ | 4 |
| 1. Пояснительная записка | 4 |
| 1.1. Цель и задачи дисциплины | 4 |
| 1.2. Формируемые компетенции, а также перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (знания, умения владения), сформулированные в компетентностном формате.4 | 4 |
| 1.3. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы | 5 |
| 2. Структура дисциплины | 6 |
| 3. Содержание дисциплины | 7 |
| 4. Информационные и образовательные технологии | 8 |
| 5. Оценка планируемых результатов обучения..... | 11 |
| 5.1. Система оценивания..... | 11 |
| 5.2. Критерии выставления оценок..... | 12 |
| 5.3. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины..... | 13 |
| 6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины | 19 |
| 6.1. Список источников и литературы..... | 19 |
| 6.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимый для освоения дисциплины (модуля) | 20 |
| 7. Материально–техническое обеспечение дисциплины..... | 21 |
| 8. Обеспечение образовательного процесса для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов..... | 21 |
| 9. Методические материалы | 23 |
| 9.1. Планы практических занятий | 23 |
| 9.2. Методические рекомендации по подготовке письменной самостоятельной работы .. | 30 |
| 9.3. Иные материалы..... | 33 |
| ПРИЛОЖЕНИЕ 1 | 34 |
| АННОТАЦИЯ..... | 34 |
| ПРИЛОЖЕНИЕ 2 | 37 |
| ЛИСТ ИЗМЕНЕНИЙ | 37 |

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

1. Пояснительная записка

1.1. Цель и задачи дисциплины

Цель дисциплины: подготовить выпускника, имеющего глубокие фундаментальные теоретические и практические знания, позволяющие ускорить его профессиональную адаптацию к реалиям работы современных организаций и оптимизировать их деятельность с учётом последних достижений и передового опыта в области управления в условиях неопределённости информации о внешней и внутренней среде и связанных с этим рисков.

Задачи дисциплины:

— дать целостное, законченное представление о характере и специфике работы менеджеров в области управления рисками;

—ознакомить студентов с видами рисков, подходами к их идентификации и методами оценки;

—дать представление об основных инструментах управления, а также методах принятия стратегических, тактических и оперативных решений в условиях неопределённости;

—научить использовать в практической деятельности организаций основные методы идентификации и анализа рисков с учетом мировых практик в этой области.

1.2. Формируемые компетенции, а также перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (знания, умения владения), сформулированные в компетентностном формате.

В результате освоения дисциплины обучающийся должен демонстрировать *результаты образования*, представленные в таб.1

Таблица 1

Результаты обучения дисциплине
«Управление в условиях неопределённости и риска»

| <i>Коды компетенции</i> | <i>Содержание компетенций</i> | <i>Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине</i> |
|-------------------------|--|--|
| ОК-3 | готовностью к саморазвитию, самореализации, использованию творческого потенциала | <i>Знать:</i> современные методики идентификации и управления рисками; <i>Уметь:</i> осуществлять постоянный мониторинг за изменениями, происходящими во внутренней и внешней средах организации для учета возникающих рисков и принятия своевременных мер; <i>Владеть:</i> пониманием ответственности за принимаемые решения. |
| ОПК-2 | готовность руководить коллективом в сфере своей профессиональной деятельности, толерантно воспринимая социальные, этнические, конфессиональные и культурные различия | <i>Знать:</i> исторический и мировой опыт становления и развития методологии управления проектами <i>Уметь:</i> разрабатывать и реализовывать на практике стратегические, тактические и оперативные планы управления рисками, и координировать их с основными управленческими процессами внутри организации <i>Владеть:</i> культурой проектного управления. |
| ОПК-3 | Способность принимать организационно-управленческие решения. | <i>Знать:</i> основные модели и методы, используемые в процессе разработки управленческих решений в условиях неопределённости. <i>Уметь:</i> применять на практике основы теории |

| | | | | | | | | |
|--|--------|--|---|--|---|--|----|--|
| | Всего: | | 4 | | 4 | | 64 | |
|--|--------|--|---|--|---|--|----|--|

3. Содержание дисциплины

1. Введение. Современная методология управления в экономике и обществе. Основные понятия

Место и роль управления в современной методологии управления. Управление рисками в условиях неопределенности как основная концепция управления проектами.

2. Риски. Основные понятия, природа возникновения, классификация

Риск – что это такое. Два понятия: риск и возможность – «положительный риск». Две характеристики риска – вероятность возникновения и последствия (ущерб) при реализации рискованного события.

Возникновение риска и неопределенности. Этапы модели жизненного цикла предприятия. Этапы жизни и динамика рисков фирмы. Рискообразующие факторы. Риск как основа создания дополнительной прибыли.

Классификация рисков. Чистые риски. Спекулятивные риски. Прочие виды рисков.

3. Методы анализа, оценки и прогнозирования рисков

Качественный метод.

Количественные методы. Статистический метод. Кривая Лоренца и коэффициент Джинни. Анализ целесообразности (уместности) затрат. Метод аналогий. Метод экспертных оценок. Аналитические методы оценки риска. Метод сценариев и метод дерева решений. Метод имитационного моделирования (метод Монте-Карло). Метод Z-модель (модель Альтмана). Шкала риска.

Картографирование рисков.

4. Управление рисками. Риск-менеджмент

Основные приемы и этапы управления риском. Алгоритм управления. Классификация методов управления рисками. Критерий отбора и основное правило метода управления риском. Основные стратегические направления снижения риска. Методы минимизации хозяйственных рисков. Финансовый аспект управления рисками. Методы и модели управления инвестиционными рисками. Страхование (хеджирование). Методы анализа и снижения «природных» рисков. Рынок альтернативных методов перевода риска. Современные тенденции в управлении рисками. Зонирование риска. Рисковый калькулятор фирмы – формирование антикризисной программы. Контроль процесса управления рисками.

4. Образовательные технологии

Внедрение компетентностного подхода в систему образования требует кардинального изменения образовательных технологий. Большую роль при этом играет переход от традиционных форм передачи знаний к инновационным образовательным технологиям.

В связи с этим при реализации программы дисциплины «Управление в условиях риска и неопределенности» в рамках компетентностного подхода используются различные методы изложения лекционного материала в зависимости от излагаемой темы – проблемные лекции, лекции-визуализации, лекции-беседы, лекции-дискуссии, лекции с разбором конкретных ситуаций и с применением техники обратной связи.

В целях активизации работы студентов при освоении теоретического материала, изложенного на лекциях, при проведении практических занятий проводятся экспресс-опрос, проводятся дискуссии и др.

Важную роль в новых условиях отводится различным формам организации самообучения. Самостоятельная работа студентов направлена на закрепление полученных навыков, на приобретение новых теоретических и фактических знаний и выполняется в рамках данной дисциплины с использованием компьютерных технологий и электронных образовательных ресурсов. Для активизации образовательной деятельности с целью

формирования и развития профессиональных навыков обучающихся, используются формы проектного обучения.

Образовательные технологии

| № п/п | Наименование раздела | Виды учебной работы | Информационные и образовательные технологии |
|-------|--|---|---|
| 1. | <i>Введение. Современная методология управления в экономике и обществе. Основные понятия</i> | Лекция 1. Практ. зан. 1. Самост. работа | Вводная лекция-визуализация с элементами дискуссии Дискуссия и экспресс-опрос по изученному материалу Работа с литературой и интернет-ресурсами |
| 2. | <i>Риски. Основные понятия, природа возникновения, классификация</i> | Лекция 2 Практ.зан. 2, 3 Самост. работа | Лекция-беседа Дискуссия Консультации посредством электронной почты |
| 3. | <i>Методы анализа, оценки и прогнозирования рисков</i> | Лекция 3 Практ. зан. 4 Самост. работа | Лекция-визуализация с элементами дискуссии Дискуссия и экспресс-опрос по теме 2 Экспресс-опрос по теме 3 Работа с литературой и интернет-ресурсами |
| 4. | <i>Управление рисками. Риск-менеджмент</i> | Лекция 4. Практ. Зан. 5, 6 Самост. работа | Лекция-беседа с обратной связью Экспресс-опрос и решение задач по теме 4 Консультации посредством электронной почты |

5. Оценка планируемых результатов обучения

5.1. Система оценивания

В процессе изучения дисциплины проводится рейтинговый контроль знаний студентов в соответствии с Положением РГГУ о его проведении. Он предполагает учет результатов написания тестов и докладов на практических занятиях, результатов самостоятельной работы по выполнению практических заданий, а также степени участия студентов в дискуссиях, при обсуждении проблемных вопросов и работ на практических занятиях.

| Форма контроля | Срок отчетности | Макс. количество баллов | |
|-----------------------------------|-----------------|-------------------------|-------|
| | | За одну работу | Всего |
| Текущий контроль: | | | |
| - устный экспер-опрос и участие в | | 5 | |

| | | | |
|-----------------------------------|----------------------|-----------|------------|
| дискуссии на практическом занятии | 3, 4, 5, 6, 7 недели | | 40 баллов |
| - решение задач | 3-20 неделя | 20 баллов | 20 баллов |
| Промежуточная аттестация (зачет) | 18 неделя | | 40 баллов |
| Итого за семестр (дисциплину) | | | 100 баллов |

Оценка «зачтено» выставляется обучающемуся, набравшему не менее 50 баллов в результате суммирования баллов, полученных при текущем контроле и промежуточной аттестации. Полученный совокупный результат (максимум 100 баллов) конвертируется в традиционную шкалу оценок и в шкалу оценок Европейской системы переноса и накопления кредитов (Europea Credit Trasfer System; далее – ECTS) в соответствии с таблицей:

| 100-балльная шкала | Традиционная шкала | | Шкала ECTS |
|--------------------|---------------------|------------|------------|
| 95 – 100 | отлично | зачтено | A |
| 83 – 94 | | | B |
| 68 – 82 | хорошо | | C |
| 56 – 67 | удовлетворительно | | D |
| 50 – 55 | | | E |
| 20 – 49 | неудовлетворительно | не зачтено | FX |
| 0 – 19 | | | F |

5.2. Критерии выставления оценок

| Баллы/ Шкала ECTS | Оценка по дисциплине | Критерии оценки результатов обучения по дисциплине |
|-------------------------|---|---|
| 100-83/ A,B | «отлично»/ «зачтено (отлично)»/ «зачтено» | Выставляется обучающемуся, если он глубоко и прочно усвоил теоретический и практический материал, может продемонстрировать это на занятиях и в ходе промежуточной аттестации. Обучающийся исчерпывающе и логически стройно излагает учебный материал, умеет увязывать теорию с практикой, справляется с решением задач профессиональной направленности высокого уровня сложности, правильно обосновывает принятые решения. Свободно ориентируется в учебной и профессиональной литературе. Оценка по дисциплине выставляется обучающемуся с учётом результатов текущей и промежуточной аттестации. Компетенции, закреплённые за дисциплиной, сформированы на уровне – «высокий». |
| 82-68/ C | «хорошо»/ «зачтено (хорошо)»/ «зачтено» | Выставляется обучающемуся, если он знает теоретический и практический материал, грамотно и по существу излагает его на занятиях и в ходе промежуточной аттестации, не допуская существенных неточностей. Обучающийся правильно применяет |

| Баллы/ Шкала ECTS | Оценка по дисциплине | Критерии оценки результатов обучения по дисциплине |
|-------------------------|---|---|
| | | <p>теоретические положения при решении практических задач профессиональной направленности разного уровня сложности, владеет необходимыми для этого навыками и приёмами.</p> <p>Достаточно хорошо ориентируется в учебной и профессиональной литературе.</p> <p>Оценка по дисциплине выставляются обучающемуся с учётом результатов текущей и промежуточной аттестации.</p> <p>Компетенции, закреплённые за дисциплиной, сформированы на уровне – «хороший».</p> |
| 67-50/ D,E | «удовлетвори-тельно»/ «зачтено (удовлетвори-тельно)»/ «зачтено» | <p>Выставляется обучающемуся, если он знает на базовом уровне теоретический и практический материал, допускает отдельные ошибки при его изложении на занятиях и в ходе промежуточной аттестации.</p> <p>Обучающийся испытывает определённые затруднения в применении теоретических положений при решении практических задач профессиональной направленности стандартного уровня сложности, владеет необходимыми для этого базовыми навыками и приёмами.</p> <p>Демонстрирует достаточный уровень знания учебной литературы по дисциплине.</p> <p>Оценка по дисциплине выставляются обучающемуся с учётом результатов текущей и промежуточной аттестации.</p> <p>Компетенции, закреплённые за дисциплиной, сформированы на уровне – «достаточный».</p> |
| 49-0/ F,FX | «неудовлетворительно»/ не зачтено | <p>Выставляется обучающемуся, если он не знает на базовом уровне теоретический и практический материал, допускает грубые ошибки при его изложении на занятиях и в ходе промежуточной аттестации.</p> <p>Обучающийся испытывает серьёзные затруднения в применении теоретических положений при решении практических задач профессиональной направленности стандартного уровня сложности, не владеет необходимыми для этого навыками и приёмами.</p> <p>Демонстрирует фрагментарные знания учебной литературы по дисциплине.</p> <p>Оценка по дисциплине выставляются обучающемуся с учётом результатов текущей и промежуточной аттестации.</p> <p>Компетенции на уровне «достаточный», закреплённые за дисциплиной, не сформированы.</p> |

5.3. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины

Практические занятия (текущий контроль) содержат типовые задания по ключевым практическим аспектам укрупненных тематик дисциплины и проводятся в течение семестра после изучения теоретической части. Итоговая контрольная работа (промежуточный контроль) содержит теоретические вопросы курса, базовые понятия, практические задания, по укрупненным тематическим разделам.

Текущий контроль

При оценивании *устного блиц-опроса* на лекционном занятии учитываются:

- знание содержания обсуждаемых проблем, умение использовать ранее изученный теоретический материал и терминологию научных исследований (0-2 балла).

При выполнении *практического задания* учитывается:

- полнота и точность выполненной работы (0-20), в зависимости от работы;
- оформление работы (0-5), в зависимости от работы.

Промежуточная аттестация (зачет)

При проведении промежуточной аттестации студент должен ответить на 2 вопроса теоретического характера и выполнить задание практического характера.

При оценивании ответа на вопрос теоретического характера учитывается:

- теоретическое содержание освоено не полностью, знание материала носит фрагментарный характер, имеются явные ошибки в ответе (до 5 баллов);

- теоретическое содержание освоено частично, допущено не более двух-трех недочетов (до 10 баллов);

- теоретическое содержание освоено почти полностью, допущено не более одного-двух недочетов (до 15 баллов);

- теоретическое содержание освоено полностью, ответ построен по оригинальному плану, обоснован, дается ссылка на источники (20 баллов).

При оценивании ответа на вопрос практического характера учитывается:

- ответ содержит менее 30% правильного решения (0-5 баллов);

- ответ содержит 31-79 % правильного решения (6-15 баллов);

- ответ содержит 80% и более правильного решения (15- 20 баллов).

| № п/п | Наименование раздела | Виды учебной работы | Информационные и образовательные технологии |
|----------|--|---|---|
| 1. | <i>Введение. Современная методология управления в экономике и обществе. Основные понятия</i> | Лекция 1. Практ. зан. 1. Самост. работа | Вводная лекция-визуализация с элементами дискуссии Дискуссия и экспресс-опрос по изученному материалу Работа с литературой и интернет-ресурсами |
| 2. | <i>Риски. Основные понятия, природа возникновения, классификация</i> | Лекция 2 Практ.зан. 2, 3 Самост. работа | Лекция-беседа Дискуссия Консультации посредством электронной почты |
| 3. | <i>Методы анализа, оценки и прогнозирования рисков</i> | Лекция 3 Практ. зан. 4 Самост. работа | Лекция-визуализация с элементами дискуссии Дискуссия и экспресс-опрос по теме 2 Экспресс-опрос по теме 3 Работа с литературой и интернет-ресурсами |
| 4. | <i>Управление рисками. Риск-менеджмент</i> | Лекция 4. Практ. Зан. 5, 6 Самост. работа | Лекция-беседа с обратной связью Экспресс-опрос и решение задач по теме 4 Консультации посредством электронной почты |

Контрольные вопросы по курсу (ОК-3)

1. Цели и задачи управления в условиях неопределенности и риске.
2. Определение риска.
3. Определение неопределённости.
4. Функциональная область – управление рисками
5. Этапы модели жизненного цикла предприятия.
6. Этапы жизни и динамика рисков фирмы.
7. Рискообразующие факторы.
8. Риск как основа создания дополнительной прибыли.
9. Классификация рисков. Чистые риски.
10. Классификация рисков. Спекулятивные риски.
11. Классификация рисков. Прочие виды рисков.
12. Качественные методы оценки и прогнозирования рисков.
13. Количественные методы оценки и прогнозирования рисков.
14. Основные приемы и этапы управления риском. Алгоритм управления.
15. Классификация методов управления рисками.

16. Основные стратегические направления снижения риска.
17. Методы минимизации хозяйственных рисков.
18. Финансовый аспект управления рисками.
19. Методы и модели управления инвестиционными рисками.
20. Страхование (хеджирование).
21. Методы анализа и снижения «природных» рисков.
22. Рынок альтернативных методов перевода риска.
23. Современные тенденции в управлении рисками.
24. Зонирование риска.
25. Контроль процесса управления рисками.
26. Оценка сложных рисков.
27. Интегральные риски как комбинация простых рисков.
28. Алгоритм определения сложных рисков.
29. Алгоритм определения стоимостного риска проекта.
30. Алгоритм определения сложного риска на основе комплексной оценки.
31. Задача минимизации стоимостных рисков.
32. Задача минимизации временных рисков.
33. Задача минимизации сложных рисков, определяемых на основе комплексной оценки.

Приведенные выше вопросы по курсу могут быть использованы в качестве тем развернутых сообщений на практических занятиях.

Варианты задач по теме 4 «Управление рисками» (ОПК-2, ОПК-3)

Практическое занятие, следующее за лекцией по теме 4 «Управление рисками» посвящено решению конкретных расчетных примеров по вычислению размера и управлению рисками.

При оценивании решения задач учитываются:

- умение выбрать правильный метод (0-5 балла);
- умение применить выбранный метод (0-5 балла);
- полнота выполненного задания (0-3 балла);
- стилистика изложения материала (0-2 балла).

Задачи предлагаются студентам последовательно сначала для самостоятельного решения, после чего проверяется в процессе обсуждения и приведения решения на доске. Студент, отвечающий у доски может получить за активность на занятии дополнительные баллы (см. п.5.3)

Вариант задач к практическому занятию по теме 4 (ОПК-3)

Задача 1. Имеются два простых риска. Первый – поломка оборудования, второй – выпуск бракованной продукции. Совместное влияние этих рисков является сложным риском. Необходимо оценить степень влияния (ожидаемый ущерб) сложного риска, если известно данные о составляющих его простых рисках:

Риск 1 – поломка оборудования – вероятность 20 % – ущерб 20.

Риск 2 – брак – вероятность 5 % – ущерб 100.

Задача 2. Вероятность и ущерб простого риска оценивается в качественных шкалах: 1 – низкая (низкий), 2 – средняя (средний), 3 – высокая (высокий), 4 – критическая (критический). Степень влияния, также в качественных шкалах, определяется матричной сверткой:

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 4 | 3 | 3 | 4 | 4 |
| 3 | 2 | 3 | 3 | 4 |

| | | | | |
|----------|----------|----------|----------|----------|
| 2 | 2 | 2 | 3 | 3 |
| 1 | 1 | 1 | 2 | 2 |
| | 1 | 2 | 3 | 4 |

Существующее состояние (подчеркнутая в матрице цифра) соответствует высокому уровню риска (3) и по вероятности, и по ущербу. Известны затраты на уменьшение вероятности и ущерба от уровня 3 до уровней 1 и 2 соответственно:

| | | |
|-------------|----|----|
| Уровень | 1 | 2 |
| Вероятность | 50 | 15 |
| Ущерб | 70 | 20 |

Определить стратегию снижения степени влияния до уровня 2 (средний уровень) с минимальными затратами.

Задача 3. Степень влияния измеряется в качественной шкале. Если ожидаемый ущерб не более 30, то риск низкий, если больше 30 но меньше или равен 70, риск средний, если больше 70, то риск высокий.

Существующий ожидаемый ущерб равен 80 (высокий риск). Имеются 4 мероприятия по снижению степени влияния.

| Мероприятие | Затраты | Снижение ожидаемого ущерба |
|-------------|---------|----------------------------|
| 1 | 40 | 20 |
| 2 | 30 | 40 |
| 3 | 10 | 20 |
| 4 | 35 | 30 |

Определить программу снижения риска, обеспечивающую уровень 1 (низкий риск) с минимальными затратами.

6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

6.1. Список источников и литературы

Основная литература:

Балдин, К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия / Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С., - 3-е изд. - Москва : Дашков и К, 2017. - 418 с.: ISBN 978-5-394-02256-2. <https://znanium.com/>

Антикризисное управление: Учебное пособие / Под ред. Э.М. Короткова. - Москва : ИНФРА-М, 2012. - 240 с. (Вопрос - ответ). ISBN 978-5-16-003005-0/ <https://znanium.com/>

Авдийский, В. И. Налоговые риски в системе экономической безопасности : учеб. пособие / В.И. Авдийский, В.В. Земсков, А.И. Соловьев. — Москва : ИНФРА-М, 2019. — 236 с. — (Высшее образование: Магистратура). — <https://znanium.com/>

Балдин, К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия / Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С., - 3-е изд. - Москва : Дашков и К, 2017. - 418 с.: ISBN 978-5-394-02256-2. <https://znanium.com/>

Антонов, Г. Д. Управление рисками организации : учебник / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. — Москва : ИНФРА-М, 2019. — 153 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). — <https://znanium.com/>

Савицкая, Г. В. Анализ эффективности и рисков предпринимательской деятельности : методологические аспекты / Г.В. Савицкая. - Москва : ИНФРА-М, 2008. - 272 с. ISBN 978-5-16-003219-1. <https://znanium.com/>

Рожковский, А. Л. Концепция управления стоимостью компании. Теория, методология и практика в свете современных тенденций организационного дизайна : монография / А.Л. Рожковский. — Москва : ИНФРА-М, 2018. — 277 с. : ил. - ISBN 978-5-16-106726-0. <https://znanium.com/>

Дополнительная литература:

1. Уродовских, В. Н. Управление рисками предприятия : учеб. пособие / В.Н. Уродовских. — Москва : Вузовский учебник : ИНФРА-М, 2018. — 168 с. - ISBN 978-5-16-105281-5. <https://znanium.com/>
2. Дзгоева, М. Р. Механизм комплексной оценки и управления рисками предприятий промышленности: Монография / Дзгоева М.Р., Цховребов А.Р., Комаева Л.Э. - Москва : НИЦ ИНФРА-М, 2017. - 120 с. (Научная мысль) (Обложка. КБС) ISBN 978-5-16-009698-8. <https://znanium.com/>
3. Домашенко, Д. В. Управление рисками в условиях финансовой нестабильности / Домашенко Д. В., Финогенова Ю. Ю. - Москва : Магистр, ИНФРА-М Издательский Дом, 2015. - 240 с. ISBN 978-5-9776-0138-2. <https://znanium.com/>
4. Управление банковскими рисками в условиях глобализации мировой экономики : науч.-практ. пособие для специалистов / В. В. Рудько-Силиванов, Н. В. Зубрилова, К. В. Лапина, Н. В. Кучина ; под ред. В. В. Ткаченко. - 2-е изд., перераб. и доп. - Москва : РИОР : ИНФРА-М, 2012. - 318 с. - (Научная мысль). - ISBN 978-5-369-01120-1 (РИОР), ISBN 978-5-16-006292-1 (ИНФРА-М). <https://znanium.com/>
5. Крюков, С. В. Системный анализ: теория и практика: учеб. пособие / Крюков С.В. - Ростов-на-Дону:Издательство ЮФУ, 2011. - 228 с. ISBN 978-5-9275-0851-8. <https://znanium.com/>
6. Кашина, Е. В. Проблемы эффективного управления стоимостью ресурсоемких предприятий/КашинаЕ.В., ШалгиноваЛ.А. - Краснояр.: СФУ, 2015. - 136 с.: ISBN 978-5-7638-3214-3. <https://znanium.com/>
7. Ряховская, А. Н. Риск-менеджмент — основа устойчивости бизнеса : учеб. пособие /А. Н. Ряховская, О. Г. Крюкова, М. О. Кузнецова; под ред. О. Г. Крюковой. — Москва : Магистр: ИНФРА-М, 2019. — 256с. - ISBN 978-5-16-106807-6. <https://znanium.com/>
8. Эффективное государственное управление в условиях инновационной экономики: финансовые аспекты : монография / под ред. И. Н. Рыковой. - Москва : Дашков и К, 2011. - 350 с. - ISBN 978-5-394-01884-8. <https://znanium.com/>

6.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимый для освоения дисциплины (модуля)

1. Теория управления организационными системами. Электронная библиотека <http://www.mtas.ru/search/>

Перечень БД и ИСС

1. Международные реферативные наукометрические БД, доступные в рамках национальной подписки: Web of Science, Scopus.
2. Профессиональные полнотекстовые БД, доступные в рамках национальной подписки: Журналы Oxford University Press, ProQuest Dissertation&Theses Global, SAGE Journals, Журналы Taylorand Francis
3. Профессиональные полнотекстовые БД: JSTOR, Издания по общественным и гуманитарным наукам.
4. Компьютерные справочные правовые системы: Консультант Плюс, Гарант.

7. Материально–техническое обеспечение дисциплины

Для проведения аудиторных занятий по дисциплине необходима аудитория, оснащенная ПК и мультимедиа-проектором.

Необходимое лицензионное программное обеспечение: MS PowerPoint, Word, Excel; Chrome.

8. Обеспечение образовательного процесса для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

В ходе реализации дисциплины используются следующие дополнительные методы обучения, текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся в зависимости от их индивидуальных особенностей:

- для слепых и слабовидящих:
 - лекции оформляются в виде электронного документа, доступного с помощью компьютера со специализированным программным обеспечением;
 - письменные задания выполняются на компьютере со специализированным программным обеспечением, или могут быть заменены устным ответом;
 - обеспечивается индивидуальное равномерное освещение не менее 300 люкс;
 - для выполнения задания при необходимости предоставляется увеличивающее устройство; возможно также использование собственных увеличивающих устройств;
 - письменные задания оформляются увеличенным шрифтом;
 - экзамен и зачёт проводятся в устной форме или выполняются в письменной форме на компьютере.
- для глухих и слабослышащих:
 - лекции оформляются в виде электронного документа, либо предоставляется звукоусиливающая аппаратура индивидуального пользования;
 - письменные задания выполняются на компьютере в письменной форме;
 - экзамен и зачёт проводятся в письменной форме на компьютере; возможно проведение в форме тестирования.
- для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:
 - лекции оформляются в виде электронного документа, доступного с помощью компьютера со специализированным программным обеспечением;
 - письменные задания выполняются на компьютере со специализированным программным обеспечением;
 - экзамен и зачёт проводятся в устной форме или выполняются в письменной форме на компьютере.

При необходимости предусматривается увеличение времени для подготовки ответа.

Процедура проведения промежуточной аттестации для обучающихся устанавливается с учётом их индивидуальных психофизических особенностей. Промежуточная аттестация может проводиться в несколько этапов.

При проведении процедуры оценивания результатов обучения предусматривается использование технических средств, необходимых в связи с индивидуальными особенностями обучающихся. Эти средства могут быть предоставлены университетом, или могут использоваться собственные технические средства.

Проведение процедуры оценивания результатов обучения допускается с использованием дистанционных образовательных технологий.

Обеспечивается доступ к информационным и библиографическим ресурсам в сети Интернет для каждого обучающегося в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

- для слепых и слабовидящих:
 - в печатной форме увеличенным шрифтом;
 - в форме электронного документа;

- в форме аудиофайла.
- для глухих и слабослышащих:
 - в печатной форме;
 - в форме электронного документа.
- для обучающихся с нарушениями опорно-двигательного аппарата:
 - в печатной форме;
 - в форме электронного документа;
 - в форме аудиофайла.

Учебные аудитории для всех видов контактной и самостоятельной работы, научная библиотека и иные помещения для обучения оснащены специальным оборудованием и учебными местами с техническими средствами обучения:

- для слепых и слабовидящих:
 - устройством для сканирования и чтения с камерой SARA CE;
 - дисплеем Брайля PAC Mate 20;
 - принтером Брайля EmBraille ViewPlus;
- для глухих и слабослышащих:
 - автоматизированным рабочим местом для людей с нарушением слуха и слабослышащих;
 - акустический усилитель и колонки;
- для обучающихся с нарушениями опорно-двигательного аппарата:
 - передвижными, регулируемые эргономическими партами СИ-1;
 - компьютерной техникой со специальным программным обеспечением.

9. Методические материалы

9.1. Планы практических занятий

Цель практических занятий – научить студентов практически применять навыки анализа, оценки, прогнозирования рисков, рассмотренные теоретически на лекциях.

Темы практических занятий отражают последовательность изучения дисциплины в соответствии с рабочей программой и выбраны исходя из их значимости для изучения курса. На занятиях отрабатываются наиболее важные типовые задачи и ситуации, возникающие в процессе управления рисками.

При подготовке к занятию магистр должен ознакомиться с планом занятия, повторить теоретический материал по данной теме на основании конспектов лекций, рекомендуемой литературы и электронных образовательных ресурсов. В ходе занятий на базе самостоятельной подготовки магистр выполняет теоретические и практические задания, в ходе обсуждения которых оцениваются не только профессиональные навыки, но и общекультурные и общепрофессиональные компетенции:

ТЕМАТИЧЕСКИЕ РАЗДЕЛЫ практических занятий

Тема 1 Управление проектами. Современная методология управления в экономике и обществе. Основные понятия.

Цель: Изучить место и роль управления проектами в современной методологии управления и роль управления рисками в этой концепции.

Форма проведения: дискуссия с разбором типовых примеров.

Вопросы для изучения и обсуждения

1. Основы управления проектами.
2. Жизненный цикл (фазы) проекта: концепция – разработка – реализация – завершение.
3. Функциональные области УП.
4. 4 стадии управления.

5. Функциональная область управление рисками.

Контрольные вопросы для блиц-опроса:

1. Цели и задачи управления в условиях неопределенности и риске.
2. Определение риска.
3. Определение неопределённости.
4. Жизненный цикл (фазы) проекта.
5. Функциональные области УП.
6. Управление каждой функциональной областью.
7. Функциональная область – управление рисками.

Тема 2 Риски. Основные понятия, природа возникновения, классификация

Цель: Определить понятие риска и его характеристики. Провести классификацию рисков.

Форма проведения: дискуссия с разбором типовых примеров.

Вопросы для изучения и обсуждения:

1. Что такое риск.
2. Характеристики риска.
3. Возникновение риска и неопределенности.
4. Развитие предприятия и связанные с этим риски. Рискообразующие факторы.
5. Классификация рисков. Чистые риски. Спекулятивные риски. Прочие виды рисков.

Контрольные вопросы:

1. Этапы модели жизненного цикла предприятия.
2. Этапы жизни и динамика рисков фирмы.
3. Рискообразующие факторы.
4. Риск как основа создания дополнительной прибыли.
5. Классификация рисков. Чистые риски.
6. Классификация рисков. Спекулятивные риски.
7. Классификация рисков. Прочие виды рисков.

Тема 3 Методы анализа, оценки и прогнозирования рисков

Цель: Изучить методы анализа, алгоритмы оценки и возможности прогнозирования рисков.

Форма проведения: дискуссия с разбором типовых примеров.

Вопросы для изучения и обсуждения:

1. Качественный метод оценки рисков.

Количественные методы оценки рисков. Статистический метод. Кривая Лоренца и коэффициент Джинни. Анализ целесообразности (уместности) затрат. Метод аналогий. Метод экспертных оценок. Аналитические методы оценки риска. Метод сценариев и метод дерева решений. Метод имитационного моделирования (метод Монте-Карло). Метод Z-модель (модель Альтмана). Шкала риска.

2. Картографирование рисков.

Контрольные вопросы:

1. Качественные методы оценки и прогнозирования рисков.
2. Количественные методы оценки и прогнозирования рисков.
3. Картографирование рисков.

Тема 4. Управление рисками

Цель: Изучить основные приемы и этапы управления риском. Алгоритм и классификацию методов управления рисками. Научиться решать практические задачи по управлению рисками.

Форма проведения: семинар с разбором приемов решения практических задач.

Вопросы для обсуждения:

1. Основные приемы и этапы управления риском. Алгоритм управления. Классификация методов управления рисками.
2. Основные стратегические направления снижения риска.
3. Финансовый аспект управления рисками.
4. Современные тенденции в управлении рисками.
5. Контроль процесса управления рисками.

Контрольные вопросы:

1. Основные приемы и этапы управления риском. Алгоритм управления.
2. Классификация методов управления рисками.
3. Основные стратегические направления снижения риска.
4. Методы минимизации хозяйственных рисков.
5. Финансовый аспект управления рисками.
6. Методы и модели управления инвестиционными рисками.
7. Страхование (хеджирование).
8. Методы анализа и снижения «природных» рисков.
9. Рынок альтернативных методов перевода риска.
10. Современные тенденции в управлении рисками.
11. Зонирование риска.
12. Рисковый калькулятор фирмы – формирование антикризисной программы.
13. Контроль процесса управления рисками.

На занятии кроме обсуждения теоретического материала предполагается решение по управлению рисками. Примеры заданий приведены выше, в пункте 5

9.2. Методические рекомендации по подготовке письменной самостоятельной работы

Защита проекта по формированию программы предприятия по снижению рисков, подготовленного в виде доклада с презентацией в формате PowerPoint является квалификационной работой студента и подводит итоги теоретической и практической подготовки студента по изучаемой дисциплине. При подготовке проекта магистр должен показать свои способности и возможности по решению реальных проблем, используя полученные в процессе обучения знания. Методические указания позволяют обеспечить единство требований, предъявляемых к содержанию, качеству и оформлению письменных работ.

При выполнении проекта используются все знания, полученные студентами в ходе освоения курса; закрепляются навыки оформления результатов работы; выявляются умения четко формулировать, и аргументировано обосновывать предложения и рекомендации по снижению рисков на выбранном предприятии.

Выполнение работы предполагает консультационную помощь со стороны преподавателя. В ходе выполнения работы магистр должен показать, в какой мере он овладел теоретическими знаниями и практическими навыками, в какой степени научился ставить задачи, делать выводы и обобщать полученные результаты.

Подготовка письменной работы имеет целью:

- закрепление навыков полученных в ходе курса;
- практическое овладение методиками, изученными на лекциях и практических занятиях;
- применение знаний при решении конкретных задач управленческой деятельности;
- выяснение подготовленности студента к самостоятельному решению проблем, связанных с предметом «Управление в условиях риска и неопределенности».

Общие требования.

Для успешного и качественного выполнения проекта магистру необходимо:

- иметь знания по изучаемой дисциплине в объеме программы РГГУ;
- владеть методами, изученными в ходе курса;
- уметь использовать современные средства вычислительной техники, в первую очередь персональные компьютеры в процессе выполнения, оформления и презентации работы;
- свободно ориентироваться при подборе различных источников информации и уметь работать со специальной литературой;
- уметь логично, грамотно и научно обоснованно формулировать теоретические и практические рекомендации, результаты анализа;
- квалифицированно оформлять графический материал, иллюстрирующий содержание работы.

Являясь законченным самостоятельным проектом студента, письменная работа должна отвечать следующим требованиям.

1. Описание исходных данных (информации о выбранном предприятии) в необходимом и достаточном объеме для проведения дальнейшей работы.
2. Использование в проекте технологий, методов и алгоритмов, изученных в ходе рассматриваемого курса.
3. Логичность, обоснованность и практическая применимость предлагаемых в проекте рекомендаций и мероприятий по снижению рисков предприятия.

Студент выполняет проект, используя за основу данные предприятия или фирмы, которые выбирает сам, после чего согласовывает свой выбор с преподавателем. Одним из обязательных критериев выбора является доступность необходимой и достаточной информации по выбранному объекту для формирования программы по снижению рисков.

Требования к содержанию и структуре текста

Проект по формированию программы снижения рисков является строго структурированным и состоит из следующих частей:

- Титульный лист, соответствующий требованиям РГГУ, предъявляемым к оформлению титульного листа курсовой работы;
- Оглавление (автоматически генерируется в Word);
- Введение, содержащее информацию о выбранном объекте;
- Пункты, содержащие анализ, оценку и прогноз рисков для выбранного предприятия;
- Список мероприятий, предлагаемых для программы снижения рисков с расчетом их эффективности;
- Программу по снижению рисков на основе предложенного списка мероприятий с обоснованием ее оптимальности.
- Заключение, содержащее рекомендации по практическому внедрению предложенной программы снижения риска на предприятии;
- Презентация по проекту, сделанная в программе PowerPoint. Используется для доклада по проекту. Содержит все элементы, требуемые для текстового варианта проекта (титульный лист, содержание, описание объекта, исследование рисков, предложенные мероприятия, сформированную программу и предложения по ее реализации).

Требования к оформлению

Письменная работа должна быть отредактирована, вычитана и подписана автором. Общий объем курсовой работы должен составлять от 7 до 20 страниц печатного текста.

Работа должна быть оформлена на одной стороне листа бумаги формата А4 по ГОСТ 9327-60. Допускается представить таблицы и иллюстрации на листах бумаги формата не более А3. Текст следует печатать через полтора интервала (шрифт TimesNewRoman, размер 14),

соблюдая размеры полей по ГОСТ 7.32-91: левое 30 мм, правое – 15 мм, верхнее –15 мм, нижнее –20 мм.

Заголовки разделов пишут симметрично тексту, заголовки подразделов – с абзаца. Расстояние между заголовками и текстом должно быть увеличено для выделения заголовка.

На титульном листе ставится подпись студента, подтверждающего то, что это окончательный вариант работы, и подпись научного руководителя, подтверждающего готовность работы.

Содержание помещается за титульным листом, печатается через полтора интервала, разделы определяются пробелом в два интервала.

9.3. Иные материалы

Освоение дисциплины не требует других материалов для самостоятельной работы студентов, кроме изложенных выше.

Приложение 1

Аннотация

Дисциплина «Управление в условиях неопределенности и риска» является частью блока дисциплин учебного плана. Дисциплина реализуется на Экономическом факультете ИЭУП РГГУ, кафедрой моделирования в экономике и управлении.

Цель дисциплины: подготовить выпускника, имеющего глубокие фундаментальные теоретические и практические знания, позволяющие ускорить его профессиональную адаптацию к реалиям работы современных организаций и оптимизировать их деятельность с учётом последних достижений и передового опыта в области проектного управления в условиях неопределённости информации о внешней и внутренней среде и связанных с этим рисков.

Задачи дисциплины:

дать целостное, законченное представление о характере и специфике работы менеджеров в области управления рисками;

ознакомить студентов с видами рисков, подходами к их идентификации и методами оценки;

дать представление об основных инструментах проектного управления, а также методах принятия стратегических, тактических и оперативных решений в условиях неопределенности;

научить использовать в практической деятельности организаций основные методы идентификации и анализа рисков с учетом мировых практик в этой области;

подготовить специалистов-профессионалов, свободно и легко ориентирующихся в современном мире, способных на основе полученных знаний творчески, оперативно, обоснованно и с минимальным риском принимать решения по вопросам дальнейшего развития современных предприятий, разрабатывать и реализовывать на практике стратегические и текущие планы, увязывать их с основными управленческими процессами внутри организации, осуществлять постоянный мониторинг за изменениями, происходящими в её внутренней и внешней средах, и в соответствии с ними вносить необходимые коррективы в комплекс мероприятий по реализации стратегий.

Дисциплина направлена на формирование следующих компетенций:

ОК-3 - готовностью к саморазвитию, самореализации, использованию творческого потенциала

ОПК - 2 готовностью руководить коллективом в сфере своей профессиональной деятельности, толерантно воспринимая социальные, этнические, конфессиональные и культурные различия

ОПК-3 способностью принимать организационно-управленческие решения

В результате освоения дисциплины обучающийся должен:

Знать: современные методики идентификации и управления рисками; исторический и мировой опыт становления и развития методологии управления проектами; основные модели и методы, используемые в процессе разработки управленческих решений в условиях неопределенности.

Уметь: осуществлять постоянный мониторинг за изменениями, происходящими во внутренней и внешней средах организации для учета возникающих рисков и принятия своевременных мер; разрабатывать и реализовывать на практике стратегические, тактические и оперативные планы управления рисками, и координировать их с основными управленческими процессами внутри организации; применять на практике основы теории разработки управленческих решений в условиях неопределенности; определять источники актуальной, полной и достоверной управленческой информации для подготовки решений.

Владеть: пониманием ответственности за принимаемые решения; культурой проектного управления; технологией обобщения и анализа информации, постановкой цели и выбором альтернативных путей её достижения.

Рабочей программой предусмотрены следующие виды контроля: текущий контроль успеваемости в форме защиты проекта по формированию программы предприятия по снижению рисков, подготовленного в виде доклада с презентацией в формате PowerPoint; промежуточный контроль в форме зачета.

Общая трудоемкость освоения дисциплины для очной формы обучения составляет 2 зачетные единицы.

.

*Приложение 2***ЛИСТ ИЗМЕНЕНИЙ**

| № | Текст актуализации или прилагаемый к РПД документ, содержащий изменения | Дата | № протокола |
|---|--|------------|----------------|
| 1 | Приложение №1 | 31.08.2020 | 1 |

Приложение к листу изменений №1

1. Структура дисциплины (к п. 2 РПД на 2020)**Структура дисциплины для заочной формы обучения**

Общая трудоемкость дисциплины составляет 2 з. е., 76 ч., в том числе контактная работа обучающихся с преподавателем 8 ч., самостоятельная работа обучающихся 68 ч.

| № п/п | Раздел дисциплины/темы | Семестр | Виды учебной работы (в часах) | | | | | Формы текущего контроля успеваемости, форма промежуточной аттестации (<i>по семестрам</i>) | |
|----------|---|---------|----------------------------------|---------|-------------------------|-------------------------|-----------------------------|--|---------------------------------|
| | | | контактная | | | | | | Самостоятельная работа |
| | | | Лекции | Семинар | Практические занятия | Лабораторные занятия | Промежуточная аттестация | | |
| 1 | Введение. Современная методология управления в экономике и обществе. Основные понятия | 3-4 | 1 | | 1 | | | 16 | Дискуссия Экспресс-опрос |
| 2 | Риски. Основные понятия, природа возникновения, классификация | 3-4 | 1 | | 1 | | | 16 | Дискуссия |
| 3 | Методы анализа, оценки и прогнозирования рисков | 3-4 | 1 | | 1 | | | 18 | Дискуссия Экспресс опрос |
| 4 | Управление рисками. Риск-менеджмент | 3-4 | 1 | | 1 | | | 18 | Экспресс-опрос Решение задач |
| | Зачет | | | | | | | | Зачет по вопросам |
| | Всего: | | 4 | | 4 | | | 68 | |

2. Образовательные технологии (к п.4 на 2020 г.)

В период временного приостановления посещения обучающимися помещений и территории РГГУ. для организации учебного процесса с применением электронного обучения и дистанционных образовательных технологий могут быть использованы следующие образовательные технологии:

- видео-лекции;
- онлайн-лекции в режиме реального времени;
- электронные учебники, учебные пособия, научные издания в электронном виде и доступ к иным электронным образовательным ресурсам;
- системы для электронного тестирования;
- консультации с использованием телекоммуникационных средств.

3. Перечень БД и ИСС (к п. 6.2 на 2020 г.)

| №п /п | Наименование |
|----------|--|
| 1 | Международные реферативные наукометрические БД, доступные в рамках национальной подписки в 2020 г. Web of Science Scopus |
| 2 | Профессиональные полнотекстовые БД, доступные в рамках национальной подписки в 2020 г. Журналы Cambridge University Press ProQuest Dissertation & Theses Global SAGE Journals Журналы Taylor and Francis |
| 3 | Профессиональные полнотекстовые БД JSTOR Издания по общественным и гуманитарным наукам Электронная библиотека Grebennikon.ru |
| 4 | Компьютерные справочные правовые системы Консультант Плюс, Гарант |

4. Состав программного обеспечения (ПО) (к п. 7 на 2020 г.)

| №п /п | Наименование ПО | Производитель | Способ распространения (лицензионное или свободно распространяемое) |
|----------|-----------------------------|------------------|--|
| 1 | Adobe Master Collection CS4 | Adobe | лицензионное |
| 2 | Microsoft Office 2010 | Microsoft | лицензионное |
| 3 | Windows 7 Pro | Microsoft | лицензионное |
| 6 | SPSS Statistics 22 | IBM | лицензионное |
| 7 | Microsoft Share Point 2010 | Microsoft | лицензионное |
| 8 | SPSS Statistics 25 | IBM | лицензионное |
| 9 | Microsoft Office 2013 | Microsoft | лицензионное |
| 10 | ОС «Альт Образование» 8 | ООО «Базальт СПО | лицензионное |
| 11 | Microsoft Office 2013 | Microsoft | лицензионное |
| 12 | Windows 10 Pro | Microsoft | лицензионное |
| 13 | Kaspersky Endpoint Security | Kaspersky | лицензионное |
| 14 | Microsoft Office 2016 | Microsoft | лицензионное |
| 15 | Visual Studio 2019 | Microsoft | лицензионное |
| 16 | Adobe Creative Cloud | Adobe | лицензионное |
| 17 | Zoom | Zoom | лицензионное |