

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

по направлению подготовки

38.04.02 Менеджмент

Направленность: «Международный логистический менеджмент»

Квалификация выпускника - магистр

Форма обучения очно-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
моделирования в экономике и управлении
№ 16 от 18.06.2019

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.....	5
1.3. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы ..	5
2. Структура дисциплины.....	7
3. Содержание дисциплины	8
4. Информационные и образовательные технологии.....	9
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	18
6.1. Список источников и литературы.....	18
6.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимый для освоения дисциплины (модуля)	19
7. Материально–техническое обеспечение дисциплины	20
8. Обеспечение образовательного процесса для лиц с ограниченными возможностями здоровья.....	21
9. Методические материалы	22
9.1. Планы лабораторных работ	22
9.2. Методические рекомендации по подготовке письменной самостоятельной работы	27
9.3. Иные материалы	30
ПРИЛОЖЕНИЕ 1	31
АННОТАЦИЯ.....	31
ПРИЛОЖЕНИЕ 2	34

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 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;
- 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.

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

Дисциплина направлена на формирование следующих *компетенций*:

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

ПК-10 - способностью разрабатывать учебные программы и методическое обеспечение управленческих дисциплин, а также применять современные методы и методики в процессе их преподавания

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

Таблица 1

Результаты обучения дисциплине

«Управление в условиях неопределенности и риска»

<i>Коды компетенции</i>	<i>Содержание компетенций</i>	<i>Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине</i>
ОПК-2	готовностью руководить коллективом в сфере своей профессиональной деятельности, толерантно воспринимая социальные, этнические, конфессиональные и культурные различия	<i>Знать</i> : современные методы управления в условиях неопределённости и рисков; <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.
ПК-10	способностью разрабатывать учебные программы и методическое обеспечение управленческих дисциплин, а также применять современные методы и методики в процессе их преподавания	<i>Знать</i> : современные технологии создания учебных программ и методического обеспечения управленческих дисциплин; <i>Уметь</i> : применять современные методы и методики преподавания управленческих дисциплин; <i>Владеть</i> : методами и средствами разработки и преподавания управленческих дисциплин.

1.3. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы

Дисциплина «Управление в условиях неопределенности и риска» относится к вариативной части курсов подготовки студентов по направлению

38.04.02 «Менеджмент» (уровень магистратуры), направленность «Международный логистический менеджмент»

Для освоения дисциплины *необходимы компетенции*, сформированные в ходе изучения следующих дисциплин:

- *Методология научных исследований, Математические модели в теории управления и исследование операций, Информационные ресурсы и технологии в менеджменте.*

2. Структура дисциплины

«Управление в условиях неопределенности и риска» для очно-заочной формы обучения

Общая трудоемкость дисциплины составляет 2 з. е., 72 ч., в том числе контактная работа обучающихся с преподавателем 16 ч., самостоятельная работа обучающихся 38 ч., итоговая аттестация (экзамен) 18 часов.

№ п/п	Раздел Дисциплины	Семестр	Виды учебной работы, включая самостоятел ную работу студентов и трудоемкость (в часах)				Формы текущего кон- троля успеваемости (по неделям семестра) Форма промежуточ- ной аттестации (по семестрам)
			Лекци и	Пра кт.з ания тия	Проме жуто чная аттес тация	СРС	
1	Введение. Современная методология управления в экономике и обще- стве. Основные понятия	2	1	2		8	Экспресс-опрос
2	Риски. Основные понятия, природа возникновения, классификация	2	1	2		10	Экспресс-опрос
3	Методы анализа, оценки и прогно- зирования рисков	2	1	4		10	Экспресс опрос.
4	Управление рисками. Риск- менеджмент	2	1	4		10	Экспресс-опрос. Решение задач.
	Итоговая аттестация				18		Экзамен
	ИТОГО		4	12	18	38	

3. Содержание дисциплины

№	Наименование раздела дисциплины	Содержание
1.	<i>Введение. Современная методология управления в экономике и обществе. Основные понятия</i>	Место и роль управления проектами в современной методологии управления. Управление рисками в условиях неопределенности как основная концепция управления проектами. Основы управления проектами. Жизненный цикл (фазы) проекта: концепция – разработка – реализация – завершение. Функциональные области
2	<i>Риски. Основные понятия, природа возникновения, классификация</i>	Риск – что это такое. Два понятия: риск и возможность – «положительный риск». Две характеристики риска – вероятность возникновения и последствия (ущерб) при реализации рискового 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	<i>Методы анализа, оценки и прогнозирования рисков</i>	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	<i>Управление рисками. Риск менеджмент</i>	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. Информационные и образовательные технологии

реализуемые в программе дисциплины «Управление в условиях неопределенности и риска»

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 неопределенности и риска» 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 семинарских занятий проводятся экспресс-опрос, используется проектный метод обучения, проводятся семинары-диспуты, 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.

(60 % – интерактивных занятий от объема аудиторных занятий)

№ п/п	Наименование раздела	Виды учебной работы	Формируемые компетенции	Информационные и образовательные технологии
------------------	-----------------------------	--------------------------------	------------------------------------	--

1.	<i>Введение. Современная методология управления в экономике и обществе. Основные понятия</i>	Лекция 1. Практ. зан. 1. Самост. работа	ОПК-2 ПК-10	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 Самост. работа	ОПК-2 ПК-10 ОПК-2	Лекция-беседа Обсуждение принципа выполнения индивидуальных проектов Работа над проектом
3.	<i>Методы анализа, оценки и прогнозирования рисков</i>	Лекция 3 Практ. зан. 3 Практ. зан. 4 Самост. работа	ОПК-2 ПК-10	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</i>	Лекция 4. Практ. зан. 5 Самост. работа	ОПК-2 ПК-10	Лекция-беседа с обратной связью Экспресс-опрос и решение задач по теме 4 Консультации по проекту (е-почта)

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.

Критерии, используемые при проведении рейтингового контроля для студентов, изучающих дисциплину «Управление в условиях неопределенности и риска», сроки и оценка работ представлены в таблице:

Форма контроля	Срок отчетности	Макс. количество баллов	
		За одну работу	Всего
Текущий контроль: - устный блиц-опрос и участие в дискуссии на практическом занятии	3, 4, 5, 6, 7 недели		8 баллов
- выполненное практическое задание 1	3-20 неделя	20 баллов	20 баллов
- выполненное практическое задание 2	3-20 неделя	25 баллов	25 баллов
- выполненное практическое задание 3	3-20 неделя	7 баллов	7 баллов
			60 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 (European Credit Transfer System; далее – ECTS) в соответствии с таблицей:

100-балльная шкала	Традиционная шкала		Шкала ECTS
95 – 100	отлично хорошо удовлетворительно	зачтено	A
83 – 94			B
68 – 82			C
56 – 67			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»	<p>Выставляется обучающемуся, если он глубоко и прочно усвоил теоретический и практический материал, может продемонстрировать это на занятиях и в ходе промежуточной аттестации.</p> <p>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.</p> <p>Свободно ориентируется в учебной и профессиональной литературе.</p> <p>Оценка по дисциплине выставляется обучающемуся с учётом результатов текущей и промежуточной аттестации.</p> <p>Компетенции, закреплённые за дисциплиной, сформированы на уровне – «высокий».</p>
82-68/ C	«хорошо»/ «зачтено (хорошо)»/ «зачтено»	<p>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.</p> <p>Обучающийся правильно применяет 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 выставляется обучающемуся с учётом результатов текущей и промежуточной аттестации.</p> <p>Компетенции, закреплённые за дисциплиной, сформированы на уровне – «хороший».</p>
67-50/ D,E	«удовлетворительно»/ «зачтено (удовлетворительно)»/ «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 выставляется 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</p>

Баллы/ Шкала ECTS	Оценка по дисциплине	Критерии оценки результатов обучения по дисциплине
		<p>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

Лабораторные работы (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* (лабораторной работы) 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).

№	Контрольные вопросы по курсу	Компетенции
1	Цели и задачи управления в условиях неопределенности и риске.	ОПК-2, ПК-10
2	Определение неопределённости и риска	ОПК-2, ПК-10
3	Этапы модели жизненного цикла предприятия	ОПК-2, ПК-10
4	Этапы жизни и динамика рисков фирмы.	ОПК-2, ПК-10
5	Рискообразующие факторы.	ОПК-2, ПК-10
6	Риск как основа создания дополнительной прибыли	ОПК-2, ПК-10
7	Классификация рисков. Чистые риск	ОПК-2, ПК-10
8	Классификация рисков. Спекулятивные риски	ОПК-2, ПК-10
9	Классификация рисков. Прочие виды рисков	ОПК-2, ПК-10
10	Качественные методы оценки и прогнозирования рисков	ОПК-2, ПК-10
11	Количественные методы оценки и прогнозирования рисков	ОПК-2, ПК-10
12	Основные приемы и этапы управления риском. Алгоритм управления	ОПК-2, ПК-10
13	Классификация методов управления рисками.	ОПК-2, ПК-10
14	Основные стратегические направления	ОПК-2, ПК-10

	снижения риска	
15	Методы минимизации хозяйственных рисков	ОПК-2, ПК-10
16	Финансовый аспект управления рисками	ОПК-2, ПК-10
17	Методы и модели управления инвестиционными рисками	ОПК-2, ПК-10
18	Страхование (хеджирование).	ОПК-2, ПК-10
19	Методы анализа и снижения «природных» рисков	ОПК-2, ПК-10
20	Рынок альтернативных методов перевода риска	ОПК-2, ПК-10
22	Современные тенденции в управлении рисками	ОПК-2, ПК-10
23	Рисковый калькулятор фирмы – формирование антикризисной программы	ОПК-2, ПК-10
24	Оценка сложных рисков	ОПК-2, ПК-10
25	Интегральные риски как комбинация простых рисков	ОПК-2, ПК-10
26	Стоимостные и временные риски как наиболее типичные риски проектов	ОПК-2, ПК-10
27	Минимизация стоимостных рисков	ОПК-2, ПК-10
28	Минимизация временных рисков	ОПК-2, ПК-10
29	Задача минимизации сложных рисков, определяемых на основе комплексной оценки	ОПК-2, ПК-10

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

Варианты задач по теме 4 «Управление рисками»

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);
- стили и логика 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 семинаре дополнительные баллы (см. п.5.3)

Вариант задач к практическому занятию по теме 4

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	<u>3</u>	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

Источники

Дополнительные

1. Руководство по риск-менеджменту / Д. А. Марцынковский, А. В. Владимирцев, О. А. Марцынковский; Ассоциация по сертификации «Русский Регистр». Санкт-Петербург: Береста, 2007.

Литература

Основная

2. Основы комплексного управления стоимостью / Под ред. А.В. Цветкова / Перевод с англ. – М.: Изд-во ЗАО «ПМСОФТ», 2013. – 374 с.
3. Васин С.М., Шутов В.С. Управление рисками на предприятии/ изд-во «Конус», 2010. – 304 с.
4. Вяткин В.Н., Гамза В.А., Екатеринославский Ю.Ю., Иванушко П.Н. Управление рисками фирмы: Изд-во «Финансы и статистика», 2006. – 400с.
5. Балдин К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия: Учебное пособие / К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов. - М.: Издательско- торговая корпорация «Дашков и К°», 2009. - 420 с.
6. Антикризисное управление: учебник / под ред. проф. Э.М. Короткова. – 2-е изд., доп. и перераб. – М.: ИНФРА-М, 2008. – 620с.
7. Цветкова, Е. В. Риски в экономической деятельности: Учеб. Пособие / Е. В. Цветкова, И. О. Арлюкова. - СПб.: С.-Петерб. ин-т внешнеэкономических связей экономики и права: О-во «Знание» С.-Петербурга и Ленинград. обл., 2002.

Дополнительная

8. К. В., Воробьев С. Н. Системный анализ управления рисками в предпринимательстве. - Воронеж: МОДЭК, 2005.
9. Домашенко Д. В., Финогенова Ю. Ю. Управление рисками в условиях финансовой нестабильности / Издательство: «МАГИСТР», 2010 - с.240
10. Филин С. Инвестиционный риск и его составляющие при принятии инвестиционных решений // Инвестиции в России. - 2002. - № 4. - С. 11-18.
11. Морозов Д. С. Проектное финансирование: управление рисками. - М.: Анкил, 1999.
12. Ступаков В. С., Токаренко Г. С. Риск-менеджмент. М.: Финансы и статистика, 2005.
13. Уродовских В.Н. Управление рисками предприятия: Учеб.пособие. – М.: Вузовский учебник: ИНФРА-М, 2010. – 168с.
14. Баринов А. Проектные и кредитные риски: проблема их страхования // Управление риском. - 2004. - № 4. - С. 9-21.
15. Воронцовский А.В. Управление рисками. -СПб.: Изд-во СПб. ГУ, 2004.
16. Модели управления конфликтами и рисками [Текст]: монография/С.А.Баркалов [и др.]; под ред.Д.А.Новикова. – Воронеж: Научная книга, 2008.-495с.

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/>

7. Материально–техническое обеспечение дисциплины

В качестве материально-технического обеспечения дисциплины

необходимы:

- демонстрационные приборы для лекции визуализации,
- мультимедийные средства для открытия кейсов,

Требования к аудиториям

- для проведения практических занятий необходимы компьютерные классы,
- для лекций необходимо наличие доски и специально оборудованные для показа слайдов аудитории.

В компьютерных классах должны быть установлены следующие программные средства:

Операционные системы: Windows 2010, Windows XP.

Программы: Microsoft Office PowerPoint, Microsoft Office Word, MS Windows Paint, Adobe Dreamweaver, Adobe Flash, Adobe FireWorks, Photoshop, Corel PhotoPaint, Internet Explorer или Mozilla Firefox.

8. Обеспечение образовательного процесса для лиц с ограниченными возможностями здоровья

При необходимости рабочая программа дисциплины может быть адаптирована для обеспечения образовательного процесса лицам с ограниченными возможностями здоровья, в том числе для дистанционного обучения. Для этого от студента требуется представить заключение психолого-медико-педагогической комиссии (ПМПК) и личное заявление (заявление законного представителя).

В заключении ПМПК должно быть прописано:

- рекомендуемая учебная нагрузка на обучающегося (количество дней в неделю, часов в день);
- оборудование технических условий (при необходимости);
- сопровождение и (или) присутствие родителей (законных представителей) во время учебного процесса (при необходимости);
- организация психолого-педагогического сопровождение обучающегося с указанием специалистов и допустимой нагрузки (количества часов в неделю).

Форма проведения текущей и итоговой аттестации для лиц с ограниченными возможностями здоровья устанавливается с учетом индивидуальных психофизических особенностей (устно, письменно (на бумаге, на компьютере), в форме тестирования и т.п.). При необходимости студенту предоставляется дополнительное время для подготовки ответа на зачете или экзамене.

9. Методические материалы

9.1. Планы лабораторных работ

Практические (семинарские) занятия по дисциплине «Управление в условиях неопределенности и рисков» для магистратуры по направлению подготовки 38.04.02 - «Менеджмент» - Направленность: «Международный логистический менеджмент» обеспечивают преподавание в соответствии с ФГОС ВО и учебным планом ООП.

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

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

При подготовке к занятию магистр должен ознакомиться с планом семинара, повторить теоретический материал по данной теме на основании конспектов лекций, рекомендуемой литературы и электронных образовательных ресурсов. В ходе семинаров 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:

ОК-2 – готовностью действовать в нестандартных ситуациях, нести социальную и этическую ответственность за принятые решения;

ТЕМАТИЧЕСКИЕ РАЗДЕЛЫ семинарских занятий (14 часов)

Тема 1 (2 часа) 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.

Список источников и литературы

Литература:

Основная:

1. Основы комплексного управления стоимостью / Под ред. А.В. Цветкова /
Перевод с англ. – М.: Изд-во ЗАО «ПМСОФТ», 2013. – 374с.

Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»,

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

Тема 2 Риски. Основные понятия, природа возникновения, классификация (2 часа)

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.

Список источников и литературы

Основная литература:

1. Антикризисное управление: учебник / под ред. проф. Э.М. Короткова. – 2-е изд., доп. и перераб. – М.: ИНФРА-М, 2008. – 620 с.
2. Вяткин В.Н., Гамза В.А., Екатеринославский Ю.Ю., Иванушко П.Н. Управление рисками фирмы: Изд-во «Финансы и статистика», 2006. – 400с.

Дополнительная литература:

3. К. В., Воробьев С. Н. Системный анализ управления рисками в предпринимательстве. - Воронеж: МОДЭК, 2005.

Тема 3 Методы анализа, оценки и прогнозирования рисков (2 часа)

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.

Список источников и литературы

Литература

Основная:

1. Васин С.М., Шутов В.С. Управление рисками на предприятии/ изд-во «Конус», 2010. – 304 с.
2. Вяткин В.Н., Гамза В.А., Екатеринославский Ю.Ю., Иванушко П.Н. Управление рисками фирмы: Изд-во «Финансы и статистика», 2006. – 400с.

Дополнительная

3. Уродовских В.Н. Управление рисками предприятия: Учеб.пособие. – М.: Вузовский учебник: ИНФРА-М, 2010. – 168с.

Тема 4. Управление рисками (2 часа)

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 семинаре кроме обсуждения теоретического материала предполагается решение по управлению рисками. Примеры заданий приведены выше, в пункте 5.4.

Список источников и литературы

Основная литература

1. Васин С.М., Шутов В.С. Управление рисками на предприятии/ изд-во «Конус», 2010. – 304 с.
2. Балдин К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия: Учебное пособие / К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов. - М.: Издательско- торговая корпорация «Дашков и К°», 2009. - 420 с.

3. Вяткин В.Н., Гамза В.А., Екатеринославский Ю.Ю., Иванушко П.Н. Управление рисками фирмы: Изд-во «Финансы и статистика», 2006. – 400с.
4. В. Цветкова, И. О. Арлюкова. - СПб.: С.-Петербург. ин-т внешнеэкономических связей экономики и права: О-во «Знание» С.-Петербурга и Ленинград. обл., 2002.

Дополнительная

5. К. В., Воробьев С. Н. Системный анализ управления рисками в предпринимательстве. - Воронеж: МОДЭК, 2005.
6. Домашенко Д. В., Финогенова Ю. Ю. Управление рисками в условиях финансовой нестабильности / Издательство: «МАГИСТР», 2010 - с.240
7. Филин С. Инвестиционный риск и его составляющие при принятии инвестиционных решений // Инвестиции в России. - 2002. - № 4. - С. 11-18.

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 полученные в ходе курса;
- практическое овладение методиками, изученными на лекциях и семинарах;
- 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 Times New Roman, 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» относится к вариативной части курсов подготовки студентов по направлению 38.04.02 «Менеджмент» (уровень магистратуры), направленность «Международный логистический менеджмент». Дисциплина реализуется на факультете управления, кафедрой математических методов 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:

ОПК-2 - готовностью руководить коллективом в сфере своей

профессиональной деятельности, толерантно воспринимая социальные, этнические, конфессиональные и культурные различия

ПК-10 - способностью разрабатывать учебные программы и методическое обеспечение управленческих дисциплин, а также применять современные методы и методики в процессе их преподавания

В результате освоения дисциплины обучающийся должен:

1. *Знать:*

- сущность, содержание, цели, принципы и функции управления в условиях неопределенности и рисков;
- современные методики идентификации и управления рисками;
- основные виды оптимизационных моделей управления рисками.

2. *Уметь:*

- разрабатывать и реализовывать на практике стратегические, тактические и оперативные планы управления рисками, и координировать их с основными управленческими процессами внутри организации;
- осуществлять постоянный мониторинг за изменениями, происходящими во внутренней и внешней средах организации для учета возникающих рисков и принятия своевременных мер.

3. *Владеть:*

- методами и инструментами анализа и оптимизации рисков в условиях неопределенности;

- ведущими мировыми практиками и компьютерными технологиями управления организацией в условиях неопределенности и рисков.

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 проводится на семинарских занятиях в форме обсуждения проблемных вопросов, затронутых на лекциях, решения оптимизационных задач по управлению рисками и тестирования.

Рабочей программой предусмотрена промежуточная аттестация в форме экзамена

Трудоемкость дисциплины составляет 2 зачетные единицы.

Приложение 2

ЛИСТ ИЗМЕНЕНИЙ

№	Текст актуализации или прилагаемый к РПД документ, содержащий изменения	Дата	№ протокола
1	Изменение академических часов в зачетной единице для набора 2020 (1з.е. -38час.), обновление программного обеспечения, БД и ИСС Приложение №1	18.06.2020г	№14

Приложение к листу изменений №1

1. Структура дисциплины (к п. 2 РПД на 2020)

Структура дисциплины для очно-заочной формы обучения

Общая трудоемкость дисциплины составляет 2 з. е., 76 ч., в том числе контактная работа обучающихся с преподавателем 16 ч., самостоятельная работа обучающихся 42 ч., итоговая аттестация (экзамен) 18 часов.

№ п/п	Раздел Дисциплины	Семестр	Виды учебной работы, включая самостоятел ную работу студентов и трудоемкость (в часах)				Формы текущего кон- троля успеваемости (по неделям семестра) Форма промежуточ- ной аттестации (по семестрам)
			Лекци и	Пра кт.з аня тия	Проме жуто чная аттес тация	СРС	
1	Введение. Современная методология управления в экономике и обще- стве. Основные понятия	2	1	2		8	Экспресс-опрос
2	Риски. Основные понятия, природа возникновения, классификация	2	1	2		10	Экспресс-опрос
3	Методы анализа, оценки и прогно- зирования рисков	2	1	4		12	Экспресс опрос.
4	Управление рисками. Риск- менеджмент	2	1	4		12	Экспресс-опрос. Решение задач.
	Итоговая аттестация				18		Экзамен
	ИТОГО		4	12	18	42	

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	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	Microsoft Office 2013	Microsoft	лицензионное
2	Kaspersky Endpoint Security	Kaspersky	лицензионное
3	Microsoft Office 2016	Microsoft	лицензионное
4	Visual Studio 2019	Microsoft	лицензионное
5	Adobe Creative Cloud	Adobe	лицензионное
6	Zoom	Zoom	лицензионное