

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего
образования
«ИРКУТСКИЙ НАЦИОНАЛЬНЫЙ ИССЛЕДОВАТЕЛЬСКИЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ
УНИВЕРСИТЕТ»

Структурное подразделение «Менеджмента»

УТВЕРЖДЕНА:
на заседании кафедры
Протокол №07 от 04 февраля 2025 г.

Рабочая программа дисциплины

«РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ»

Направление: 38.04.02 Менеджмент

Стратегический менеджмент в ТЭК

Квалификация: Магистр

Форма обучения: очная

Документ подписан простой электронной подписью Составитель программы: Пригожин Вячеслав Львович Дата подписания: 23.04.2025

Документ подписан простой электронной подписью Утвердил и согласовал: Бережных Мария Валерьевна Дата подписания: 02.06.2025

Год набора – 2025

Иркутск, 2025 г.

1 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесённых с планируемыми результатами освоения образовательной программы

1.1 Дисциплина «Риск-менеджмент» обеспечивает формирование следующих компетенций с учётом индикаторов их достижения

Код, наименование компетенции	Код индикатора компетенции
ПК-4 Способность использовать количественные и качественные методы для проведения исследований и аналитического обеспечения управления бизнес-процессами	ПК-4.4

1.2 В результате освоения дисциплины у обучающихся должны быть сформированы

Код индикатора	Содержание индикатора	Результат обучения
ПК-4.4	Способен к аналитической работе с информацией для выявления и оценки рисков	Знать инструменты и методы работы с информацией для выявления и оценки рисков; Уметь принимать аналитические решения по риск-менеджменту; Владеть современными методиками выявления и оценки показателей риска.

2 Место дисциплины в структуре ООП

Изучение дисциплины «Риск-менеджмент» базируется на результатах освоения следующих дисциплин/практик: «Разработка и принятие управленческих решений»

Дисциплина является предшествующей для дисциплин/практик: «Отраслевой менеджмент»

3 Объем дисциплины

Объем дисциплины составляет – 2 ЗЕТ

Вид учебной работы	Трудоемкость в академических часах (Один академический час соответствует 45 минутам астрономического часа)	
	Всего	Семестр № 3
Общая трудоемкость дисциплины	42	42
Аудиторные занятия, в том числе:	30	30
лекции	30	30
лабораторные работы	0	0
практические/семинарские занятия	0	0
Контактная работа, в том числе	0	0
в форме работы в электронной информационной образовательной среде	0	0
Самостоятельная работа (в т.ч. курсовое проектирование)	12	12
Трудоемкость промежуточной	0	0

аттестации		
Вид промежуточной аттестации (итогового контроля по дисциплине)	Зачет	Зачет

4 Структура и содержание дисциплины

4.1 Сводные данные по содержанию дисциплины

Семестр № 3

№ п/п	Наименование раздела и темы дисциплины	Виды контактной работы						СРС		Форма текущего контроля
		Лекции		ЛР		ПЗ(СЕМ)				
		№	Кол. Час.	№	Кол. Час.	№	Кол. Час.	№	Кол. Час.	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
1	Основные аспекты и современные тенденции риск- менеджмента	1	6					1	3	Тест
2	Использование информации для анализа и оценки степени риска	2	8					2	3	Тест
3	Отраслевой риск- менеджмент	3	8					1	3	Тест
4	Риск-менеджмент в инвестиционных стратегиях	4	8					2	3	Тест
	Промежуточная аттестация									Зачет
	Всего		30						12	

4.2 Краткое содержание разделов и тем занятий

Семестр № 3

№	Тема	Краткое содержание
1	Основные аспекты и современные тенденции риск-менеджмента	Основные определения и понятия риск-менеджмента. Процессы управления риском. Основные элементы и этапы управления риском. Манипулирование риском. Функции риск-менеджмента. Организация риск-менеджмента. Правила риск-менеджмента. Расчет коэффициента риска. Функции отдела рискованных вложений капитала. Информационное обеспечение функционирования риск-менеджмента.
2	Использование информации для анализа и оценки степени риска	Идентификация и концептуальные направления анализа рисков. Качественный анализ. Количественная оценка. Этапы идентификации и анализа рисков. Принципы информационного обеспечения системы управления риском. Общие группы источников информации при анализе

		конкретных рисков. Концепция приемлемого риска. Пороговые значения риска. Определение степени риска. Методы оценки риска.
3	Отраслевой риск-менеджмент	Управление рисками по отраслям народного хозяйства. Классы источников информационной неопределенности. Подход к управлению рисками Ф. Найта. Управление рисками, возникающими при лизинговом инвестировании. Страховая защита участников лизинговой сделки. Превентивные и поддерживающие мероприятия риск-стратегий. Матрица стратегического потенциала. Хеджирование рисков. Форвардные и фьючерсные контракты. Опционы. Страхование или хеджирование. Модель хеджирования.
4	Риск-менеджмент в инвестиционных стратегиях	Анализ риска в инвестиционной программе с привлечением кредитов. Выбор оптимального инвестиционного проекта. Основные понятия и принципы оценки эффективности инвестиций. Эффективность участия в проекте собственного капитала. Интегральные показатели эффективности. Оценка эффективности: проекта в целом; участия в проекте. Показатели эффективности участия в проекте. Рациональный выбор инвестиционного портфеля. Реальные и финансовые инвестиции. Этапы процесса управления инвестициями. Портфельные стратегии: активные и пассивные. диверсифицированный портфель. Кривые безразличия. Рисковые и безрисковые активы. Анализ значений риска портфелей.

4.3 Перечень лабораторных работ

Лабораторных работ не предусмотрено

4.4 Перечень практических занятий

Практических занятий не предусмотрено

4.5 Самостоятельная работа

Семестр № 3

№	Вид СРС	Кол-во академических часов
1	Проработка разделов теоретического материала	6
2	Решение специальных задач	6

В ходе проведения занятий по дисциплине используются следующие интерактивные методы обучения: мозговой штурм, кейс-технологии

5 Перечень учебно-методического обеспечения дисциплины

5.1 Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

5.1.1 Методические указания для обучающихся по самостоятельной работе:

Методические указания по самостоятельной работе для магистров, обучающихся по направлению «Менеджмент» по дисциплине «Риск-менеджмент» [Электронный ресурс] / Изд-во ИРНИТУ, 2023.

6 Фонд оценочных средств для контроля текущей успеваемости и проведения промежуточной аттестации по дисциплине

6.1 Оценочные средства для проведения текущего контроля

6.1.1 семестр 3 | Тест

Описание процедуры.

Магистрантам предлагается тест, состоящий из 10 вопросов по теме, на заполнение теста дается 20 минут. Из предложенных вариантов ответов на вопрос магистр должен выбрать один или несколько правильных.

Критерии оценивания.

«отлично» - обучающийся при тестировании набрал более 90 % правильных ответов.

«хорошо» - обучающийся при тестировании набрал от 80 % до 89 % правильных ответов

«удовлетворительно» - обучающийся при тестировании набрал от 70 % до 79 % правильных ответов.

«неудовлетворительно» - обучающийся при тестировании набрал менее 70 % правильных ответов.

6.2 Оценочные средства для проведения промежуточной аттестации

6.2.1 Критерии и средства (методы) оценивания индикаторов достижения компетенции в рамках промежуточной аттестации

Индикатор достижения компетенции	Критерии оценивания	Средства (методы) оценивания промежуточной аттестации
ПК-4.4	Использует инструменты оценки, анализа и управления рисками в аналитической работе	Устный опрос или тестирование

6.2.2 Типовые оценочные средства промежуточной аттестации

6.2.2.1 Семестр 3, Типовые оценочные средства для проведения зачета по дисциплине

6.2.2.1.1 Описание процедуры

Подготовка к зачету – предполагает работу с вопросами (которые выдаются заранее) на основе лекционного материала, а также изученного самостоятельно.

Зачет по дисциплине «Риск-менеджмент» проводится в письменной форме по тесту. Тест содержит 20 вопросов. Пример теста приведен ниже. Для подготовки ответов на вопросы теста магистранту отведено не более 45 минут. Из предложенных вариантов ответов на вопрос магистрант должен выбрать один правильный ответ.

Пример задания:

Пример теста для зачета

- 1) Что из перечисленного не является функциями субъекта управления в риск-менеджменте?
 - а) прогнозирование;
 - б) нормирование;
 - в) организация;
 - г) регулирование;
 - д) координация;
 - е) распределение;
 - ж) стимулирование;
 - з) контроль.
- 2) Что из перечисленного является правилами риск-менеджмента?
 - а) нельзя рисковать многим ради малого;
 - б) риск – дело благородное;
 - в) нельзя думать, что существует только одно решение, возможно, есть и другие;
 - г) при существовании нескольких вариантов, следует идти по пути минимально риска;
 - д) положительное решение принимается лишь при отсутствии сомнения.
- 3) Какие из перечисленных источников могут использоваться для информационного обеспечения риск-менеджмента?
 - а) контракты, договоры об имущественных сделках;
 - б) имидж руководства организации;
 - в) кредитные договоры;
 - г) тенденции развития рынков;
 - д) бухгалтерская отчетность;
 - е) статистическая отчетность.
- 4) VAR – это:
 - а) парадигма стоимости риска (Value-at-Risk);
 - б) показатель объемов потерь прибыли (Volume at Reduce);
 - в) степень сопротивления персонала рискованным проектам (Volume at Resistance);
 - г) объем риска (Volume of Accepted Risk).
- 5) Инновационный риск – это:
 - а) риск срыва сроков сдачи результатов научно-технических исследований;
 - б) риск того, что новый товар не будет принят рынком;
 - в) риск того, что инновационный проект не будет реализован или окуплен;
 - г) риск, связанный с утечкой информации об используемых фирмой инновациях.
- 6) Что из перечисленного не относится к видам производственных рисков?
 - а) изменение конъюнктуры рынка;
 - б) усиление конкуренции;
 - в) форс-мажор;
 - г) амортизация производственного оборудования.
- 7) Какой метод оценки вероятностей используется в страховании?
 - а) система неопределенностей;

- б) нормальное распределение;
 - в) пороговые значения риска.
- 8) Снижение риска за счет увеличения количества поставщиков, позволяющего ослабить зависимость предприятия от конкретного поставщика, – это:
- а) диверсификация рынка сбыта (развитие рынка);
 - б) диверсификация видов хозяйственной деятельности;
 - в) диверсификация закупок;
 - г) диверсификация инвестиций.
- 9) Снижение риска за счет распределения готовой продукции предприятия между несколькими рынками или контрагентами – это:
- а) диверсификация рынка сбыта (развитие рынка);
 - б) диверсификация видов хозяйственной деятельности;
 - в) диверсификация закупок;
 - г) диверсификация инвестиций.
- 10) Снижение риска за счет расширения ассортимента выпускаемой продукции, оказываемых услуг, спектра используемых технологий – это:
- а) диверсификация рынка сбыта (развитие рынка);
 - б) диверсификация видов хозяйственной деятельности;
 - в) диверсификация закупок;
 - г) диверсификация инвестиций.
- 11) Диссипация риска при формировании инвестиционного портфеля, предполагающего реализацию одновременно нескольких проектов, носит название:
- а) диверсификация рынка сбыта (развитие рынка);
 - б) диверсификация видов хозяйственной деятельности;
 - в) диверсификация закупок;
 - г) диверсификация инвестиций.
- 12) Отклонение от многолетнего тренда урожайности показывает:
- а) вероятностный уровень снижения урожайности сельскохозяйственных культур вследствие воздействия неблагоприятных природно-климатических условий;
 - б) какой размер резервного фонда зерна необходим для погашения неблагоприятного влияния снижения урожайности зерновых культур на результаты хозяйственной деятельности;
 - в) какого количества резервных фондов зерна будет достаточно.
- 13) Критерий среднего отклонения показывает:
- а) вероятностный уровень снижения урожайности сельскохозяйственных культур вследствие воздействия неблагоприятных природно-климатических условий;
 - б) какой размер резервного фонда зерна необходим для погашения неблагоприятного влияния снижения урожайности зерновых культур на результаты хозяйственной деятельности;
 - в) какого количества резервных фондов зерна будет достаточно.
- 14) Превентивные и поддерживающие мероприятия являются составными элементами:
- а) диверсификации;
 - б) функционально-поддерживающей стратегии;
 - в) метода минимизации риска;
 - г) самострахования.
- 15) При минимизации рисков лизинговых операций российские компании используют следующие виды гарантийного обеспечения:
- а) страхование;
 - б) создание резервов;
 - в) поручительство надежных компаний;
 - г) ипотека.

16) Примером покрытия ущерба за счет передачи ответственности на основе договора является:

- а) хеджирование;
- б) кэптивные страховые организации;
- в) нестраховой пул;
- г) самострахование.

17) Метод покрытия убытков из текущих доходов используют, если:

- а) величина убытков не велика;
- б) величина убытков велика;
- в) это не искажает денежных потоков;
- г) организация хочет возложить ответственность за возмещение возможного ущерба на специализированную организацию.

18) Особенностью метода покрытия убытка на основе самострахования является:

- а) работа с большим числом однородных рисков;
- б) работа только с неоднородными рисками;
- в) работа с катастрофическими рисками.

19) Показатель допустимого риска не должен:

- а) превышать предельного значения;
- б) быть меньше предельной величины;
- в) быть равным нулю.

20) Первая точка кривой рисков определяет:

- а) величину потерь, равных расчетной выручке;
- б) вероятность нулевых потерь;
- в) вероятности нежелательного исхода.

-

6.2.2.1.2 Критерии оценивания

Зачтено	Не зачтено
выставляется, если магистрант правильно раскрывает понятия, применяет профессиональную терминологию, конкретные умения в области сущности рисков и использования рыночной информации для выбора методик анализа, оценки и управления рисками деятельности субъектов хозяйствования	если магистрант неправильно раскрывает основные понятия, применяет профессиональную терминологию, конкретные умения в области сущности рисков и использования рыночной информации для выбора методик анализа, оценки и управления рисками деятельности субъектов хозяйствования

7 Основная учебная литература

1. Гончаренко Л. П. Риск-менеджмент : учебное пособие / Л. П. Гончаренко, С. А. Филин; под ред. Е. А. Олейникова, 2010. - 215.
2. Васин С. М. Управление рисками на предприятии : учебное пособие по специальности "Менеджмент организации" / С. М. Васин, В. С. Шутов, 2010. - 298.
3. Уродовских В. Н. Управление рисками предприятия : учебное пособие для студентов вузов по специальности "Менеджмент организации" / В. Н. Уродовских, 2014. - 167.

8 Дополнительная учебная литература и справочная

1. Риск-менеджмент : учебное пособие / ред. В. Н. Круглов, 2025. - 260.

2. Риск-менеджмент в коммерческом банке : монография / ред. И. В. Ларионова, 2025. - 454.
3. Федорова А. В. Риск-менеджмент. Для менеджеров : учебное пособие / А. В. Федорова, 2024. - 212.

9 Ресурсы сети Интернет

1. <http://library.istu.edu/>
2. <https://e.lanbook.com/>

10 Профессиональные базы данных

1. <http://new.fips.ru/>
2. <http://www1.fips.ru/>

11 Перечень информационных технологий, лицензионных и свободно распространяемых специализированных программных средств, информационных справочных систем

1. Microsoft Windows (XP Prof + Vista Bussines) rus VLK поставка 08_2007

12 Материально-техническое обеспечение дисциплины

1. Мультимедийное оборудование ViewSonic PJD7820HD с экраном ScreenMedia Champion