**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ**

**УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ**

**«МОСКОВСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ИМЕНИ М.В.ЛОМОНОСОВА»**

ЭКОНОМИЧЕСКИЙ ФАКУЛЬТЕТ

|  |
| --- |
| «УТВЕРЖДАЮ»Декан экономического факультета МГУпрофессор \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ А.А.Аузан«\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_2021 год |
|  |

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

**Наименование дисциплины:**

**РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ В БИЗНЕСЕ**

**Уровень высшего образования:**

МАГИСТРАТУРА

**Направление подготовки:**

38.04.02. МЕНЕДЖМЕНТ

**Форма обучения:**

ОЧНАЯ

Рабочая программа рассмотрена и одобрена

*Учебно-методической комиссией экономического факультета*

(протокол №\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_, дата)

Москва 2021

Рабочая программа дисциплины разработана в соответствии с самостоятельно установленным МГУ образовательным стандартом (ОС МГУ) для реализуемых основных профессиональных образовательных программ высшего образования по направлению подготовки магистратуры 38.04.02. Менеджмент

ОС МГУ утвержден решением Ученого совета МГУ имени М.В.Ломоносова от 28 декабря 2020 года, протокол №7

Год (годы) приема на обучение: 2021 и последующие

1. **Место и статус дисциплины в структуре основной профессиональной образовательной программы подготовки магистра**

Статус дисциплины: *вариативная*

Триместр: 4 триместр

1. **Входные требования (реквизиты) для освоения дисциплины**

*Для успешного освоения данного курса требуются знания и умения, полученные в следующих дисциплинах:*

* Стратегический менеджмент
* Управление компанией
* Управление проектами в цифровой экономике
1. **Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с требуемыми компетенциями выпускников**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Компетенции выпускников (коды)** | **Индикаторы (показатели) достижения компетенций** | **Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю), сопряженные с компетенциями** |
| ПК-11. Способен самостоятельно создавать модели и алгоритмы типовых и нестандартных организационно-управленческих задач по оптимизации внутренней среды и адаптации к требованиям внешней среды для деятельности конкретного функционального подразделения и организации в целом | ПК-11.И-1. Проводит анализ факторов внешней и внутренней среды деятельности конретного функционального подразделения и организации в целом | ПК-11.И-1.У-1. Умеет собирать и обрабатывать необходимую информацию для проведения анализа внешней и внутренней среды деятельности конкретного функционального подразделения и организации в целом  |
| ПК-11.И-2. Разрабатывает модели и алгоритмы типовых и нестандартных организационно-управленческих решений | ПК-11.И-2.У-1. Умеет использовать основные методы анализа и моделирования управленческих решений в условиях неопределённости и недостаточности информации  |
| ПК-11.И-2.У-2. Умеет разрабатывать и обосновывать эффективные организационно-управленческие решения с учётом требований внешней и внутренней среды  |
| ПК-13. Способен планировать, организовывать и управлять предпринимательской деятельностью | ПК-13.И-1. Разрабатывает и внедряет стратегии предпринимательской деятельности | ПК-13.И-2.У-1. Умеет оценивать факторы внешней и внутренней среды, их влияние на условия и результаты предпринимательской деятельности |
| ПК-14. Способен обосновывать выбор вариантов управленческих решений, вырабатывать и предоставлять рекомендации по совершенствованию управленческой деятельности компаний и организаций разных организационно-правовых форм на основе критериев финансово-экономической эффективности | ПК-14.И-1. Предлагает отвечающие критериям финансово-экономической эффективности управленческие решения для компаний и организаций | ПК-14.И-1.З-1. Знает критерии и методы оценки финансово-экономической эффективности, используемые для принятия управленческих решений |
| ПК-14.И-1.У-2. Умеет проводить финансово-экономическую оценку вариантов управленческих решений для компаний и организаций разных организационно-правовых форм |
| ПК-14.И-2. Разрабатывает и формулирует обоснованные предложения по повышению финансово-экономической эффективности управленческой деятельности компаний и организаций | ПК-14.И-2.У-1. Умеет диагностировать возможности по совершенствованию управленческой деятельности компаний и организаций с точки зрения финансово-экономической эффективности |
| ПК-14.И-2.У-2. Умеет разрабатывать и обосновывать мероприятия по совершенствованию управленческой деятельности компаний и организаций разных организационно-правовых форм |
| ПК-17. Способен выступать в роли инициатора запуска проектов и программ, принимать участие в формировании портфеля проектов и программ организации | ПК-17.И-2. Формирует портфель проектов, исходя из стратегических целей организации | ПК-17.И-2.У-1. Умеет применять модели анализа портфеля проектов, оценивать эффективность каждого проекта и расставлять приоритеты с учетом стратегических целей организации и ограниченности ресурсов |
| ПК-17.И-2.У-2. Умеет идентифицировать, оценивать и управлять рисками при формировании портфеля проектов и программ |
| МПК-2. Способен организовывать новые предпринимательские структуры и разрабатывать стратегии их поведения на различных рынках | МПК-2.И-2. Разрабатывает стратегии поведения предпринимательских структур на различных рынках с учётом существующих и потенциальных рисков, принимая наиболее рациональные и эффективные решения | МПК-2.И-2.У-1. Умеет оценивать экономические и социальные условия осуществления предпринимательской деятельности, выявлять новые рыночные возможности и формировать новые бизнес-модели |
| МПК-3. Способен разрабатывать проектные решения, бизнес-планы и бизнес-модели, применяя технологии анализа данных, а также предложения и мероприятия по реализации разработанных проектов и программ | МПК-3.И-2. Использует современные методы анализа данных в процессе разработки, анализа и реализации проектных решений, бизнес-планов и бизнес-моделей  | МПК-3.И-2.У-1. Умеет применять основные методы анализа данных в процессе разработки и реализации проектных решений, бизнес-планов и бизнес-моделей |
| МПК-4. Способен оценивать результаты реализации стратегий и проектов, проводить аналитические исследования и осуществлять консультационную деятельность в сфере актуальных проблем управления развитием бизнеса на основе анализа данных | МПК-4.И-2. Проводит аналитические исследования в сфере актуальных проблем управления развитием бизнеса | МПК-4.И-2.У-2. Умеет проводить сбор информации о бизнес-проблемах или бизнес-возможностях для целей исследования |
| МПК-4.И-2.У-3. Уметь применять современные методы проведения аналитических исследований и использовать способы сбора, обработки и анализа данных  |
| МПК-4.И-3. Осуществляет консультационную деятельность в сфере актуальных проблем управления развитием бизнеса, в том числе на основе методов анализа данных | МПК-4.И-3.У-1. Умеет профессионально проводить анализ и обосновать решения по развитию бизнеса по заданиям заказчика |

1. **Объем дисциплины по видам занятий**

Объем дисциплины составляет \_3\_ зачетные единицы: \_108\_ академических часов, в том числе \_52\_ академических часов составляет контактная работа с преподавателем, \_56\_ академических часов составляет самостоятельная работа магистранта.

1. **Формат обучения \_** очное, c использованием обучающей среды On.Econ **\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_**
2. **Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и виды учебных занятий**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Наименование и краткое содержание разделов и тем дисциплины (модуля),** **Форма промежуточной аттестации по дисциплине (модулю)** | **Всего****(часы**) | В том числе |
| **Контактная работа (работа во взаимодействии с преподавателем)** ***Виды контактной работы, часы*** | **Самостоятельная работа обучающегося** ***Виды самостоятельной работы, часы*** |
| Занятия семинарского типа | Групповые консультации | Индивидуальные консультации | **Всего** | Подготовка к аудиторным занятиям | Самостоятельная внеаудиторная работа | **Всего** |
| Тема 1. Понятие рискованности в бизнесе. Инструментарий риск-анализа | **14** | **4** | **4** | **-** | **8** | **2** | **4** | **6** |
| Тема 2. Методы анализа и оценки рисков в бизнесе | **16** | **4** | **4** | **-** | **8** | **4** | **4** | **8** |
| Тема 3. Методы количественного риск-менеджмента в бизнесе | **20** | **4** | **8** | **-** | **12** | **4** | **4** | **8** |
| Тема 4. Страховая защита бизнеса | **14** | **4** | **4** | **-** | **8** | **2** | **4** | **6** |
| Тема 5. Построение системы управления рисками | **16** | **4** | **4** | **-** | **8** | **4** | **4** | **8** |
| Тема 6. Риск-менеджмент как инструмент повышения эффективности бизнеса | **12** | **4** | **-** | **-** | **4** | **4** | **4** | **8** |
| Промежуточная аттестация (защита проектов) | 12 | 4 |  |  | **4** | 4 | 4 | **8** |
| **Итого**  | **108** | **52** | **56** |

**Краткое содержание тем дисциплины**

**Тема 1. Понятие рискованности в бизнесе. Инструментарий риск-анализа**

Сущность и концепции управления рисками в бизнесе. Принятие решений в условиях риска. Практические методы учета рисков.

*Основная литература:*

1. «Риск-менеджмент инвестиционного проекта» под общей редакцией Грачевой М.В. Второе издание, переработанное и дополненное. Учебник. М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2017. – 663.
2. Грачева М.В. «Рабочая тетрадь по анализу и управлению рисками» М.: Экономический факультет МГУ имени М. В. Ломоносова, 2021
3. «Математические и инструментальные методы в современных экономических исследованиях». Коллективная монография под общей редакцией М.В.Грачевой - М.:  Экономический факультет МГУ имени М. В. Ломоносова, 2018

*Дополнительная литература:*

*Книги*

1. Антонов, В.Г. Управление рисками приоритетных инвестиционных проектов. концепция и методология - М.: Русайнс, 2018. - 35 c.
2. Балдин, К.В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия: Учебное пособие - М.: Дашков и К, 2015. - 418 c.
3. Вяткин В.Н., Гамза, В.А., Маевский Ф.В. Риск-менеджмент. - М.: Юрайт, 2017. - 366 с.
4. Кирюшкин, В.Е. Основы риск-менеджмента— М.: Анкил, 2017. — 132 c.
5. Тебекин, А.В. Управление рисками инновационно-инвестиционных проектов - М.: Русайнс, 2018. - 160 c.

*Статьи*

1. Грачева М.В. Учет проектных рисков в нестационарных условиях - Международный бухгалтерский учет. том 19, № 19, с. 18-33, 2016.
2. Голубева С.С., Рзаева Л.Р. Особенности формирования системы риск-менеджмента предприятия // Бизнес и стратегии. - 2016. - № 3. - С. 26 - 30.
3. Капустина Н.В. Инновационный подход к управлению рисками на предприятиях // Экономика, социология и право. - 2014. - № 3. - С. 43 - 46.
4. Киселева И.А. Риск-менеджмент в бизнесе // Проблемы современной науки и образования. - 2017. - № 13. - С. 62 - 65.

**Тема 2. Методы анализа и оценки рисков в бизнесе**

Качественный подход. Количественные методы: анализ чувствительности, сценарный подход

*Основная литература:*

1. «Риск-менеджмент инвестиционного проекта» под общей редакцией Грачевой М.В. Второе издание, переработанное и дополненное. Учебник. М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2017. – 663.
2. Грачева М.В. «Рабочая тетрадь по анализу и управлению рисками» М.: Экономический факультет МГУ имени М. В. Ломоносова, 2021
3. «Математические и инструментальные методы в современных экономических исследованиях». Коллективная монография под общей редакцией М.В.Грачевой - М.:  Экономический факультет МГУ имени М. В. Ломоносова, 2018

*Дополнительная литература:*

Книги

1. Белов, П.Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. частях: Учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры - Люберцы: Юрайт, 2016. - 250 c.
2. Воронцовский, А.В. Управление рисками: Учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры - Юрайт, 2016. - 414 c.
3. Круи, М. Основы риск-менеджмента — Юрайт, 2017. — 390 c.
4. Кудрявцев, А.А. Интегрированный риск-менеджмент — М.: Экономика, 2018. — 655 c.
5. Тебекин, А.В. Управление рисками инновационно-инвестиционных проектов - М.: Русайнс, 2018. - 160 c.

Статьи

1. Грачева М.В., Петренева Е.А. «Реальные опционы как инструменты управления проектными рисками» - Финансовая аналитика: проблемы и решения. №10(292), с. 2-15, 2016
2. Грачева М.В., Степанова М.В. Методы управления рисками инвестиционных программ нефтегазовой отрасли - Финансовая аналитика: проблемы и решения. том 10, № 1, с. 29-49, 2017.
3. Грачева М.В., Петренева Е.А. Применение метода реальных опционов при управлении проектными рисками: возможности и ограничения - Аудит и финансовый анализ. № 6, с. 627-638, 2017
4. Выонг Х.Б. Количественные методы в риск-менеджменте // Актуальные вопросы экономических наук. - 2016. - № 1. - С. 42 - 47.
5. Зленко А.С. Различные подходы к определению риска в системе риск-менеджмента // Современные тенденции развития науки и технологий. - 2016. - № 11. - С. 58 – 62, - 2017. - № 13. - С. 62 - 65.

 Интернет-ресурсы

1. URL: https://practicum-group.com/.
2. URL: www.businesskompas.ru — портал «Бизнес-компас». Организация бизнеса, своего дела, бизнес с нуля.
3. URL: www.business-plany.ru — портал о бизнес-планировании.
4. URL: www.cfin.ru — сайт «Корпоративный менеджмент».
5. URL: www.finman.ru — сайт «Финансовый менеджмент».
6. URL: www.mind-map.ru.
7. URL: www.probp.ru — сайт «Бизнес-план для практиков».

**Тема 3. Методы количественного риск-менеджмента в бизнесе**

Имитационное моделирование, понятие об опционном подходе в управлении рисками

 *Основная литература:*

1. «Риск-менеджмент инвестиционного проекта» под общей редакцией Грачевой М.В. Второе издание, переработанное и дополненное. Учебник. М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2017. – 663.
2. Грачева М.В. «Рабочая тетрадь по анализу и управлению рисками» М.: Экономический факультет МГУ имени М. В. Ломоносова, 2021
3. «Математические и инструментальные методы в современных экономических исследованиях». Коллективная монография под общей редакцией М.В.Грачевой - М.:  Экономический факультет МГУ имени М. В. Ломоносова,

*Дополнительная литература:*

Книги

1. Воронцовский, А.В. Управление рисками: Учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры - Юрайт, 2016. - 414 c.
2. Кудрявцев, А.А. Интегрированный риск-менеджмент — М.: Экономика, 2018. — 655 c.
3. Тебекин, А.В. Управление рисками инновационно-инвестиционных проектов - М.: Русайнс, 2018. - 160 c.

Статьи

1. Грачева М.В., Петренева Е.А. «Реальные опционы как инструменты управления проектными рисками» - Финансовая аналитика: проблемы и решения. №10(292), с. 2-15, 2016
2. Грачева М.В., Петренева Е.А. Применение метода реальных опционов при управлении проектными рисками: возможности и ограничения - Аудит и финансовый анализ. № 6, с. 627-638, 2017
3. Выонг Х.Б. Количественные методы в риск-менеджменте // Актуальные вопросы экономических наук. - 2016. - № 1. - С. 42 - 47.

**Тема 4. Страховая защита бизнеса**

Страхование – один из ключевых методов управления рисками. Обязательное и добровольное страхование. Комплексная страховая защита предприятий.

*Основная литература:*

1. Гражданский кодекс Российской Федерации. Часть вторая, Глава 48 «Страхование».
2. Закон Российской Федерации «Об организации страхового дела в Российской Федерации» № 4015-1 от 27 ноября 1992 г. (в редакции последующих изменений и дополнений).
3. Страхование и управление рисками: Учебник. / Под ред. Г.В. Черновой. - М.: Изд-во Юрайт, 2019.

*Дополнительная литература:*

1. Официальные сайты страховых копаний
2. Статьи журналов «Страховое дело», «Управление Риском» издательства «Анкил»

**Тема 5. Построение системы управления рисками**

Международные и национальные стандарты управления рисками. Отличия и общие черты при построении систем управления рисками в компаниях различных секторов экономики. Управление рисками на предприятиях малого и среднего бизнеса.

*Основная литература:*

1. ГОСТ Р ИСО 31000-2018. Менеджмент риска. Принципы и руководство.
2. ГОСТ Р ИСО/МЭК 31010-2011. Национальный стандарт Российской Федерации. Менеджмент риска. Методы оценки риска.
3. Кудрявцев А.А. Интегрированный риск-менеджмент: Учебник. – Москва: ЗАО «Издательство «Экономика», 2010.

*Дополнительная литература:*

1. Committee of Sponsoring Organizations of the Treadway Commission (COSO). Enterprise Risk Management – 2017. // Комитет организаций-спонсоров Комиссии Тредвея: [www.coso.org/Pages/erm.aspx](http://www.coso.org/Pages/erm.aspx)
2. FERMA a risk management standard. Federation of European risk management association - 2002// [www.insurance-institute.ru](http://www.insurance-institute.ru)
3. ISO 31000-2018 - Risk management. [электронный ресурс] // International Organization for Standardization. [www.iso.org/rustandard/65694.html](http://www.iso.org/rustandard/65694.html)

**Тема 6. Риск-менеджмент как инструмент повышения эффективности бизнеса**

Принципы риск-менеджмента в компании. Риск-ориентированный подход к анализу бизнес-процессов. Управление рисками и стоимость компании. Культура управления рисками. Применение современных технологий в риск-менеджменте.

*Основная литература:*

1. Круи М., Галай Д., Марк Р. Основы риск-менеджмента : пер. с англ. / науч. ред. В. Б. Минасян. – М. : Юрайт, 2016.
2. ГОСТ Р ИСО/МЭК 31010-2011. Национальный стандарт Российской Федерации. Менеджмент риска. Методы оценки риска.

*Дополнительная литература:*

1. ГОСТ Р ИСО 31000-2018. Менеджмент риска. Принципы и руководство.
2. Инновации на финансовых рынках. Под редакцией Н. И. Берзона, Т.В. Тепловой. - М.: Издательский дом Высшей школы экономики, 2013
3. Аналитические материалы и обзоры ведущих консалтинговых и рейтинговых агентств
4. **Фонд оценочных средств для оценивания результатов обучения по дисциплине**
	1. **Примеры оценочных средств:**

|  |  |
| --- | --- |
| **Результаты обучения по дисциплине**  | **Виды оценочных средств** |
| ПК-11.И-1.У-1. Умеет собирать и обрабатывать необходимую информацию для проведения анализа внешней и внутренней среды деятельности конкретного функционального подразделения и организации в целом  | Выполнение заданий на аудиторных занятияхДомашнее задание 1 |
| ПК-11.И-2.У-1. Умеет использовать основные методы анализа и моделирования управленческих решений в условиях неопределённости и недостаточности информации  |
| ПК-11.И-2.У-2. Умеет разрабатывать и обосновывать эффективные организационно-управленческие решения с учётом требований внешней и внутренней среды  |
| ПК-13.И-2.У-1. Умеет оценивать факторы внешней и внутренней среды, их влияние на условия и результаты предпринимательской деятельности | Выполнение заданий на аудиторных занятияхДомашнее задание 2 |
| ПК-14.И-1.З-1. Знает критерии и методы оценки финансово-экономической эффективности, используемые для принятия управленческих решений |
| ПК-14.И-1.У-2. Умеет проводить финансово-экономическую оценку вариантов управленческих решений для компаний и организаций разных организационно-правовых форм |
| ПК-14.И-2.У-1. Умеет диагностировать возможности по совершенствованию управленческой деятельности компаний и организаций с точки зрения финансово-экономической эффективности | Выполнение заданий на аудиторных занятияхДомашнее задание 5 |
| ПК-14.И-2.У-2. Умеет разрабатывать и обосновывать мероприятия по совершенствованию управленческой деятельности компаний и организаций разных организационно-правовых форм |
| ПК-17.И-2.У-1. Умеет применять модели анализа портфеля проектов, оценивать эффективность каждого проекта и расставлять приоритеты с учетом стратегических целей организации и ограниченности ресурсов | Выполнение заданий на аудиторных занятияхДомашнее задание 1Домашнее задание 2Домашнее задание 3 |
| ПК-17.И-2.У-2. Умеет идентифицировать, оценивать и управлять рисками при формировании портфеля проектов и программ |
| МПК-2.И-2.У-1. Умеет оценивать экономические и социальные условия осуществления предпринимательской деятельности, выявлять новые рыночные возможности и формировать новые бизнес-модели | Выполнение заданий на аудиторных занятияхДомашнее задание 1Домашнее задание 2Домашнее задание 3Домашнее задание 4Домашнее задание 5Промежуточная аттестация: Экзамен (презентация и защита подготовленных Отчетов по риск-менеджменту в бизнесе) |
| МПК-3.И-2.У-1. Умеет применять основные методы анализа данных в процессе разработки и реализации проектных решений, бизнес-планов и бизнес-моделей |
| МПК-4.И-2.У-2. Умеет проводить сбор информации о бизнес-проблемах или бизнес-возможностях для целей исследования |
| МПК-4.И-2.У-3. Уметь применять современные методы проведения аналитических исследований и использовать способы сбора, обработки и анализа данных  |
| МПК-4.И-3.У-1. Умеет профессионально проводить анализ и обосновать решения по развитию бизнеса по заданиям заказчика |

* 1. **Критерии оценивания (баллы) по дисциплине:**

|  |  |
| --- | --- |
| **Виды оценочных средств** | **Баллы** |
| Выполнение заданий на аудиторных занятиях | 60 |
| Домашнее задание 1 | 10 |
| Домашнее задание 2 | 10 |
| Домашнее задание 3 | 20 |
| Домашнее задание 4 | 10 |
| Домашнее задание 5 | 10 |
| Промежуточная аттестация: Экзамен (презентация и защита подготовленных Отчетов по риск-менеджменту в бизнесе) | 30 |
| **Итого** | **150** |

* 1. **Оценка по дисциплине выставляется, исходя из следующих критериев:**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Оценка** | **Минимальное количество баллов** | **Максимальное количество баллов** |
| *Отлично*  | 127,5 | 150,0 |
| *Хорошо*  | 97,5 | 127,4 |
| *Удовлетворительно*  | 60,0 | 97,4 |
| *Неудовлетворительно*  | 0,0 | 59,9 |

**Примечание:** в случае, если магистрант за триместр набирает менее 20% баллов от максимального количества по дисциплине, то уже на промежуточном контроле (и далее на пересдачах) действует следующее правило сдачи: «магистрант может получить только оценку «Удовлетворительно», и только если получит за промежуточный контроль, включающий весь материал дисциплины, не менее, чем 85% от баллов за промежуточный контроль».

* 1. **Типовые задания и иные материалы, необходимые для оценки результатов обучения:**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Темы** | **Аудиторные занятия** | **Самостоятельная работа студента с защитой результатов на контактных часах** |
| Тема 1. Понятие рискованности в бизнесе. Инструментарий риск-анализа | 1.1. Составление списка рисков проекта1.2. Проведение SWOT-анализа, разработка экспертной анкеты | Подготовка разделов отчета по риск-менеджменту в бизнесе на основе материалов некоторого проекта (название проекта, его резюме, цель, основные участники, значения критериев эффективности и пр., качественный анализ рисков этого проекта) |
| Тема 2. Методы анализа и оценки рисков в бизнесе | 2.1. Проведение качественного анализа проектных рисков2.2. Разработка системы управления рисками проекта2.3. Решение задач | Подготовка разделов отчета по риск-менеджменту в бизнесе на основе материалов некоторого проекта (анализ чувствительности, построение розы или спирали рисков, а также матрицы чувствительности и прогнозируемости, сценарный подход для риск-анализа проекта)  |
| Тема 3. Методы количественного риск-менеджмента в бизнесе | 3.1. Участие в дискуссии3.2. Решение задач | Подготовка разделов отчета по риск-менеджменту в бизнесе на основе материалов некоторого проекта (проведение анализа рисков с помощью имитационного моделирования, расчет стоимости реального опциона, связанного с возможностью прекратить реализацию проекта) |
| Тема 4. Страховая защита бизнеса | 4.1. Участие в дискуссии4.2. Решение задач | Подготовка разделов отчета по риск-менеджменту в бизнесе на основе материалов некоторого проекта (определение видов обязательного страхования применительно к данному проекту, расчетное обоснование возможности использования доброволь-ного страхования, анализ временнЫх изменений страховой защиты на различных стадиях жизненного цикла проекта) |
| Тема 5. Построение системы управления рисками | 5.1. Участие в дискуссии5.2. Анализ места подразделения по управлению рисками в организационной структуре рассматриваемых компаний | Подготовка разделов отчета по риск-менеджменту в бизнесе на основе материалов некоторого проекта (формирование организационной структуры управлениярисками, анализ нормативных и внутренних документов, а также порядка документооборота в части управления рисками, исследование изменений в организационной структуре и документообороту в части управления рисками на разных стадиях жизненного цикла проекта) |
| Тема 6. Риск-менеджмент как инструмент повышения эффективности бизнеса | Анализ раздела по управлению рисками в годовых отчетах российских и зарубежных компаний | Самостоятельная подготовка итогового отчета по риск-менеджменту в бизнесе на основе материалов некоторого проекта (оформление отчета и его размещение на он экон и отправка на электронные адреса преподавателей) |
| Промежуточная аттестация: Экзамен | Защита Отчета по риск-менеджменту в бизнесе. Подведение суммарных итогов |  |

* 1. **Методические рекомендации и требования к выполнению заданий:**

Методической основой выполнения всех заданий являются знания и навыки, приобретаемые стулентами в ходе преподавания курса и чтения литературы

* + 1. Выполнение заданий на аудиторных занятиях
		2. Баллы за посещаемость не выставляются. Оценивается только участие в выполнении заданий, предлагаемых на аудиторных занятиях: участие в дискуссии, ответы на вопросы, решение задач, выполнение письменных заданий во время занятия.
		3. Домашние задания
		4. Домашние задания №№1-5 выполняются в малых группах до 3-х участников. Результаты представляются в день контактных часов по ответствующей теме дистанционно по указанной электронной почте преподавателя.
		5. Промежуточная аттестация: Экзамен (презентация и защита подготовленных Отчетов по риск-менеджменту в бизнесе)

Итоговый Отчет по анализу и управлению рисками конкретного проекта основывается на выполненных в течение триместра домашних заданиях. Выполняется в тех же малых группах до 3-х участников. За 3 дня до даты экзамена готовый текст Отчета необходимо разместить на он экон и отправить на электронные адреса преподавателей. В день экзамена участники команд представляют презентации выполненных Отчетов. При определении итоговой оценки баллы, набранные в ходе триместра, суммируются с баллами, заработанными на экзамене.

1. **Ресурсное обеспечение**
	1. **Перечень основной и дополнительной литературы**

**Основная литература:**

1. «Риск-менеджмент инвестиционного проекта» под общей редакцией Грачевой М.В. Второе издание, переработанное и дополненное. Учебник. М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2017. – 663 с.
2. Грачева М.В. «Рабочая тетрадь по анализу и управлению рисками» М.: Экономический факультет МГУ имени М. В. Ломоносова, 2021
3. «Математические и инструментальные методы в современных экономических исследованиях». Коллективная монография под общей редакцией М.В.Грачевой - М.:  Экономический факультет МГУ имени М. В. Ломоносова, 2018
4. Круи М., Галай Д., Марк Р. Основы риск-менеджмента : пер. с англ. / науч. ред. В. Б. Минасян. – М. : Юрайт, 2016
5. Кудрявцев А.А. Интегрированный риск-менеджмент: Учебник. – Москва: ЗАО «Издательство «Экономика», 2010
6. Страхование и управление рисками: Учебник. / Под ред. Г.В. Черновой. - М.: Изд-во Юрайт, 2019

**Дополнительная литература:**

1. Гражданский кодекс Российской Федерации. Часть вторая, Глава 48 «Страхование»
2. ГОСТ Р ИСО 31000-2018. Менеджмент риска. Принципы и руководство
3. ГОСТ Р ИСО/МЭК 31010-2011. Национальный стандарт Российской Федерации. Менеджмент риска. Методы оценки риска
4. Антонов, В.Г. Управление рисками приоритетных инвестиционных проектов. концепция и методология - М.: Русайнс, 2018. - 35 c.
5. Балдин, К.В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия: Учебное пособие - М.: Дашков и К, 2015. - 418 c.
6. Белов, П.Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. частях: Учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры - Люберцы: Юрайт, 2016. - 250 c.
7. Воронцовский, А.В. Управление рисками: Учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры - Юрайт, 2016. - 414 c.
8. Вяткин В.Н., Гамза, В.А., Маевский Ф.В. Риск-менеджмент. - М.: Юрайт, 2017. - 366 с.
9. Кирюшкин, В.Е. Основы риск-менеджмента— М.: Анкил, 2017. — 132 c.
10. Тебекин, А.В. Управление рисками инновационно-инвестиционных проектов - М.: Русайнс, 2018. - 160 c.

**8.2. Перечень лицензионного программного обеспечения**

Пакет программ Microsoft Office

**8.3. Перечень профессиональных баз данных и информационных справочных систем**

Ресурсы институциональной подписки экономического факультета МГУ

**8.4. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (при необходимости)**

1. Портал экономического факультета МГУ([www.on.econ.msu.ru](http://www.on.econ.msu.ru))
2. URL: <https://practicum-group.com/>
3. URL: www.businesskompas.ru — портал «Бизнес-компас». Организация бизнеса, своего дела, бизнес с нуля
4. URL: www.business-plany.ru — портал о бизнес-планировании
5. URL: www.cfin.ru — сайт «Корпоративный менеджмент»
6. URL: www.finman.ru — сайт «Финансовый менеджмент»
7. URL: [www.mind-map.ru](http://www.mind-map.ru)
8. URL: www.probp.ru — сайт «Бизнес-план для практиков»
9. URL: [www.coso.org](http://www.coso.org/Pages/erm.aspx) – сайт Committee of Sponsoring Organizations of the Treadway Commission (COSO)
10. URL: [www.iso.org](http://www.iso.org) – сайт международной ассоциации по стандартизации International Organization for Standardization

**8.5. Описание материально-технической базы**

* мультимедийная аудитория с проектором и компьютером для проведения занятий;
* портал экономического факультета МГУ([www.on.econ.msu.ru](http://www.on.econ.msu.ru));
* доступ студента в институциональную подписку факультета;
* наличие доски для письма маркером.
1. **Язык преподавания:** Русский
2. **Преподаватель (преподаватели):** Грачёва Марина Владимировна, Алешина Алёна Юрьевна, Чуркин Игорь Михайлович, Яценко Борис Николаевич
3. **Разработчики программы:** Грачёва Марина Владимировна, Алешина Алёна Юрьевна, Чуркин Игорь Михайлович