

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ
ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Забайкальский государственный университет»
(ФГБОУ ВО «ЗабГУ»)

Факультет экономики и управления
Кафедра Экономики и бухгалтерского учета

УТВЕРЖДАЮ:

Декан факультета

Факультет экономики и
управления

Лавров Александр Юрьевич

«___» _____ 20____
г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Б1.О.04 Управление рисками инвестиционного проекта
на 216 часа(ов), 6 зачетных(ые) единиц(ы)
для направления подготовки (специальности) 38.04.08 - Финансы и кредит

составлена в соответствии с ФГОС ВО, утвержденным приказом
Министерства образования и науки Российской Федерации от
«___» _____ 20____ г. №_____

Профиль – Финансы (для набора 2023)
Форма обучения: Очная

1. Организационно-методический раздел

1.1 Цели и задачи дисциплины (модуля)

Цель изучения дисциплины:

формирование знаний о теории риска, специфике оценки управления рисками в реальном секторе экономики, умений по формированию необходимой информации для оценки риска и обоснования управления рисками, навыков владения методами и анализа и управления рисками в реальном секторе экономики.

Задачи изучения дисциплины:

☐ раскрыть теоретические и практические основы теории риска; ☐ рассмотреть влияние различных рисков сопровождающих предпринимательскую деятельность в реальном секторе экономики; ☐ изучить методы идентификации и управления рисками, в том числе рисками инвестиционного проекта.

1.2. Место дисциплины (модуля) в структуре ОП

Дисциплина «Управление рисками инвестиционного проекта» входит в Блок 1 базовая часть Дисциплина изучается на 2 курсе в 4 семестре.

1.3. Объем дисциплины (модуля) с указанием трудоемкости всех видов учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины (модуля) составляет 6 зачетных(ые) единиц(ы), 216 часов.

Виды занятий	Семестр 3	Всего часов
Общая трудоемкость		216
Аудиторные занятия, в т.ч.	68	68
Лекционные (ЛК)	34	34
Практические (семинарские) (ПЗ, СЗ)	34	34
Лабораторные (ЛР)	0	0
Самостоятельная работа студентов (СРС)	112	112
Форма промежуточной аттестации в семестре	Экзамен	36
Курсовая работа (курсовой проект) (КР, КП)		

2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Планируемые результаты освоения образовательной программы		Планируемые результаты обучения по дисциплине
Код и наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции, формируемые в рамках дисциплины	Дескрипторы: знания, умения, навыки и (или) опыт деятельности
УК-2	Знать организационные и технологические методы, принципы и инструменты, используемые в проектной работе; методы, критерии и параметры представления, описания и оценки результатов/продуктов проектной деятельности.	Знать: организационные и технологические методы, принципы и инструменты, используемые в проектной работе; методы, критерии и параметры представления, описания и оценки результатов проектной деятельности.
УК-2	Уметь разрабатывать техническое задание проекта, его план-график; составлять, проверять и анализировать проектную документацию; составлять и представлять результаты проекта в виде отчетов, статей, выступлений на конференциях; организовывать и координировать работу участников проекта.	Уметь: разрабатывать техническое задание проекта, его план-график; составлять, проверять и анализировать проектную документацию; составлять и представлять результаты проекта в виде отчетов, статей, выступлений на конференциях; организовывать и координировать работу участников проекта.
УК-2	Владеть навыками эффективной организации и координации этапов реализуемого проекта с целью достижения наилучшего результата при балансировании между объемом работ и ресурсами	Владеть: навыками эффективной организации и координации этапов реализуемого проекта с целью достижения наилучшего результата при балансировании между объемом работ и ресурсами
ОПК-4	Знает принципы и алгоритмы разработки и принятия организационно-управленческих и финансово-экономических решений в профессиональной деятельности.	Знать: принципы и алгоритмы разработки и принятия организационно-управленческих и финансово-экономических решений в сфере управления рисками инвестиционного проекта
ОПК-4	Умеет обосновывать финансово-экономические и организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности.	Уметь: обосновывать финансово-экономические и организационно-управленческие решения в сфере управления рисками инвестиционного проекта
ОПК-4	Владеет навыками	Владеть: навыками

	аргументированного убеждения в поддержку предлагаемых финансово-экономических и организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности.	аргументированного убеждения в поддержку предлагаемых финансово-экономических и организационно-управленческих решений в сфере управления рисками инвестиционного проекта
ПК-2	Знает оптимальные приемы и методы отбора информации для проведения соответствующего анализа.	Знать: базовые и продвинутые приемы и методы отбора информации для проведения анализа риска инвестиционного проекта
ПК-2	Умеет проводить расчет и анализ финансовых показателей в соответствии с поставленными задачами.	Уметь: самостоятельно использовать базовые и продвинутые методы анализа различных источников информации для проведения финансово-экономических расчетов, необходимых в рамках изучения дисциплины
ПК-2	Владеет навыками оценки финансовых показателей и составления прогноза их динамики.	Владеть: навыками навыки использования базовых и продвинутых методов анализа различных источников информации для проведения финансово-экономических расчетов и составления прогноза их динамики необходимых в рамках изучения данной дисциплины

3. Содержание дисциплины

3.1. Разделы дисциплины и виды занятий

3.1 Структура дисциплины для очной формы обучения

Модуль	Номер раздела	Наименование раздела	Темы раздела	Всего часов	Аудиторные занятия			СРС
					ЛК	ПЗ (СЗ)	ЛР	
1	1.1	Неопределенность и риск	Особенности принятия решений в условиях неопределенности	24	0	0	0	24

			будущих результатов Определение риска на основе неопределенных будущих результатов Риски бизнеса в реальном секторе экономики Основные проблемы управления рисками в реальном бизнесе					
	1.2	Факторы риска	Основные разновидности факторов риска Внешние и внутренние факторы риска	26	0	0	0	26
	1.3	Стратегии рискованных решений и основные методы управления рисками	Особенности современной экономики и их влияние на стратегии развития бизнеса Основные стратегии развития бизнеса и управления рисками Основные методы управления рисками	32	2	2	0	28
	1.4	Измерение риска и критерии принятия рискованных решений	Формализация условий ситуации риска Измерение риска Косвенные методы учета риска Критерии оценки рискованных решений	34	2	4	0	28
	1.5	Анализ чувствительности проектов долгосрочных инвестиций	Анализ чувствительности как метод оценки устойчивости инвестиционного проекта Аналитический подход к анализу чувствительности Дискретный анализ чувствительности Метод Монте-Карло	32	2	2	0	28
	1.6	Измерение риска долгосрочных инвестиционн	Основные меры риска долгосрочного инвестиционного проекта Оценка риска	32	2	2	0	28

		ых проектов	долгосрочного инвестиционного проекта на основе дерева событий Оценка риска по методу сценариев будущего развития Использование дерева решений при оценке риска инвестиционных проектов					
Итого				180	8	10	0	162

3.2. Содержание разделов дисциплины

3.2.1. Лекционные занятия, содержание и объем в часах

Модуль	Номер раздела	Тема	Содержание	Трудоемкость (в часах)
1	1.3	Стратегии рискованных решений и основные методы управления рисками	Особенности современной экономики и их влияние на стратегии развития бизнеса Основные стратегии развития бизнеса и управления рисками Основные методы управления рисками	2
	1.4	Измерение риска и критерии принятия рискованных решений	Формализация условий ситуации риска Измерение риска Косвенные методы учета риска Критерии оценки рискованных решений	2
	1.5	Анализ чувствительности проектов долгосрочных инвестиций	Анализ чувствительности как метод оценки устойчивости инвестиционного проекта Аналитический подход к анализу чувствительности Дискретный анализ чувствительности Метод Монте-Карло	2
	1.6	Измерение риска долгосрочных инвестиционных проектов	Основные меры риска долгосрочного инвестиционного проекта Оценка риска долгосрочного инвестиционного проекта на основе дерева событий Оценка риска по методу сценариев будущего развития	2

			Использование дерева решений при оценке риска инвестиционных проектов	
--	--	--	---	--

3.2.2. Практические занятия, содержание и объем в часах

Модуль	Номер раздела	Тема	Содержание	Трудоемкость (в часах)
1	1.3	Стратегии рискованных решений и основные методы управления рисками	Тестирование, доклады : Особенности современной экономики и их влияние на стратегии развития бизнеса Основные стратегии развития бизнеса и управления рисками Основные методы управления рисками	2
	1.4	Измерение риска и критерии принятия рискованных решений	Тестирование, доклады, практическое задание : Формализация условий ситуации риска Измерение риска Косвенные методы учета риска Критерии оценки рискованных решений	4
	1.5	Анализ чувствительности проектов долгосрочных инвестиций	Тестирование, доклады , практическое задание: Анализ чувствительности как метод оценки устойчивости инвестиционного проекта Аналитический подход к анализу чувствительности Дискретный анализ чувствительности Метод Монте-Карло	2
	1.6	Измерение риска долгосрочных инвестиционных проектов	Тестирование, доклады, практическое задание: Основные меры риска долгосрочного инвестиционного проекта Оценка риска долгосрочного инвестиционного проекта на основе дерева событий Оценка риска по методу сценариев будущего развития Использование дерева решений при оценке риска инвестиционных проектов	2

3.2.3. Лабораторные занятия, содержание и объем в часах

Модуль	Номер раздела	Тема	Содержание	Трудоемкость (в часах)

3.3. Содержание материалов, выносимых на самостоятельное изучение

Модуль	Номер раздела	Содержание материалов, выносимого на самостоятельное изучение	Виды самостоятельной деятельности	Трудоемкость (в часах)
1	1.1	Неопределенность и риск	Работа с рекомендованной учебной и научной литературой; поиск информации в Интернете по заданной теме;	24
	1.2	Факторы риска	Работа с рекомендованной учебной и научной литературой; поиск информации в Интернете по заданной теме;	26
	1.3	Стратегии рискованных решений и основные методы управления рисками	Работа с рекомендованной учебной и научной литературой; поиск информации в Интернете по заданной теме;	28
	1.4	Измерение риска и критерии принятия рискованных решений	Работа с рекомендованной учебной и научной литературой; поиск информации в Интернете по заданной теме;	28
	1.5	Анализ чувствительности проектов долгосрочных инвестиций	Работа с учебной и научной литературой; поиск информации в Интернете по заданной теме;	28
	1.6	Измерение риска долгосрочных инвестиционных проектов	Работа с рекомендованной учебной и научной литературой; поиск информации в Интернете по заданной теме;	28

4. Фонд оценочных средств для проведения текущей и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

Фонд оценочных средств текущего контроля и промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины представлен в приложении.

5. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

5.1. Основная литература

5.1.1. Печатные издания

1. 1. Предпринимательство и предпринимательские риски : учеб. пособие / Е. А. Малышев, Т. Е. Малышева, Т. И. Кашурникова. - Чита : ЗабГУ, 2015. - 237 с.: ил. - ISBN 978-5-9293-1199-4: 237-00.

5.1.2. Издания из ЭБС

1. 1. Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 485 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12206-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/469401> 2. Шкурко, В. Е. Управление рисками проекта : учебное пособие для вузов / В. Е. Шкурко ; под научной редакцией А. В. Гребенкина. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 182 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-05843-7. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/473824>

5.2. Дополнительная литература

5.2.1. Печатные издания

1. 1. Финансовая среда предпринимательства : учеб. пособие / Виноходова Анна Федоровна, Дмитрик Елена Георгиевна. - Старый Оскол : ТНТ, 2009. - 288 с. - ISBN 978-5-94178-119-5: 285-00.

5.2.2. Издания из ЭБС

1. 1. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент: учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2021. — 365 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-3502-8. — Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/469020> 2. Основы риск-менеджмента / М. Кроуи, Д. Гэлаи, В. Б. Минасян, Р. Марк. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 390 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02578-1. — Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/468418>

5.3. Базы данных, информационно-справочные и поисковые системы

Название	Ссылка
Центр раскрытия корпоративной информации	https://www.e-disclosure.ru/#

6. Перечень программного обеспечения

Программное обеспечение общего назначения: ОС Microsoft Windows, Microsoft Office, ABBYY FineReader, ESET NOD32 Smart Security Business Edition, Foxit Reader, АИБС "МегаПро".

Программное обеспечение специального назначения:

- 1) Google Chrome
- 2) Система ГАРАНТ
- 3) СПС "Консультант Плюс"

7. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Наименование помещений для проведения учебных занятий и для самостоятельной работы обучающихся	Оснащенность специальных помещений и помещений для самостоятельной работы
Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Состав оборудования и технических средств обучения указан в паспорте аудитории, закрепленной расписанием по факультету
Учебные аудитории для проведения практических занятий	
Учебные аудитории для промежуточной аттестации	
Учебные аудитории для текущей аттестации	Состав оборудования и технических средств обучения указан в паспорте аудитории, закрепленной расписанием по кафедре

8. Методические рекомендации по организации изучения дисциплины

https://www.zabgu.ru/files/html_document/pdf_files/fixed/Normativny'e_dokumenty'/MI__01-02-2018_Obshhie_trebovaniya_k_postroeniyu_i_oformleniyu_uchebnoj_tekstovoj_dokumentacii.pdf

Разработчик/группа разработчиков:
Жаргал Баировна Тумунбаярова

Типовая программа утверждена

Согласована с выпускающей кафедрой
Заведующий кафедрой

_____ «___» _____ 20__ г.