

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  
на 216 часа(ов), 6 зачетных(ые) единиц(ы)  
для направления подготовки (специальности) 38.04.01 - Экономика

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

Профиль – Экономика организации (для набора 2022)  
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 предпринима-тельской деятельность в реальном секторе экономики; ☐ изучить методы идентификации и управления рисками;

## 1.2. Место дисциплины (модуля) в структуре ОП

Дисциплина «Управление рисками» входит в Блок 1 базовая часть Дисциплина изучается на 2 курсе в 3 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)	148	148
Форма промежуточной аттестации в семестре	Экзамен	0
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
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 организации
ОПК-4	Умеет обосновывать финансово-экономические и организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности.	Уметь: обосновать финансово-экономические и организационно-управленческие решения в сфере управления рисками организации
ОПК-4	Владеет навыками аргументированного убеждения в поддержку предлагаемых финансово-экономических и организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности.	Владеть: навыками аргументированного убеждения в поддержку предлагаемых финансово-экономических и организационно-управленческих решений в сфере управления рисками
ОПК-5	Обладает знаниями о современных технологиях и программных средствах при решении профессиональных задач.	Знать: современные технологии и программные средства, используемые при оценке и обосновании управления рисками
ОПК-5	Умеет использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач.	Уметь: пользоваться современными информационными технологиями и программными средствами, используемые при оценке и обосновании управления рисками
ОПК-5	Владеет навыками использования современных информационных технологий и программных средств при решении профессиональных задач.	Владеть: навыками использования современными информационными технологиями и программными средствами, которые используются при оценке и обосновании управления рисками

ПК-1	Знает аналитический и методический инструментарий планирования и интегрированной системы управления рисками в соответствии со стратегическими целями организации	Знать: аналитический и методический инструментарий управления рисками в соответствии со стратегическими целями организации
ПК-1	Умеет использовать аналитические материалы по оценке эффективности осуществления экономической деятельности различных организаций	Уметь: использовать аналитические материалы для оценки эффективности управления рисками
ПК-1	Использует в своей работе современные модели экономического планирования, а также владеет навыками применения различных подходов к оценке экономической политики организации.	Владеть: современными моделями оценки эффективности управления рисками

### 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			С Р С
					Л К	П З (С З)	Л Р	
1	1.1	Неопределенность и риск	Особенности принятия решений в условиях неопределенности будущих результатов Определение риска на основе неопределенных будущих результатов Риски бизнеса в реальном секторе экономики Основные проблемы управления рисками в реальном бизнесе	26	4	4	0	18
	1.2	Факторы	Основные	30	6	6	0	18

		риска	разновидности факторов риска Внешние и внутренние факторы риска					
	1.3	Стратегии рисковых 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	30	6	6	0	18
	1.4	Измерение риска и критерии принятия рисковых решений	Формализация условий ситуации риска Измерение риска Косвенные методы учета риска Критерии оценки рисковых решений	30	6	6	0	18
	1.5	Анализ чувств ительности проектов долгосрочных инвестиций	Анализ чувствительности как метод оценки устойчивости инвестиционного проекта Аналитический подход к анализу чувствительности Дискретный анализ чувствительности Метод Монте-Карло	32	6	6	0	20
	1.6	Измерение риска долгосрочных инвестиционн ых проектов	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	32	6	6	0	20

Итого	180	34	34	0	112
-------	-----	----	----	---	-----

### 3.2. Содержание разделов дисциплины

#### 3.2.1. Лекционные занятия, содержание и объем в часах

Модуль	Номер раздела	Тема	Содержание	Трудоемкость (в часах)
1	1.1	Неопределенность и риск	Особенности принятия решений в условиях неопределенности будущих результатов Определение риска на основе неопределенных будущих результатов Риски бизнеса в реальном секторе экономики Основные проблемы управления рисками в реальном бизнесе	4
	1.2	Факторы риска	Основные разновидности факторов риска Внешние и внутренние факторы риска	6
	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	6
	1.4	Измерение риска и критерии принятия рискованных решений	Формализация условий ситуации риска Измерение риска Косвенные методы учета риска Критерии оценки рискованных решений	6
	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	6
	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	6

			методу сценариев будущего развития 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	1.1	Неопределенность и риск	Тестирование, доклады: Особенности принятия решений в условиях неопределенности будущих результатов Определение риска на основе неопределенных будущих результатов Риски бизнеса в реальном секторе экономики Основные проблемы управления рисками в реальном бизнесе	4
	1.2	Факторы риска	Тестирование, доклады: Основные разновидности факторов риска Внешние и внутренние факторы риска	6
	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	6
	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	6
	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	6
	1.6	Измерение	Тестирование, доклады ,	6

		риска долгосрочных инвестиционных проектов	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	
--	--	--	--	--

### 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;	18
	1.2	Факторы риска	Работа с рекомендованной учебной и научной литературой; поиск информации в Интернете по заданной теме;	18
	1.3	Стратегии рискованных решений и основные методы управления рисками	Работа с рекомендованной учебной и научной литературой; поиск информации в Интернете по заданной теме;	18
	1.4	Измерение риска и критерии принятия рискованных решений	Работа с рекомендованной учебной и научной литературой; поиск информации в Интернете по заданной теме;	18
	1.5	Анализ чувствительности	Работа с учебной и	20

		проектов долгосрочных инвестиций	научной литературой; поиск информации в Интернете по заданной теме;	
	1.6	Измерение риска долгосрочных инвестиционных проектов	Работа с рекомендованной учебной и научной литературой; поиск информации в Интернете по заданной теме;	20

#### **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.

[Фонд оценочных средств](#)

#### **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 // Образова-тельная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/469401>

##### **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	<a href="https://www.e-disclosure.ru/">https://www.e-disclosure.ru/</a>

## 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) Foxit Reader
- 2) Google Chrome
- 3) Система ГАРАНТ
- 4) 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](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.