

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 2022)  
Форма обучения: Заочная

# 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 4	Всего часов
Общая трудоемкость		216
Аудиторные занятия, в т.ч.	18	18
Лекционные (ЛК)	8	8
Практические (семинарские) (ПЗ, СЗ)	10	10
Лабораторные (ЛР)	0	0
Самостоятельная работа студентов (СРС)	162	162
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 заочной 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	<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) 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](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.