

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Владимирский государственный университет
имени Александра Григорьевича и Николая Григорьевича Столетовых»
(ВлГУ)

Институт экономики и менеджмента



УТВЕРЖДАЮ

Директор института

П.Н. Захаров

_____ 2021 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ

направление подготовки/специальность

38.03.05 «Бизнес-информатика»

направленность (профиль) подготовки

«Информационно-аналитическое обеспечение предпринимательской деятельности»

г. Владимир
2021

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Целями освоения дисциплины «Управление рисками» является получение студентами теоретических знаний о рисках и способах управления ими, а также получение практических навыков анализа различных экономических процессов с учетом возможных рисков.

Задачами дисциплины являются:

- овладение теоретическими знаниями в области управления рисками;
- овладение умениями и навыками управления рисками с учетом конкретной ситуации;
- овладение навыками выявления и оценки допустимых границ рискованных решений.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП ВО

Дисциплина «Управление рисками» относится к обязательной части.

3. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с планируемыми результатами освоения ОПОП (компетенциями и индикаторами достижения компетенций)

Формируемые компетенции (код, содержание компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине, в соответствии с индикатором достижения компетенции		Наименование оценочного средства
	Индикатор достижения компетенции (код, содержание индикатора)	Результаты обучения по дисциплине	
ОПК-1. Способен проводить моделирование, анализ и совершенствование бизнес-процессов и информационно-технологической инфраструктуры предприятия в интересах достижения его стратегических целей с использованием современных методов и программного инструментария.	ОПК-1.3 Владеет навыками моделирования, анализа и совершенствования бизнес-процессов и информационно-технологической инфраструктуры предприятия	Знает методы анализа и совершенствования бизнес-процессов с учетом степени риска Умеет анализировать бизнес-процессы с учетом степени риска Владеет навыками совершенствования бизнес-процессов и информационно-технологической инфраструктуры предприятия с учетом риска	Тестовые задания Практико-ориентированные практические задания
УК-2. Способен определять круг задач в рамках поставленной цели и выбирать оптимальные способы их решения, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	УК-2.2. Умеет определять круг задач в рамках избранных видов профессиональной деятельности, планировать собственную деятельность исходя из имеющихся ресурсов; соотносить главное и второстепенное, решать поставленные задачи в рамках избранных видов профессиональной деятельности.	Знает методы управления рисками в рамках избранных видов профессиональной деятельности Умеет планировать собственную деятельность исходя из имеющихся ресурсов с учетом степени риска Владеет навыками решения поставленных задач в рамках избранных видов профессиональной деятельности с учетом степени риска	Тестовые задания Практико-ориентированные практические задания

4. ОБЪЕМ И СТРУКТУРА ДИСЦИПЛИНЫ

Трудоемкость дисциплины составляет
3 зачетные единицы, 108 часов

Тематический план форма обучения – очная

№ п/п	Наименование тем и/или разделов/тем дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Контактная работа обучающихся с педагогическим работником				Самостоятельная работа	Формы текущего контроля успеваемости, форма промежуточной аттестации (по семестрам)
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	в том числе в форме практической подготовки		
1.	Основные понятие управления рисками	5	1-2	4	2		1	2	
2.	Типы рисков	5	3	2	2		1	2	
3.	Принципы управления рисками	5	4	2	2		1	2	
4.	Этапы управления рисками	5	5-6	4	2		1	2	рейтинг-контроль № 1
5.	Стратегии управления рисками	5	7-8	4	2		1	3	
6.	Основные способы анализа и оценки рисков	5	9-10	4	2		1	4	
7.	Показатели оценки риска. Оценка риска инвестиционного проекта.	5	11-12	4	2		1	3	рейтинг-контроль № 2
8.	Основные методы управления рисками и условия их применения	5	13-18	12	4		2	9	рейтинг-контроль № 3
Наличие в дисциплине КПКР		нет							
Итого по дисциплине			108 ч.	36	18			27	Экзамен, 27

СОДЕРЖАНИЕ ЛЕКЦИОННЫХ ЗАНЯТИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Тема 1. Основные понятия управления рисками: понятие риска, неопределенности, функции риска, терминологический аппарат.

Тема 2. Типы рисков: типы рисков по источникам возникновения, по сфере, факторам и методам возникновения, основные виды рисков.

Тема 3. Принципы управления рисками: стандарты основные принципы управления рисками, правила управления рисками.

Тема 4. Этапы управления рисками: основные фазы управления рисками с учетом конкретных условий работы организации.

Тема 5. Стратегии управления рисками: определение стратегии управления рисками, адаптивное динамическое управление рисками.

Тема 6. Основные способы анализа и оценки рисков: идентификация рисков, возникновение риска, способы анализа и оценки рисков

Тема 7. Показатели оценки риска. Оценка риска инвестиционного проекта: вероятность, математическое ожидание, дисперсия.

Тема 8. Основные методы управления рисками и условия их применения: особенности применения различных методов управления рисками, страхование рисков, хеджирование рисков.

СОДЕРЖАНИЕ ПРАКТИЧЕСКИХ ЗАНЯТИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Тема 1. Основные понятия управления рисками:

- понятие риска и неопределенности;
- функции риска.

Тема 2. Типы рисков:

- основные виды рисков.

Тема 3. Принципы управления рисками:

- основные правила и принципы управления рисками .

Тема 4. Этапы управления рисками:

- этапы управления рисками,
- информационное обеспечение управления рисками в различных ситуациях.

Тема 5. Стратегии управления рисками:

- элиминирование рисков
- адаптивное динамическое управление рисками

Тема 6. Основные способы анализа и оценки рисков:

- определение уровня приемлемого риска;
- статистические, экспертные, расчетно-аналитические и аналоговые способы оценки рисков.

Тема 7. Показатели оценки риска. Оценка риска инвестиционного проекта:

- количественная оценка риска с помощью методов математического моделирования

Тема 8. Основные методы управления рисками и условия их применения:

- превентивные методы управления рисками,
- методы минимизации рисков и их последствий
- неформализованные методы минимизации рисков.

5. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ, ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ИТОГАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ И УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ СТУДЕНТОВ

5.1 ТЕКУЩИЙ КОНТРОЛЬ УСПЕВАЕМОСТИ

Рейтинг-контроль №1

1. Понятие риска и неопределенности
2. Основные функции риска
3. Классификация рисков по источникам возникновения и последствиям
4. Типы рисков в зависимости от сферы, времени, факторов возникновения и видов учета.
5. Коммерческие, финансовые и предпринимательские риски
6. Основные принципы и правила управления рисками
7. Основные задачи системы управления рисками
8. Этапы управления рисками и их характеристика.

Рейтинг-контроль №2

9. Стратегия управления рисками. Основные процедуры элиминирования рисков.
10. Роль информационного обеспечения в процессе управления рисками.
11. Понятие приемлемого риска. Расчет величины приемлемого риска
12. Статистические способы оценки рисков
13. Экспертные способы оценки рисков
14. Расчетно-аналитические способы оценки рисков
15. Аналоговые способы оценки рисков
16. Классификация рисков. Категории методов классификации рисков

Рейтинг-контроль №3

17. Количественная оценка рисков с помощью методов математической статистики
18. Оценка риска инвестиционного проекта
19. Диверсификация рисков
20. Лимитирование рисков
21. Самострахование рисков
22. Хеджирование рисков
23. Характерные особенности применения различных методов управления рисками
24. Понятие страхования рисков

5.2 ПРОМЕЖУТОЧНАЯ АТТЕСТАЦИЯ

Вопросы к экзамену

1. Понятие риска и неопределенности
 2. История развития дисциплины управление рисками
 3. Основные функции риска
 4. Классификация рисков по источникам возникновения и последствиям
 5. Типы рисков в зависимости от сферы, времени, факторов возникновения и видов учета.
 6. Коммерческие, финансовые и предпринимательские риски
 7. Основные принципы и правила управления рисками
 8. Правила принятия решения в ситуации риска
 9. Основные задачи системы управления рисками
 10. Этапы управления рисками и их характеристика.
- Методологические основы управления рисками как компонент подсистемы разработки и реализации разработки решений
11. Стратегия управления рисками. Основные процедуры элиминирования рисков.
 12. Роль информационного обеспечения в процессе управления рисками.
 13. Понятие приемлемого риска. Расчет величины приемлемого риска

14. Статистические способы оценки рисков
15. Экспертные способы оценки рисков
16. Расчетно-аналитические способы оценки рисков
17. Аналоговые способы оценки рисков
18. Классификация рисков. Категории методов классификации рисков
19. Методологические основы управления рисками как компонент подсистемы разработки и реализации разработки решений
20. Практические аспекты применения различных стратегий управления рисками
21. Количественная оценка рисков с помощью методов математической статистики
22. Оценка риска инвестиционного проекта
23. Диверсификация рисков
24. Лимитирование рисков
25. Самострахование рисков
26. Хеджирование рисков
27. Характерные особенности применения различных методов управления рисками
28. Понятие страхования рисков
29. Анализ рыночных и специфических рисков
- 30 Учет риска при реализации инвестиционного проекта»
- 31 «Оперативное и стратегическое управление рисками»

5.3 САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА ОБУЧАЮЩЕГОСЯ

Тема 1. Основные понятия управления рисками

- изучение литературы по указанной тематике;
- подготовка докладов на тему «История развития дисциплины управление рисками»

Тема 2. Типы рисков:

- изучение литературы по указанной тематике.
- подготовка к дискуссии на тему: «Роль различных типов риска в современных экономических условиях»

Тема 3. Принципы управления рисками:

- изучение литературы по указанной тематике.
- подготовка докладов на тему «Правила принятия решения в ситуации риска»

Тема 4. Этапы управления рисками

- изучение литературы по указанной тематике.
- подготовка к дискуссии на тему «Методологические основы управления рисками как компонент подсистемы разработки и реализации разработки решений»

Тема 5. Стратегии управления рисками

- изучение литературы по указанной тематике
- подготовка докладов на тему «Практические аспекты применения различных стратегий управления рисками»

Тема 6. Основные способы анализа и оценки рисков

- изучение литературы по указанной тематике
- подготовка докладов на тему «Анализ рыночных и специфических рисков»

Тема 7. Показатели оценки риска. Оценка риска инвестиционного проекта

- изучение литературы по указанной тематике
- подготовка докладов на тему «Учет риска при реализации инвестиционного проекта»

Тема 8. Основные методы управления рисками и условия их применения

- изучение литературы по указанной тематике
- докладов на тему «Оперативное и стратегическое управление рисками»

Фонд оценочных материалов (ФОМ) для проведения аттестации уровня сформированности компетенций обучающихся по дисциплине оформляется отдельным документом.

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

6.1. КНИГООБЕСПЕЧЕННОСТЬ

Наименование литературы: (автор, название, вид издания, город, издательство)	Год издания	КНИГООБЕСПЕЧЕННОСТЬ
		Наличие в электронной библиотеке (электронный адрес)
1	2	3
Основная литература		
Управление рисками организации : учебник / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. — Москва : ИНФРА-М, 2020. — 153 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). — DOI 10.12737/textbook_593a609d7f16e7.14110373.	2020	https://znanium.com/read?id=346774
Анализ и управление рисками организации : учебное пособие / Н.А. Рыхтикова. — 3-е изд. — Москва : ИНФРА-М, 2021. — 248 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). — DOI 10.12737/textbook_597f03f1c44465.44914120.	2021	https://znanium.com/read?id=378039
Риск-менеджмент: Учебник для бакалавров / А. Н. Фомичев. — 7-е изд. — М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К ^о », 2020. — 372 с.	2020	https://znanium.com/read?id=358119
Дополнительная литература		
Теоретико-методологические подходы риск-менеджмента : монография / Н.В. Капустина. — М. : ИНФРА-М, 2020. — 140 с. — (Научная мысль). — www.dx.doi.org/10.12737/13054 .	2020	https://znanium.com/read?id=344436
Теоретико-методологические подходы риск-менеджмента : монография / Н.В. Капустина. — М. : ИНФРА-М, 2020. — 140 с. — (Научная мысль). — www.dx.doi.org/10.12737/13054 .	2020	https://znanium.com/read?id=344436
Ряховская А. Н., Крюкова О. Г., Кузнецова М. О. Рискменеджмент — основа устойчивости бизнеса : учеб. пособие / А. Н. Ряховская, О. Г. Крюкова, М. О. Кузнецова; под ред. О. Г. Крюковой. — М. : Магистр : ИНФРАМ, 2019. — 256 с.	2019	https://znanium.com/read?id=339596

**ЛИСТ ПЕРЕУТВЕРЖДЕНИЯ
РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ**

Рабочая программа одобрена на 20____/20____ учебный год

Протокол заседания кафедры № ____ от « ____ » _____ 20 ____ года

Заведующий кафедрой _____ / _____ /

Рабочая программа одобрена на 20____/20____ учебный год

Протокол заседания кафедры № ____ от « ____ » _____ 20 ____ года

Заведующий кафедрой _____ / _____ /

Рабочая программа одобрена на 20____/20____ учебный год

Протокол заседания кафедры № ____ от « ____ » _____ 20 ____ года

Заведующий кафедрой _____ / _____ /

Рабочая программа одобрена на 20____/20____ учебный год

Протокол заседания кафедры № ____ от « ____ » _____ 20 ____ года

Заведующий кафедрой _____ / _____ /