

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  
**38.05.01 «Экономическая безопасность»**

направленность (профиль) подготовки  
**«Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности»**

г. Владимир  
2021

## 1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Целями освоения дисциплины «Управление рисками» является получение студентами теоретических знаний о рисках и способах управления или, 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 части, формируемой участниками образовательных отношений.

## 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	
УК-2. Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	УК-2.3. Владеет навыками разработки проектов в избранной профессиональной сфере, методами оценки эффективности проекта.	Знает методы оценки рисков в избранной профессиональной сфере; Умеет разрабатывать проекты в условиях различной степени риска; Владеет навыками разработки проектов в выбранной профессиональной сфере с учетом степени риска	Тестовые задания Практикоориентированные практические задания
ПК-1. Способен разрабатывать, внедрять интегрированную систему управления рисками и повышать ее эффективность на основе совместных предложений участников процесса и замотивированных сотрудников подразделений	ПК-1.1. Знает национальные и международные стандарты, лучшие практики по построению систем управления рисками	Знает национальные и международные стандарты в области управления рисками Умеет применять стандарты в области управления рисками в избранной профессиональной сфере	Тестовые задания Практикоориентированные практические задания

		Владеет лучшими практиками по построению систем управления рисками	
	ПК-1.2. Умеет разрабатывать программы по совершенствованию процедур управления рисками на основе совместных предложений участников процесса	Знает методы разработки программ по управлению рисками Умеет разрабатывать программы по совершенствованию процедур управления рисками в условиях командной работы Владеет методами управления рисками на основе совместных предложений участников процесса	Тестовые задания Практикоориентированные практические задания
ПК-2. Способен представлять аналитическую информацию о рисках для планирования, координирования и нормативного обеспечения интегрированной комплексной деятельности подразделений в соответствии с принятой стратегией	ПК-2.2. Умеет вырабатывать рекомендации по принятию решений в сфере управления рисками в рамках подразделения	Знает основные приемы управления рисками Умеет применять приемы управления рисками в рамках подразделения Владеет навыками разработки рекомендации по принятию решений в рамках подразделения по управлению рисками	Тестовые задания Практикоориентированные практические задания
ПК-3. Способен обеспечивать стабильное функционирование интегрированной системы управления рисками для поддержания экономической безопасности, принимать оптимальные организационноуправленческие решения по нейтрализации рисков и угроз	ПК-3.2. Умеет анализировать информацию по рискам для поддержания экономической безопасности	Знает приемы анализа информации по рискам Умеет анализировать информацию о влиянии рисков на деятельность системы управления Владеет навыками поддержания	Тестовые задания Практикоориентированные практические задания

		экономической безопасности путем грамотного анализа рисков	
	ПК-3.3. Владеет навыками адаптации и актуализации системы управления рисками под изменения бизнес среды для поддержания оптимального уровня экономической безопасности	Знает приемы адаптации системы управления рисками в различных условиях Умеет управлять бизнеспроцессами в условиях различной степени риска Владеет навыками адаптации и актуализации системы управления рисками в условиях динамичного изменения бизнес среды для поддержания оптимального уровня экономической безопасности	Тестовые задания Практикоориентированные 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		Контактная работа обучающихся с педагогическим работником		Формы текущего контроля успеваемости, форма

			Неделя семестра	Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	в том числе в форме практической подготовки	Самостоятельная работа	промежуточной аттестации (по семестрам)
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 КП\КР		нет							
<b>Итого по дисциплине</b>		<b>108 ч.</b>		<b>36</b>	<b>18</b>			<b>27</b>	<b>Экзамен, 27</b>

## 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
<b>Основная литература</b>		
<p>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.</p>	2020	<a href="https://znanium.com/read?id=346774">https://znanium.com/read?id=346774</a>
<p>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.</p>	2021	<a href="https://znanium.com/read?id=378039">https://znanium.com/read?id=378039</a>
<p>Риск-менеджмент: Учебник для бакалавров / А. Н. Фомичев. — 7-е изд. — М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2020. — 372 с.</p>	2020	<a href="https://znanium.com/read?id=358119">https://znanium.com/read?id=358119</a>
<b>Дополнительная литература:</b>		
<p>Теоретико-методологические подходы рискменеджмента : монография / Н.В. Капустина. — М. : ИНФРА-М, 2020. — 140 с. — (Научная мысль). — <a href="http://www.dx.doi.org/10.12737/13054">www.dx.doi.org/10.12737/13054</a>.</p>	2020	<a href="https://znanium.com/read?id=344436">https://znanium.com/read?id=344436</a>
<p>Теоретико-методологические подходы рискменеджмента : монография / Н.В. Капустина. — М. : ИНФРА-М, 2020. — 140 с. — (Научная мысль). — <a href="http://www.dx.doi.org/10.12737/13054">www.dx.doi.org/10.12737/13054</a>.</p>	2020	<a href="https://znanium.com/read?id=344436">https://znanium.com/read?id=344436</a>
<p>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.</p>	2019	<a href="https://znanium.com/read?id=339596">https://znanium.com/read?id=339596</a>

Базисная система риск-менеджмента организаций реального сектора экономики : монография / Д.В. Соколов, А.В. Барчуков. — М. : ИНФРА-М, 2020. — 125 с. — Научная мысль	2020	<a href="https://znanium.com/read?id=343302">https://znanium.com/read?id=343302</a>
Домашенко Д. В., Финогенова Ю. Ю. Современные подходы к корпоративному риск менеджменту: методы и инструменты / Д. В. Домашенко, Ю. Ю. Финогенова. — М. : Магистр : ИНФРАМ, 2019. — 304 с.	2019	<a href="https://znanium.com/read?id=337083">https://znanium.com/read?id=337083</a>

## 6.2 ПЕРИОДИЧЕСКИЕ ИЗДАНИЯ

1. Журнал «Проблемы анализа риска» (Режим доступа: <https://www.risk-journal.com/jour> )
2. Журнал «Управление финансовыми рисками» (Режим доступа: <https://www.grebennikoff.ru/product/23/> )
3. Журнал «RUSSIAN ECONOMY: FORECASTS AND TRENDS» (Режим доступа: <https://rusecon.hse.ru/> )
4. Журнал «Прогнозы и стратегии» (Режим доступа: <http://www.maib.ru/bookspublication/pis/> )
5. Журнал «Стратегические решения и риск-менеджмент» (Режим доступа: <https://www.jsdrm.ru/jour> )

## 6.3 ИНТЕРНЕТ-РЕСУРСЫ

1. Портал по управлению рисками// <https://upravlenie-riskami.ru/>
2. Портал управления рисками на основе бизнес-процессов // <https://www.1cbitrix.ru/products/cms/projects/11017480/>
3. Портал по управлению рисками для малого и среднего бизнеса // <https://risk-academy.ru>

## 7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Для реализации данной дисциплины имеются специальные помещения для проведения занятий лекционного и практического типов, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, а также помещения для самостоятельной работы.

Перечень используемого лицензионного программного обеспечения: Windows, Microsoft Office.

Компьютерная техника, используемая в учебном процессе, имеет лицензионное программное обеспечение:

- Операционная система семейства Microsoft Windows. □ Пакет офисных программ Microsoft Office.
- Консультант+.

Рабочую программу составил к.э.н., доцент кафедры « Женщины

инноваций и дизайна » С.А. Урачев



Рецензент (представитель работодателя):

ген. директор ООО «ВТГФ» Александр В.А.

подпись

Программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры ЭИиФ

Протокол № 1 от «30» 08 2021 года

Заведующий кафедрой О.А. Доничев  
(ФИО, подпись)

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании учебно-методической комиссии направления.

38.05.01 « Женщины Безопасность »

Протокол № 1 от «30» 08 2021 года

Председатель комиссии О.А. Доничев  
(ФИО, подпись)

**ЛИСТ ПЕРЕУТВЕРЖДЕНИЯ  
РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ**

Рабочая программа одобрена на 20\_\_\_\_ / 20\_\_\_\_ учебный года

Протокол заседания кафедры № \_\_\_\_\_ от \_\_\_\_\_ года

Заведующий кафедрой \_\_\_\_\_

Рабочая программа одобрена на 20\_\_\_\_ / 20\_\_\_\_ учебный года

Протокол заседания кафедры № \_\_\_\_\_ от \_\_\_\_\_ года

Заведующий кафедрой \_\_\_\_\_

Рабочая программа одобрена на 20\_\_\_\_ / 20\_\_\_\_ учебный года

Протокол заседания кафедры № \_\_\_\_\_ от \_\_\_\_\_ года

Заведующий кафедрой \_\_\_\_\_

## ЛИСТ РЕГИСТРАЦИИ ИЗМЕНЕНИЙ

в рабочую программу дисциплины

### УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ

образовательной программы специальности 38.05.01 Экономическая безопасность,  
направленность (профиль) подготовки «Экономико-правовое обеспечение экономической  
безопасности»

Номер изменения	Внесены изменения в части/разделы рабочей программы	Исполнитель ФИО	Основание (номер и дата протокола заседания кафедры)
1			
2			

Заведующий кафедрой \_\_\_\_\_ / \_\_\_\_\_