Министерство науки и высшего образования Российской Федерации

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования
«Сибирский государственный индустриальный университет»

Кафедра менеджмента и отраслевой экономики

УТВЕРЖДАЮ
Директор института экономики и менеджмента
_____ В.В. Шипунова
подпись
«____» _____ 20___ г.

# РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Управление рисками

22.03.02 «Металлургия»
(направленность (профиль): «Экономика и управление на предприятиях в металлургии»)

Квалификация выпускника
Бакалавр

Форма обучения
Очная форма

Срок обучения: 4 года

Год начала подготовки 2024

Новокузнецк
2024

СибГИУ Подлинник электронного документа хранится в системе электронного согласования документов СибГИУ
ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН ЭП
Сертификат: 26ce1a4c63eb34e22ef8995de1a749fe88b45c40
Владелец: Директор ИЭиМ Шипунова Вера Васильевна
Действителен: с 19 апреля 2023 г по 12 июля 2024 г.
Дата и время: 03-06-2024 11:39:25 ПРОВЕРИТЬ ПОДПИСЬ

## 1 Цели и задачи освоения учебной дисциплины

Целями учебной дисциплины являются:

– формирование у обучающихся устойчивых фундаментальных знаний и развитие практических навыков в области управления рисками.

Задачами учебной дисциплины являются:

– раскрыть содержание деятельности по управлению рисками;
– определить цели, задачи и функции риск-менеджмента;
– описать особенности принятия управленческих решений в области управления рисками;
– дать характеристику научного инструментария и методологии, используемых в процессе управления рисками;
– ознакомить с особенностями формирования и функционирования службы риск-менеджмента в организации;
– научить обучающихся понимать причины возникновения рисковых ситуаций, закономерности их развития, выбирать эффективные методы противодействия этому развитию, выполнять оценку степени риска и неопределенности при принятии решений в различных сферах хозяйственной деятельности организации, разрабатывать программу управления рисками.

## 2 Место учебной дисциплины в структуре ООП по направлению подготовки (специальности)

Учебная дисциплина относится к учебным дисциплинам части, формируемой участниками образовательных отношений **Блока 1 «Дисциплины (модули)»** ООП по направлению подготовки (специальности) 22.03.02 «Металлургия».

Учебная дисциплина базируется на предварительном усвоении обучающимися учебных дисциплин:

– Основы интеллектуального труда и управление временем;
– Основы планирования профессиональной деятельности;
– Теория и технология подготовки сырья;
– Теория и технология производства чугуна;
– Теория и технология производства стальной продукции;
– Статистика;
– Основы проектной деятельности;
– Безопасность жизнедеятельности;
– Математика;
– Информационные технологии;
– Обработка металлов давлением;
– Проектный менеджмент;
– Металлургия черных металлов;
– Металлургия цветных металлов;

– Теория металлургических процессов;
– Литейное производство;
– Экономическое обоснование технических решений (по отраслям);
– Экономика и управление организацией;
– Общественный проект;
– Проектная деятельность 1;
– Практика по должности служащего;
– Производственная практика;
– Основы технологического предпринимательства;
– Противодействие коррупции;
– Личные финансы.

Учебная дисциплина дополняет знания и умения, получаемые по одновременно изучаемым и последующим учебным дисциплинам:
– Теория и технология производства прокатной продукции;
– Теория и технология производства проволоки и метизов;
– Эконометрика;
– Организация производства;
– Инвестиционный анализ;
– Анализ производственно-хозяйственной деятельности организации;
– Проектная деятельность 2;
– Преддипломная практика;
– Выполнение и защита выпускной квалификационной работы.

## 3 Планируемые результаты обучения по учебной дисциплине

Процесс изучения учебной дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

**– Профессиональные компетенции**

| Наименование категории (группы) ПК | Код и наименование ПК | Код и наименование индикатора достижения ПК | Планируемые результаты обучения |
|---|---|---|---|
| | ПК-3: Способен осуществлять сбор, мониторинг и обработку данных для проведения расчетов экономических показателей организации | ПК-3.3 Разрабатывает меры по оптимальному использованию материальных, трудовых и финансовых ресурсов организации | – знать: источники возникновения и факторы рисков при использовании материальных, трудовых и финансовых ресурсов организации.<br>– уметь: формулировать меры |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | | по предупреждению или минимизации рисков при использовании материальных, трудовых и финансовых ресурсов организации. |
| | ПК-4: Способен проводить технико-экономический анализ деятельности организации (подразделений организации), определять резервы повышения эффективности деятельности организации (подразделений организации), планировать решения по совершенствованию форм организации труда и управления | ПК-4.1 Выбирает и применяет статистические, экономико-математические методы анализа деятельности организации (подразделений организации) | – знать: методы оценки рисков.<br>– уметь: сравнивать методы оценки рисков. |
| | | ПК-4.3 Выявляет резервы повышения эффективности деятельности организации (подразделений организации) и предлагает организационно-управленческие решения по их использованию | – знать: критерии, применяемые при выработке варианта управленческого решения по воздействию на риски .<br>– уметь: предлагать решения по воздействию на отдельные виды рисков с учетом их результативности и экономической эффективности. |

## 4 Объем и содержание учебной дисциплины

Учебные занятия по учебной дисциплине проводятся в форме контактной работы и в форме самостоятельной работы обучающихся.

Контактная работа включает в себя занятия лекционного типа (лекции), занятия семинарского типа (семинары, практические занятия, практикумы), промежуточную аттестацию обучающихся и иные формы взаимодействия обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации ООП на иных условиях, в том числе при проведении промежуточной аттестации обучающихся. Контактная работа может проводиться с применением электронного обучения, дистанционных образовательных технологий.

### Объем учебной дисциплины

| Семестр / курс | ***ИТОГО*** | ***7 семестр*** | ***8 семестр*** |
|---|---|---|---|

| Форма промежуточной аттестации | | | *экзамен* | *зачет, зачет с оценкой по КР* |
|---|---|---|---|---|
| Трудоёмкость | *академ. час.* | ***252*** | *144* | *108* |
| | *зачетных единиц* | ***7*** | *4* | *3* |
| Лекции, *академ. час.* | | ***16*** | *16* | *0* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* | *0* |
| Лабораторные работы, *академ. час.* | | ***0*** | *0* | *0* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* | *0* |
| Практические занятия, *академ. час.* | | ***60*** | *32* | *28* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* | *0* |
| Курсовая работа, *академ. час.* | | ***36*** | *0* | *36* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* | *0* |
| Консультации, *академ. час.* | | ***0*** | *0* | *0* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* | *0* |
| Самостоятельная работа, *академ. час.* | | ***95*** | *60* | *35* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* | *0* |
| Контроль, *академ. час.* | | ***45*** | *36* | *9* |
| в форме практической подготовки | | ***0*** | *0* | *0* |

## Содержание учебной дисциплины

Раздел 1 Теоретические основы управления рисками;

Тема 1.1 Аксиомы, законы и принципы риск менеджмента (Актуальность изучения управления рисками. Определение риск-менеджмента, ключевые составляющие понятия «риск-менеджмент». Аксиомы риск-менеджмента. Законы управления рисками: общие и специфические. Принципы управления рисками в системе принципов менеджмента.);

Тема 1.2 Понятие и классификация рисков (Риски окружающего мира. Риск и неопределенность: информационный и оценочный подходы к разграничению понятий. Объективное и субъективное понимание риска.

Основные характеристики рисков: экономическая природа, объективность проявления, вероятность возникновения, неопределенность последствий, ожидаемая неблагоприятность последствий, вариабельность уровня, субъективность оценки, наличие анализа, значимость.

Понятие экономического риска. Риски в производственной, финансовой и коммерческой деятельности.

Классификация рисков. Факторы и причины риска);

Тема 1.3 Процесс риск-менеджмента (Обмен информацией и консультирование с внешними и внутренними заинтересованными сторонами по вопросам риск-менеджмента. Определение ситуации (контекста). Оценка риска (идентификация риска, анализ риска,

оценивание риска). Воздействие на риск (выбор вариантов воздействия на риск, подготовка и реализация планов воздействия на ров). иск). Мониторинг и пересмотр (мониторинг и повторная оценка риска). Регистрация процесса риск-менеджмента (ведение документации по результатам реализации процесса риск-менеджмента));

Тема 1.4 Методы оценки риска (Основные методы и приемы оценки риска (краткий обзор, область применения, входные данные, процесс выполнения метода, выход-ные данные, преимущества и недостатки метода). Типы методов оценки рисков (методы наблюдения, вспомогательные методы, функ-циональный анализ, статистические методы). Выбор метода оценки риска для конкретной ситуации. Применимость метода оценки риска. Факторы, влияющие на выбор метода оценки риска);

Раздел 2 2 Управление рисками как сфера профессионального менеджмента;

Тема 2.1 Общая характеристика системы управления рисками (Логика построения системы управления рисками, основные эле-менты этой системы. Свойства системы управления рисками: систем-ный характер управления рисками, сложная структура системы управления рисками, результативность системы управления рисками.
Основные принципы построения системы управления рисками);

Тема 2.2 Управление риском как часть общего менеджмента организации (Управление риском и стратегия организации. Взаимосвязь развития организации и соответствующих вариантов управления рисками.
Управление риском и организационная структура управления компанией.
Аутсорсинг управления риском);

Тема 2.3 Цели и задачи системы управления рисками (Цели системы управления рисками: главные и вспомогательные. Требования к целям управления рисками. Задачи системы управления рисками. Взаимосвязь основных групп задач системы управления рисками);

Тема 2.4 Ограничения системы управления рисками (Внешние ограничения системы управления рисками: законодательные, конъюнктурные и связанные с обязательствами фирмы.
Внутренние ограничения системы управления рисками: институциональные, бюджетные, организационные);

Тема 2.5 Организация управления рисками (Понятие портфеля рисков. Специфика управления портфелем рисков. Два уровня исследования рисков. Управление рисками как динамический процесс. Организационная структура управления рисками. Функции отдела по управлению рисками и риск-менеджера организации. Основные документы, регламентирующие управление рисками на предприятии: «Положение по управлению рисками» и «Руководство по управлению рисками». Их содержание и особенности составления);

Раздел 3 Анализ, оценка и прогнозирование рисков;

Тема 3.1 Учет риска при анализе инвестиционных проектов (Метод корректировки нормы дисконта. Метод корректировки параметров проекта. Метод достоверных эквивалентов. Анализ чувствительности критериев эффективности проекта. Метод сценариев. Анализ вероятностных распределений потоков платежей. Анализ риска проекта с использованием «дерева решений» (или метода предпочтительного состояния). Имитационное моделирование инвестиционных рисков);

Тема 3.2 Анализ рисков при использовании трудовых ресурсов (Построение карты рисков. Диаграмма Исикавы. Статистические методы оценки рисков персонала. Резервы минимизации рисков персонала организации.);

Тема 3.3 Анализ финансовых рисков организации (Статистические методы оценки финансовых рисков. Коэффициентный метод оценки финансовых рисков. Резервы минимизации финансовых рисков организации.).

## 5 Перечень тем лекций

| № раздела / темы дисциплины | Темы лекций | Трудоемкость, *академ.час* | |
|---|---|---|---|
| | | **всего** | **в форме практической подготовки** |
| Тема 1.1. | Аксиомы, законы и принципы риск менеджмента | 2 | |
| Тема 1.2. | Понятие и классификация рисков | 2 | |
| Тема 1.3. | Процесс риск-менеджмента | 2 | |
| Тема 1.4. | Методы оценки риска | 2 | |
| Тема 2.1. | Общая характеристика системы управления рисками | 2 | |
| Тема 2.2. | Управление риском как часть общего менеджмента организации | 2 | |
| Тема 2.3. | Цели и задачи системы управления рисками | 2 | |
| Тема 2.4. | Ограничения системы управления рисками | 2 | |
| **Итого:** | | **16** | **0** |

## 6 Перечень тем практических занятий (семинаров)

| № раздела / темы | Темы практических | Трудоемкость, *академ.час* |
|---|---|---|

| дисциплины | занятий (семинаров) | всего | в форме практической подготовки |
|---|---|---|---|
| Тема 3.1. | Учет риска при анализе инвестиционных проектов | 28 | |
| Тема 3.2. | Оценка рисков персонала | 12 | |
| Тема 3.3. | Оценка финансовых рисков организации | 20 | |
| **Итого:** | | **60** | **0** |

## 7 Перечень тем лабораторных работ

| № раздела / темы дисциплины | Темы лабораторных работ | Трудоемкость, *академ.час* | |
|---|---|---|---|
| | | всего | в форме практической подготовки |
| | *Отсутствуют* | | |
| **Итого:** | | **0** | **0** |

## 8 Перечень тем курсовых работ (проектов)

| № раздела / темы дисциплины | Темы курсовых работ (проектов) | Трудоемкость, *академ.час* | |
|---|---|---|---|
| | | всего | в форме практической подготовки |
| Раздел 1;<br>Раздел 2;<br>Раздел 3. | Анализ рисков предприятия (подразделения предприятия) в условиях _____ (указывается название предприятия / подразделения предприятия) | 36 | |
| **Итого:** | | **36** | **0** |

## 9 Виды самостоятельной работы

| № раздела / темы дисциплины | Виды самостоятельной работы | Трудоемкость, *академ.час* | |
|---|---|---|---|
| | | всего | в форме практической подготовки |
| Раздел 1. | 1. Выполнение домашнего задания;<br>2. Изучение лекционного материала;<br>3. Прохождение тестирования. | 30 | |
| Раздел 2. | 1. Изучение лекционного материала;<br>2. Прохождение тестирования. | 28 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| Раздел 3. | 1. Выполнение домашнего задания;<br>2. Изучение теоретического материала;<br>3. Подготовка к практическому занятию. | 37 | |
| *Курсовая работа* | *Выполнение курсовой работы* | 36 | 0 |
| *Контроль* | *Подготовка к экзамену* | 36 | |
| *Контроль* | *Подготовка к зачёту* | 9 | |
| **Итого:** | | **176** | **0** |

## 10 Учебно-методическое и информационное обеспечение учебной дисциплины

**а) литература:**

1 Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 485 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12206-0. – URL: https://urait.ru/bcode/536576 (дата обращения: 02.06.2024);

2 Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 365 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-3502-8. – URL: https://urait.ru/bcode/536005 (дата обращения: 02.06.2024);

3 Шкурко, В. Е. Управление рисками проекта : учебник для вузов / В. Е. Шкурко ; под научной редакцией А. В. Гребенкина. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 163 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16836-5. – URL: https://urait.ru/bcode/540420 (дата обращения: 02.06.2024);

4 Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 721 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-17939-2. – URL: https://urait.ru/bcode/545113 (дата обращения: 02.06.2024);

5 Шапкин, А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций : учебное пособие / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. — 12-е изд., перераб. — Москва : Дашков и К, 2023. — 538 с. — ISBN 978-5-394-05412-9. – URL: https://e.lanbook.com/book/316010 (дата обращения: 02.06.2024).

**б) ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:**

1 Консультант студента : электронно-библиотечная система / ООО «КОНСУЛЬТАНТ СТУДЕНТА». – Москва, [200 – ]. – URL:

http://www.studentlibrary.ru. – Режим доступа: для авторизир. пользователей;

2 ЛАНЬ : электронно-библиотечная система : [коллекция «Инженерно-технические науки»] / ООО «Издательство ЛАНЬ». – Санкт-Петербург, [200 – ]. – URL: http://e.lanbook.com. – Режим доступа: для авторизир. пользователей;

3 НАУЧНАЯ ЭЛЕКТРОННАЯ БИБЛИОТЕКА eLIBRARY.RU : база данных / ООО «НЭБ». – Москва, [200 – ]. – URL: http://elibrary.ru. – Режим доступа: по подписке;

4 Образовательная платформа ЮРАЙТ / ООО «Электронное издательство ЮРАЙТ». – Москва, [200 – ]. – URL: https://urait.ru. – Режим доступа: для авторизир. пользователей;

5 Университетская библиотека онлайн : электронно-библиотечная система / ООО «Директ-Медиа». – Москва, [200 – ]. – URL: https://biblioclub.ru. – Режим доступа: для авторизир. пользователей. – URL: http://www.biblioclub.ru;

6 Электронная библиотека // Научно-техническая библиотека СибГИУ : сайт. – Новокузнецк, [200 – ]. – URL: http://library.sibsiu.ru/LibrELibraryFullText.asp. – Режим доступа: для авторизир. пользователей. – URL: https://library.sibsiu.ru/LibrELibraryFullText.asp;

7 Электронные периодические издания ИВИС : универсальная база данных / ООО «ИВИС». – Москва, [200 – ]. – URL: http://eivis.ru. – Режим доступа: по подписке;

8 Электронный каталог : сайт / Научно-техническая библиотека СибГИУ. – Новокузнецк, [199 – ]. – URL: http://libr.sibsiu.ru. – URL: https://libr.sibsiu.ru.

**в) лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение:**

– 7-Zip;
– Adobe Acrobat Reader;
– Astra Linux Special Edition;
– Kaspersky Endpoint Security;
– Microsoft Office;
– Microsoft Windows;
– OnlyOffice;
– Бизнес-аналитик;
– Р7-Офис.

**г) базы данных и информационно-справочные системы:**

1 ГАРАНТ : справочно-правовая система / ООО «Правовой центр «Гарант». – Кемерово, [200 – ]. – Режим доступа: компьютерная сеть Сиб. гос. индустр. ун-та.;

2 КонсультантПлюс : справочно-правовая система / ООО «Информационный центр АНВИК». – Новокузнецк, [199 – ]. – Режим доступа: компьютерная сеть библиотеки Сиб. гос. индустр. ун-та.;

3 Техэксперт : информационно-справочная система / ООО «Группа компаний «Кодекс». – Кемерово, [200 – ]. – Режим доступа: компьютерная сеть Сиб. гос. индустр. ун-та.

## 11 Материально-техническое обеспечение учебной дисциплины

Материально-техническое обеспечение учебной дисциплины включает учебные аудитории, оснащенные оборудованием, компьютерной техникой, и техническими средствами обучения, в том числе:
- учебную аудиторию для проведения занятий лекционного типа, оборудованную учебной доской, экраном и мультимедийным проектором;
- учебную аудиторию для проведения занятий семинарского типа (практических занятий);
- учебную аудиторию (помещения) для групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации;
- учебную аудиторию для выполнения курсовых работ;
- помещения для самостоятельной работы, оснащенные компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду, научно-техническую библиотеку СибГИУ.

Рабочая программа дисциплины составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки (специальности) 22.03.02 «Металлургия».

Составитель(и):

заведующий кафедрой Иванова Елена Владимировна (кафедра менеджмента и отраслевой экономики).

Рабочая программа дисциплины рассмотрена и утверждена на заседании кафедры.

**Приложение**

**Аннотация**
**рабочей программы дисциплины «Управление рисками»**

**по направлению подготовки (специальности)**
**22.03.02 «Металлургия»**
**(направленность (профиль): «Экономика и управление на предприятиях в металлургии»)**
**форма обучения – Очная форма**

**1 Цели и задачи освоения учебной дисциплины**

Целями учебной дисциплины являются:

– формирование у обучающихся устойчивых фундаментальных знаний и развитие практических навыков в области управления рисками.

Задачами учебной дисциплины являются:

– раскрыть содержание деятельности по управлению рисками;
– определить цели, задачи и функции риск-менеджмента;
– описать особенности принятия управленческих решений в области управления рисками;
– дать характеристику научного инструментария и методологии, используемых в процессе управления рисками;
– ознакомить с особенностями формирования и функционирования службы риск-менеджмента в организации;
– научить обучающихся понимать причины возникновения рисковых ситуаций, закономерности их развития, выбирать эффективные методы противодействия этому развитию, выполнять оценку степени риска и неопределенности при принятии решений в различных сферах хозяйственной деятельности организации, разрабатывать программу управления рисками.

**2 Место учебной дисциплины в структуре ООП по направлению подготовки (специальности)**

Учебная дисциплина относится к учебным дисциплинам части, формируемой участниками образовательных отношений **Блока 1 «Дисциплины (модули)»** ООП по направлению подготовки (специальности) 22.03.02 «Металлургия».

Учебная дисциплина базируется на предварительном усвоении обучающимися учебных дисциплин:

– Основы интеллектуального труда и управление временем;
– Основы планирования профессиональной деятельности;
– Теория и технология подготовки сырья;
– Теория и технология производства чугуна;
– Теория и технология производства стальной продукции;

– Статистика;
– Основы проектной деятельности;
– Безопасность жизнедеятельности;
– Математика;
– Информационные технологии;
– Обработка металлов давлением;
– Проектный менеджмент;
– Металлургия черных металлов;
– Металлургия цветных металлов;
– Теория металлургических процессов;
– Литейное производство;
– Экономическое обоснование технических решений (по отраслям);
– Экономика и управление организацией;
– Общественный проект;
– Проектная деятельность 1;
– Практика по должности служащего;
– Производственная практика;
– Основы технологического предпринимательства;
– Противодействие коррупции;
– Личные финансы.

Учебная дисциплина дополняет знания и умения, получаемые по одновременно изучаемым и последующим учебным дисциплинам:

– Теория и технология производства прокатной продукции;
– Теория и технология производства проволоки и метизов;
– Эконометрика;
– Организация производства;
– Инвестиционный анализ;
– Анализ производственно-хозяйственной деятельности организации;
– Проектная деятельность 2;
– Преддипломная практика;
– Выполнение и защита выпускной квалификационной работы.

## 3 Планируемые результаты обучения по учебной дисциплине

Процесс изучения учебной дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

### – Профессиональные компетенции

| Наименование категории (группы) ПК | Код и наименование ПК | Код и наименование индикатора достижения ПК | Планируемые результаты обучения |
|---|---|---|---|
| | ПК-3: Способен осуществлять сбор, | ПК-3.3 Разрабатывает меры | – знать: источники возникновения и |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | мониторинг и обработку данных для проведения расчетов экономических показателей организации | по оптимальному использованию материальных, трудовых и финансовых ресурсов организации | факторы рисков при использовании материальных, трудовых и финансовых ресурсов организации.<br>– уметь: формулировать меры по предупреждению или минимизации рисков при использовании материальных, трудовых и финансовых ресурсов организации. |
| | ПК-4: Способен проводить технико-экономический анализ деятельности организации (подразделений организации), определять резервы повышения эффективности деятельности организации (подразделений организации), планировать решения по совершенствованию форм организации труда и управления | ПК-4.1 Выбирает и применяет статистические, экономико-математические методы анализа деятельности организации (подразделений организации) | – знать: методы оценки рисков.<br>– уметь: сравнивать методы оценки рисков. |
| | | ПК-4.3 Выявляет резервы повышения эффективности деятельности организации (подразделений организации) и предлагает организационно-управленческие решения по их использованию | – знать: критерии, применяемые при выработке варианта управленческого решения по воздействию на риски .<br>– уметь: предлагать решения по воздействию на отдельные виды рисков с учетом их результативности и экономической эффективности. |

## 4 Объем учебной дисциплины

| Семестр / курс | | ***ИТОГО*** | ***7 семестр*** | ***8 семестр*** |
|---|---|---|---|---|
| Форма промежуточной аттестации | | | *экзамен* | *зачет, зачет с оценкой по КР* |
| Трудоёмкость | *академ. час.* | ***252*** | *144* | *108* |
| | *зачетных единиц* | ***7*** | *4* | *3* |

| | | | |
|---|---|---|---|
| Лекции, *академ. час.* | ***16*** | *16* | *0* |
| в форме практической подготовки | ***0*** | *0* | *0* |
| Лабораторные работы, *академ. час.* | ***0*** | *0* | *0* |
| в форме практической подготовки | ***0*** | *0* | *0* |
| Практические занятия, *академ. час.* | ***60*** | *32* | *28* |
| в форме практической подготовки | ***0*** | *0* | *0* |
| Курсовая работа, *академ. час.* | ***36*** | *0* | *36* |
| в форме практической подготовки | ***0*** | *0* | *0* |
| Консультации, *академ. час.* | ***0*** | *0* | *0* |
| в форме практической подготовки | ***0*** | *0* | *0* |
| Самостоятельная работа, *академ. час.* | ***95*** | *60* | *35* |
| в форме практической подготовки | ***0*** | *0* | *0* |
| Контроль, *академ. час.* | ***45*** | *36* | *9* |
| в форме практической подготовки | ***0*** | *0* | *0* |

## 5 Краткое содержание учебной дисциплины

В структуре учебной дисциплины выделяются следующие основные разделы (темы):

Раздел 1 Теоретические основы управления рисками;

Тема 1.1 Аксиомы, законы и принципы риск менеджмента (Актуальность изучения управления рисками. Определение риск-менеджмента, ключевые составляющие понятия «риск-менеджмент». Аксиомы риск-менеджмента. Законы управления рисками: общие и специфические. Принципы управления рисками в системе принципов менеджмента.);

Тема 1.2 Понятие и классификация рисков (Риски окружающего мира. Риск и неопределенность: информационный и оценочный подходы к разграничению понятий. Объективное и субъективное понимание риска.

Основные характеристики рисков: экономическая природа, объективность проявления, вероятность возникновения, неопределенность последствий, ожидаемая неблагоприятность последствий, вариабельность уровня, субъективность оценки, наличие анализа, значимость.

Понятие экономического риска. Риски в производственной, финансовой и коммерческой деятельности.

Классификация рисков. Факторы и причины риска);

Тема 1.3 Процесс риск-менеджмента (Обмен информацией и консультирование с внешними и внутренними заинтересованными сторонами по вопросам риск-менеджмента. Определение ситуации (контекста). Оценка риска (идентификация риска, анализ риска, оценивание риска). Воздействие на риск (выбор вариантов воздействия на риск, подготовка и реализация планов воздействия на ров). иск). Мониторинг и пересмотр (мониторинг и повторная оценка риска). Регистрация процесса риск-менеджмента (ведение документации по результатам реализации процесса риск-менеджмента));

Тема 1.4 Методы оценки риска (Основные методы и приемы оценки риска (краткий обзор, область применения, входные данные, процесс выполнения метода, выход-ные данные, преимущества и недостатки метода). Типы методов оценки рисков (методы наблюдения, вспомогательные методы, функ-циональный анализ, статистические методы). Выбор метода оценки риска для конкретной ситуации. Применимость метода оценки риска. Факторы, влияющие на выбор метода оценки риска);

Раздел 2 2 Управление рисками как сфера профессионального менеджмента;

Тема 2.1 Общая характеристика системы управления рисками (Логика построения системы управления рисками, основные эле-менты этой системы. Свойства системы управления рисками: систем-ный характер управления рисками, сложная структура системы управления рисками, результативность системы управления рисками.
Основные принципы построения системы управления рисками);

Тема 2.2 Управление риском как часть общего менеджмента организации (Управление риском и стратегия организации. Взаимосвязь развития организации и соответствующих вариантов управления рисками.
Управление риском и организационная структура управления компанией.
Аутсорсинг управления риском);

Тема 2.3 Цели и задачи системы управления рисками (Цели системы управления рисками: главные и вспомогательные. Требования к целям управления рисками. Задачи системы управления рисками. Взаимосвязь основных групп задач системы управления рисками);

Тема 2.4 Ограничения системы управления рисками (Внешние ограничения системы управления рисками: законодательные, конъюнктурные и связанные с обязательствами фирмы.
Внутренние ограничения системы управления рисками: институциональные, бюджетные, организационные);

Тема 2.5 Организация управления рисками (Понятие портфеля рисков. Специфика управления портфелем рисков. Два уровня исследования рисков. Управление рисками как динамический процесс. Организационная структура управления рисками. Функции отдела по управлению рисками и риск-менеджера организации. Основные документы, регламентирующие управление рисками на предприятии: «Положение по управлению рисками» и «Руководство по управлению рисками». Их содержание и особенности составления);

Раздел 3 Анализ, оценка и прогнозирование рисков;

Тема 3.1 Учет риска при анализе инвестиционных проектов (Метод корректировки нормы дисконта. Метод корректировки параметров проекта. Метод достоверных эквивалентов. Анализ чувствительности критериев эффективности проекта. Метод сценариев.

Анализ вероятностных распределений потоков платежей. Анализ риска проекта с использованием «дерева решений» (или метода предпочтительного состояния). Имитационное моделирование инвестиционных рисков);

Тема 3.2 Анализ рисков при использовании трудовых ресурсов (Построение карты рисков. Диаграмма Исикавы. Статистические методы оценки рисков персонала. Резервы минимизации рисков персонала организации.);

Тема 3.3 Анализ финансовых рисков организации (Статистические методы оценки финансовых рисков. Коэффициентный метод оценки финансовых рисков. Резервы минимизации финансовых рисков организации.).

**6 Составитель(и):**

заведующий кафедрой Иванова Елена Владимировна (кафедра менеджмента и отраслевой экономики).