

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Сыров Игорь Анатольевич
Должность: Директор
Дата подписания: 29.06.2022 14:30:14
Уникальный программный ключ:
b683afe664d7e9f64175886cf9626a196149ad56

СТЕРЛИТАМАКСКИЙ ФИЛИАЛ
ФЕДЕРАЛЬНОГО ГОСУДАРСТВЕННОГО БЮДЖЕТНОГО ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО
УЧРЕЖДЕНИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«БАШКИРСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

Факультет
Кафедра

Экономический
Экономической теории и анализа

Рабочая программа дисциплины (модуля)

дисциплина

Б1.В.03 Теория и методология управления рисками

часть, формируемая участниками образовательных отношений

Направление

38.04.01
код

Экономика
наименование направления

Программа

Экономика бизнеса

Форма обучения

Заочная

Для поступивших на обучение в
2021 г.

Разработчик (составитель)
кандидат экономических наук, доцент
Алтынбаева Л. Е.
ученая степень, должность, ФИО

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с установленными в образовательной программе индикаторами достижения компетенций	3
2. Цели и место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы	4
3. Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах с указанием количества академических или астрономических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся	5
4. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий.....	5
4.1. Разделы дисциплины и трудоемкость по видам учебных занятий (в академических часах).....	5
4.2. Содержание дисциплины, структурированное по разделам (темам)	6
5. Учебно-методическое обеспечение для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю).....	8
6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины (модуля)	8
6.1. Перечень учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)	8
6.2. Перечень электронных библиотечных систем, современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем	9

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с установленными в образовательной программе индикаторами достижения компетенций

Формируемая компетенция (с указанием кода)	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине (модулю)
ПК-3. Способен определять направления развития организации	ПК-3.1. Оценивает текущее состояние организации, для определения направлений ее развития.	иметь базовые знания для успешной работы по определению путей развития организации. Знать основные положения теории и методологии управления рисками. Уметь составлять и обосновывать прогнозы и динамику развития организации. Владеть навыками определения направлений развития организаций.
	ПК-3.2. Определяет параметры развития организации в перспективе	знать способы систематизации и определения направления развития организации. Уметь выбрать научный подход для определения направлений развития организации. Владеть навыками применения различных подходов для определения направлений развития организации.
	ПК-3.3. Выявляет и анализирует несоответствия между параметрами текущего и будущего состояний организации	Знать современные методики, определяющие направления развития организации. Уметь определять направления развития организации, используя основные положения теории и методологии управления рисками Владеть современными методиками и навыками определения направления развития организации, используя основные положения теории и методологии управления рисками
ПК-1. Способен обосновать подходы, используемые в бизнес-анализе	ПК-1.1. Определяет методические подходы к проведению анализа бизнес-процессов.	Знать основные проблемы по теории и методологии управления рисками; методы критического анализа и синтеза информации. Уметь обосновать научные подходы, используемые в бизнес-анализе. Владеть навыками применения

		различных подходов, используемых в бизнес-плане.
	ПК-1.2. Осуществляет выбор подхода к работе с информацией по результатам анализа бизнес-процессов	<p>знать способы систематизации и обобщения результатов научных исследований.</p> <p>Уметь проводить сравнительный анализ современных подходов, используемых в бизнес-анализе и систематизировать полученную информацию.</p> <p>Владеть навыками систематизации и обобщения полученных результатов по теории и методологии управления рисками.</p>
	ПК-1.3. Определяет подходы к работе с заинтересованными сторонами.	<p>знать методику анализа и обобщения результатов научных исследований.</p> <p>Уметь составлять собственные суждения на основе критического подхода к оценке результатов научных исследований.</p> <p>Владеть навыками формулировки выводов по результатам проведенного исследования.</p> <p>Методами анализа и синтеза информации, для решения поставленных задач</p>

2. Цели и место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Цели изучения дисциплины:

формирование у студентов теоретических знаний и практических навыков по использованию теории и методологии управления рисками и применения полученных при этом знаний в своей практической деятельности.

Дисциплина «Теория и методология управления рисками» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений.

Вводные знания, умения и компетенции, необходимые для изучения данного курса основаны на знаниях, полученных в результате изучения курсов: Философия и методология современной науки, Методы научных исследований в экономике

Данную учебную дисциплину дополняет последующее или параллельное освоение следующих дисциплин: Инструментарий моделирования бизнес-процессов, Разработка бизнес-плана, Инструментарий моделирования бизнес-процессов.

Дисциплина изучается на 1, 2 курсах в 2, 3 семестрах

3. Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах с указанием количества академических или астрономических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся

Общая трудоемкость (объем) дисциплины составляет 180 акад. ч.

Объем дисциплины	Всего часов
	Заочная форма обучения
Общая трудоемкость дисциплины	180
Учебных часов на контактную работу с преподавателем:	
лекций	6
практических (семинарских)	8
другие формы контактной работы (ФКР)	1,2
Учебных часов на контроль (включая часы подготовки):	7,8
экзамен	
Учебных часов на самостоятельную работу обучающихся (СР)	157

Формы контроля	Семестры
экзамен	3

4. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий

4.1. Разделы дисциплины и трудоемкость по видам учебных занятий (в академических часах)

№ п/п	Наименование раздела / темы дисциплины	Виды учебных занятий, включая самостоятельную работу обучающихся и трудоемкость (в часах)			
		Контактная работа с преподавателем			СР
		Лек	Пр/Сем	Лаб	
1	Теория управления рисками	4	4	0	105
1.1	Риск как объект управления	2	2	0	35
1.2	Содержание процесса управления рисками	2	0	0	40
1.3	Управление рисками	0	2	0	30
2	Методология управления рисками	2	4	0	52
2.1	Методология оценки рисков	2	2	0	30
2.2	Методы анализа рисков	0	2	0	22
	Итого	6	8	0	157

4.2. Содержание дисциплины, структурированное по разделам (темам)

Курс лекционных занятий

№	Наименование раздела / темы дисциплины	Содержание
1	Теория управления рисками	
1.1	Риск как объект управления	<ol style="list-style-type: none">1. Неопределенность и риск.2. Виды рисков и их структура.3. Опасности.4. Угрозы для деятельности.5. Уязвимость объектов воздействия6. Ущерб.7. Человеческий фактор8. Содержание анализа риска9. Методы оценки риска10. Методы прогноза риска11. Понятие мирового хозяйства и различные подходы к определению его сущности.
1.2	Содержание процесса управления рисками	<ol style="list-style-type: none">1. Этапы процесса управления риском: анализ риска.2. Сбор и обработка данных по аспектам риска, качественный и количественный анализ риска.3. Основные мероприятия политики управления рисками:<ol style="list-style-type: none">1) идентификация отдельных видов риска, присущих отдельным видам хозяйственной деятельности;2) оценка достоверности информации, необходимой для определения уровня рисков;3) выбор соответствующих методов оценки вероятности наступления рисков события по отдельным видам риска;4) определение размера возможных финансовых потерь при наступлении рисков события;5) исследование факторов, влияющих на уровень рисков использования капитала;6) установление предельно допустимого уровня рисков по отдельным хозяйственным операциям и видам хозяйственной деятельности;7) определение направлений нейтрализации негативных последствий отдельных рисков;8) выбор внутренних механизмов нейтрализации негативных последствий отдельных видов риска;9) выбор форм и видов страхования рисков;10) оценка результативности нейтрализации и организации мониторинга
2	Методология управления рисками	
2.1	Методология оценки рисков	<ol style="list-style-type: none">1. Основные критерии оценки экономического риска (последствия и вероятность их наступления) и методологические принципы их измерения2. Виды и методические особенности оценки потерь,

		<p>связанных с экономическим риском</p> <p>3.Сущность и параметры основных зон экономического риска</p> <p>4.Качественная и количественная оценка риска.</p> <p>5.Содержание и методы качественной оценки риска.</p> <p>6.Предлагаемые критерии оценки рисков.</p> <p>7.Методические особенности анализа риска конкретных факторов риска и видов бизнеса.</p>
--	--	---

Курс практических/семинарских занятий

№	Наименование раздела / темы дисциплины	Содержание
1	Теория управления рисками	
1.1	Риск как объект управления	<p>1.Неопределенность и риск.</p> <p>2. Виды рисков и их структура.</p> <p>3. Опасности.</p> <p>4. Угрозы для деятельности.</p> <p>5. Уязвимость объектов воздействия</p> <p>6. Ущерб.</p> <p>7. Человеческий фактор</p> <p>8. Содержание анализа риска</p> <p>9. Методы оценки риска</p> <p>10. Методы прогноза риска</p> <p>11. Понятие мирового хозяйства и различные подходы к определению его сущности.</p>
1.3	Управление рисками	<p>1. Организация управления рисками.</p> <p>2. Принципы принятия решений об управлении рисками.</p> <p>3. Принятие решений о проведении операций в условиях неопределенности</p> <p>4. Предпочтения при принятии решений</p> <p>5. Психологические аспекты принятия решений в рискованных ситуациях.</p> <p>6. Коммуникация риска</p>
2	Методология управления рисками	
2.1	Методология оценки рисков	<p>1.Основные критерии оценки экономического риска (последствия и вероятность их наступления) и методологические принципы их измерения</p> <p>2. Виды и методические особенности оценки потерь, связанных с экономическим риском</p> <p>3.Сущность и параметры основных зон экономического риска</p> <p>4.Качественная и количественная оценка риска.</p> <p>5.Содержание и методы качественной оценки риска.</p> <p>6.Предлагаемые критерии оценки рисков.</p> <p>7.Методические особенности анализа риска конкретных факторов риска и видов бизнеса.</p>
2.2	Методы анализа	<p>1. Методы анализа рисков. Методы анализа рисков.</p>

	рисков	<p>2. Формализация частичной неопределенности и применение теории вероятности в задачах оценки риска.</p> <p>3. Закон нормального распределения; интервальная оценка риска.</p> <p>4. Статистические показатели риска: среднее значение, выборочная средняя, математическое ожидание, стандартное отклонение, дисперсия, доверительный интервал, коэффициент вариации.</p> <p>5. Предельные значения показателей риска</p>
--	--------	--

5. Учебно-методическое обеспечение для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

1.1 Риск как объект управления

Вопросы для самостоятельного рассмотрения:

- 1) Функции объекта и субъекта управления риском.
- 2) Постановка риск-менеджмента в компании и связь с финансовой службой.

Контроль СР: Выборочный опрос студентов по рассмотренным вопросам

1.2 Содержание процесса управления рисками.

Вопросы для самостоятельного рассмотрения:

- 1) Законы управления: общие, частные и специальные.
- 2) Классификация законов управления рисками.

Контроль СР: Выборочный опрос студентов по рассмотренным вопросам

1.3 Управление рисками

Вопросы для самостоятельного рассмотрения:

- 1) Стратегия управления: направления и способы использования средств для достижения поставленной цели.
- 2) Тактика управления: практические методы и приемы управления.

Контроль СР: Выборочный опрос студентов по рассмотренным вопросам

2.1 Методология оценки рисков

Вопросы для самостоятельного рассмотрения:

- 1) Сущность и параметры основных зон экономического
- 2) Методические особенности анализа риска конкретных факторов риска и видов бизнеса.

Контроль СР: Выборочный опрос студентов по рассмотренным вопросам

2.2 Методы анализа рисков

Вопросы для самостоятельного рассмотрения:

- 1) Статистические показатели риска: среднее значение, выборочная средняя, математическое ожидание, стандартное отклонение, дисперсия, доверительный интервал, коэффициент вариации.

Контроль СР: Выборочный опрос студентов по рассмотренным вопросам

6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины (модуля)

6.1. Перечень учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

Основная учебная литература:

1. Черняков, М. К. Управление рисками: конспект лекций : [16+] / М. К. Черняков, М. М. Чернякова ; под ред. М. К. Чернякова ; Новосибирский государственный технический университет. – Новосибирск : Новосибирский государственный технический университет, 2018. – 144 с. : ил., табл. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=574663>(дата обращения: 01.06.2021)
2. Балдин, К. В. Управление рисками : учебное пособие / К. В. Балдин, С. Н. Воробьев. – Москва : Юнити-Дана, 2017. – 511 с. : ил., табл., схем. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=615795> (дата обращения: 01.06.2021)

Дополнительная учебная литература:

1. Каранина, Е. В. Управление рисками: механизмы, инструменты, профессиональные стандарты : [16+] / Е. В. Каранина. – Москва ; Берлин : Директ-Медиа, 2020. – 257 с. : ил., табл., схем. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=576521> (дата обращения: 01.06.2021)
2. Деревяшкин, С. А. Оценка рисков : [16+] / С. А. Деревяшкин ; Поволжский государственный технологический университет. – Йошкар-Ола : Поволжский государственный технологический университет, 2019. – 74 с. : табл., граф., схем., ил. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=570617> (дата обращения: 01.06.2021)

6.2. Перечень электронных библиотечных систем, современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем

№ п/п	Наименование документа с указанием реквизитов
-------	---