

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Сыров Игорь Анатольевич
Должность: Директор
Дата подписания: 30.10.2023 11:55:52
Уникальный программный ключ:
b683afe664d7e9f64175886cf9626a196149ad36

СТЕРЛИТАМАКСКИЙ ФИЛИАЛ
ФЕДЕРАЛЬНОГО ГОСУДАРСТВЕННОГО БЮДЖЕТНОГО ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО
УЧРЕЖДЕНИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«УФИМСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ НАУКИ И ТЕХНОЛОГИЙ»

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

Очно-заочная

Для поступивших на обучение в
2023 г.

Разработчик (составитель)

к.э.н., 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)	5
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
6.3. Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства	10
7. Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)	10

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

		<p>Уметь составлять и обосновывать прогнозы и динамику развития организации.</p> <p>Владеть навыками определения направлений развития организаций.</p>
	ПК-3.2. Определяет параметры развития организации в перспективе	<p>знать способы систематизации и определения направления развития организации.</p> <p>Уметь выбрать научный подход для определения направлений развития организации.</p> <p>Владеть навыками применения различных подходов для определения направлений развития организации.</p>
	ПК-3.3. Выявляет и анализирует несоответствия между параметрами текущего и будущего состояний организации	<p>Знать современные методики, определяющие направления развития организации.</p> <p>Уметь определять направления развития организации, используя основные положения теории и методологии управления рисками</p> <p>Владеть современными методиками и навыками определения направления развития организации, используя основные положения теории и методологии управления рисками</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 2 курсе в 3 семестре

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 5 зач. ед., 180 акад. ч.

Объем дисциплины	Всего часов
	Очно-заочная обучения
Общая трудоемкость дисциплины	180
Учебных часов на контактную работу с преподавателем:	
лекций	10
практических (семинарских)	14
другие формы контактной работы (ФКР)	1,2
Учебных часов на контроль (включая часы подготовки):	34,8
экзамен	
Учебных часов на самостоятельную работу обучающихся (СР)	120

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	8	6	0	68
1.1	Риск как объект управления	4	4	0	18
1.2	Содержание процесса управления рисками	4	0	0	20
1.3	Управление рисками	0	2	0	30
2	Методология управления рисками	2	8	0	52
2.1	Методология оценки рисков	2	4	0	20
2.2	Методы анализа рисков	0	4	0	32
	Итого	10	14	0	120

4.2. Содержание дисциплины, структурированное по разделам (темам)

Курс практических/семинарских занятий

№	Наименование	Содержание
---	--------------	------------

	раздела / темы дисциплины	
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 воздействия 6. Ущерб. 7. Человеческий фактор 8. Содержание анализа риска 9. Методы оценки риска 10. Методы прогноза риска 11. Понятие мирового хозяйства и различные подходы к определению его сущности.
1.3	Управление рисками	<ol style="list-style-type: none"> 1. Организация управления рисками. 2. Принципы принятия решений об управлении рисками. 3. Принятие решений о проведении операций в условиях неопределенности 4. Предпочтения при принятии решений 5. Психологические аспекты принятия решений в рискованных ситуациях. 6. Коммуникация риска
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 измерения 2. Виды и методические особенности оценки потерь, связанных с экономическим риском 3. Сущность и параметры основных зон экономического риска 4. Качественная и количественная оценка риска. 5. Содержание и методы качественной оценки риска. 6. Предлагаемые критерии оценки рисков. 7. Методические особенности анализа риска конкретных факторов риска и видов бизнеса.
2.2	Методы анализа рисков	<ol style="list-style-type: none"> 1. Методы анализа рисков. Методы анализа рисков. 2. Формализация частичной неопределенности и применение теории вероятности в задачах оценки риска. 3. Закон нормального распределения; интервальная оценка риска. 4. Статистические показатели риска: среднее значение, выборочная средняя, математическое ожидание, стандартное отклонение, дисперсия, доверительный интервал, коэффициент вариации. 5. Предельные значения показателей риска

№	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 воздействия 6. Ущерб. 7. Человеческий фактор 8. Содержание анализа риска 9. Методы оценки риска 10. Методы прогноза риска 11. 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 измерения 2. Виды и методические особенности оценки потерь, связанных с экономическим риском 3. Сущность и параметры основных зон экономического риска

		<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>
--	--	---

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. 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: 18.05.2023)

2. 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: 18.05.2023)

Дополнительная учебная литература:

1. 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: 18.05.2023)
2. 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: 18.05.2023)

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

№ п/п	Наименование документа с указанием реквизитов
1	Договор на доступ к ЭБС ZNANIUM.COM между БашГУ в лице директора СФ БашГУ и ООО «Знаниум» № 3/22-эбс от 05.07.2022
2	Договор на доступ к ЭБС «ЭБС ЮРАЙТ» (полная коллекция) между БашГУ в лице директора СФ БашГУ и ООО «Электронное издательство ЮРАЙТ» № 1/22-эбс от 04.03.2022
3	Договор на доступ к ЭБС «Университетская библиотека онлайн» между БашГУ и «Нексмедиа» № 223-950 от 05.09.2022
4	Договор на доступ к ЭБС «Лань» между БашГУ и издательством «Лань» № 223-948 от 05.09.2022
5	Договор на доступ к ЭБС «Лань» между БашГУ и издательством «Лань» № 223-949 от 05.09.2022
6	Соглашение о сотрудничестве между БашГУ и издательством «Лань» № 5 от 05.09.2022
7	ЭБС «ЭБ БашГУ», бессрочный договор между БашГУ и ООО «Открытые библиотечные системы» № 095 от 01.09.2014 г.
8	Договор на БД диссертаций между БашГУ и РГБ № 223-796 от 27.07.2022
9	Договор о подключении к НЭБ и о предоставлении доступа к объектам НЭБ между БашГУ в лице директора СФ БашГУ с ФГБУ «РГБ» № 101/НЭБ/1438-П от 11.06.2019
10	Договор на доступ к ЭБС «ЭБС ЮРАЙТ» (полная коллекция) между УУНиТ в лице директора СФ УУНиТ и ООО «Электронное издательство ЮРАЙТ» № 1/23-эбс от 03.03.2023

Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (далее - сеть «Интернет»)

№ п/п	Адрес (URL)	Описание страницы
1	https://naukaru.ru/ru/nauka/journal/55/view#archie	"Журнал экономических исследований"

6.3. Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства

Наименование программного обеспечения
Windows XP Лицензионное соглашение MSDN. Государственный контракт №9 от 18.03.2008 г. ЗАО «СофтЛайн»
Office Standart 2010 RUS OLP NL Acdmc 200 /Лицензионный договор №04297 от 9.04.2012
Office Standart 2007 Russian OpenLicensePack NoLevel Acdmc 137 / ЗАО «СофтЛайн Трейд». Государственный контракт от 18.03.2008

7. Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)

Тип учебной аудитории	Оснащенность учебной аудитории
Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа, учебная аудитория для проведения практических работ, учебная аудитория для проведения групповых и индивидуальных консультаций, учебная аудитория текущего контроля и промежуточной аттестации.	учебная мебель, доска, мультимедиа-проектор, экран настенный, учебно-наглядные пособия
Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа, учебная аудитория для проведения практических работ, учебная аудитория для проведения групповых и индивидуальных консультаций, учебная аудитория текущего контроля и промежуточной аттестации; аудитория, оборудованная для проведения занятий по информационным технологиям; компьютерный класс с доступом к сети "Интернет" и электронной информационно-образовательной среде СФ УУНиТ. Учебная аудитория курсового проектирования (выполнения курсовых работ)	учебная мебель, доска, мультимедиа-проектор, экран настенный, компьютеры
Читальный зал: помещение для самостоятельной работы	Учебная мебель, учебно-наглядные пособия, компьютеры с доступом к сети «Интернет» и ЭИОС Филиала