

**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ  
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
«ОРЕНБУРГСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АГРАРНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»**

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ  
Б1.В.ДВ.10.02 Управление рисками**

**Направление подготовки 38.03.02 Менеджмент**

**Профиль Производственный менеджмент**

**Квалификация (степень) выпускника бакалавр**

**Форма обучения: заочная**

### **1. Цели освоения дисциплины**

Целями освоения дисциплины «Управление рисками»

- приобретение студентами знаний и умений в области управления рисками.

Задачи дисциплины:

1) изучение теоретических и методологических основ управления рисками;

2) изучение теоретических и практических основ разработки, внедрения и контроля системы управления рисками.

Знания, полученные студентами в процессе освоения данной дисциплины, позволят решать практические задачи, связанные с созданием системы управления рисками на предприятиях и в организациях различных отраслей экономики и форм собственности.

### **2. Место дисциплины в структуре образовательной программы**

Дисциплина «Управление рисками» относится к вариативной части. Требования к предшествующим знаниям представлены в таблице 2.1. Перечень дисциплин, для которых дисциплина «Управление рисками» является основополагающей, представлен в табл. 2.2.

**Таблица 2.1. Требования к пререквизитам дисциплины**

Дисциплина	Раздел
Экономическая теория	1. Введение в экономическую теорию 2. Микроэкономика

**Таблица 2.2. Требования к постреквизитам дисциплины**

Дисциплина	Раздел
Организация предпринимательской деятельности	Раздел 2. Формы и правовые аспекты предпринимательской деятельности Раздел 3. Планирование предпринимательской деятельности Раздел 4. Предпринимательский риск
Управление проектами	Раздел 2. Разработка проекта и управление его предметной областью Раздел 3. Подсистемы управления проектами

### **3. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы**

**Таблица 3.1 – Взаимосвязь планируемых результатов обучения по дисциплине и планиваемых результатов освоения образовательной программы**

Индекс и содержание компетенции	Знания	Умения	Навыки и (или) опыт деятельности
<b>ПК-3</b> владением навыками стратегического анализа, разработки и осуществления стратегии организации, направленной на обеспечение конкурентоспособности	<p>Этап 1: теоретические и практические подходы к определению источников и механизмов обеспечения конкурентного преимущества организации</p> <p>Этап 2: источники финансирования, институты и инструменты финансового рынка</p>	<p>Этап 1: оценивать риски, доходность и эффективность принимаемых финансовых и инвестиционных решений</p> <p>Этап 2: оценивать принимаемые финансовые решения с точки зрения их влияния на создание ценности (стоимости) компаний</p>	<p>Этап 1: методами управления операциями</p> <p>Этап 2: методами анализа финансовой отчетности и финансового прогнозирования</p>
<b>ПК-10</b> владением навыками количественного и качественного анализа информации при принятии управленческих решений, построения экономических, финансовых и организационно-управленческих моделей путем их адаптации к конкретным задачам управления	<p>Этап 1: источники финансирования, институты и инструменты финансового рынка</p> <p>Этап 2: типы организационных структур, их основные параметры и принципы их проектирования; виды управленческих решений и методы их принятия</p>	<p>Этап 1: разрабатывать корпоративные, конкурентные и функциональные стратегии развития организации</p> <p>Этап 2: ставить цели и формулировать задачи, связанные с реализацией профессиональных функций</p>	<p>Этап 1: методами инвестиционного анализа и анализа финансовых рынков</p> <p>Этап 2: методами реализации основных управленческих функций (принятие решений, организация, мотивирование и контроль)</p>

#### 4. Организационно-методические данные дисциплины

Объем дисциплины «Управление рисками» составляет 3 зачетных единицы (108 академических часов), распределение объема дисциплины на контактную работу обучающихся с преподавателем (КР) и на самостоятельную работу обучающихся (СР) по видам учебных занятий и по периодам обучения представлено в таблице 4.1

**Таблица 4.1. Распределение трудоемкости дисциплины  
по видам работ и по семестрам**

№ п/п	Вид учебных занятий	Итого КР	Итого СР	Семестр № 5	
				КР	СР
<b>1</b>	<b>2</b>	<b>3</b>	<b>4</b>	<b>5</b>	<b>6</b>
1	Лекции (Л)	8	-	8	-
2	Лабораторные работы (ЛР)	-	-	-	-
3	Практические занятия (ПЗ)	-	-	-	-
4	Семинары (С)	8	-	8	-
5	Курсовое проектирование (КП)	-	-	-	-
6	Рефераты (Р)	-	-	-	-
7	Эссе (Э)	-	-	-	-
8	Индивидуальные домашние задания (ИДЗ)	-	-	-	-
9	Самостоятельное изучение вопросов (СИВ)	-	90	-	90
10	Подготовка к занятиям (ПкЗ)	-	-	-	-
11	Промежуточная аттестация	2	-	2	-
12	Наименование вида промежуточной аттестации	х	х	зачет	
13	Всего	18	90	18	90

## **5. Структура и содержание дисциплины**

Структура дисциплины представлена в таблице 5.1.

**Таблица 5.1. Структура дисциплины**

№ п/п	Наименования разделов и тем	Семестр	Трудоемкость по видам учебной работы, час.										Коды формируемых компетенций
			лекции	лабораторная работа	практические занятия	семинары	курсовое проектирование	рефераты (эссе)	индивидуальные домашние задания	самостоятельное изучение вопросов	подготовка к занятиям	Промежуточная аттестация	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14
1	<b>Раздел 1 Организационно-методические основы управления рисками</b>	<b>5</b>	<b>2</b>		<b>3</b>					<b>26</b>			ПК-3 ПК-10
1.1	<b>Тема 1</b> Риск как экономическая категория, его сущность и содержание	5	-		1					10			ПК-3 ПК-10
1.2	<b>Тема 2</b> Риск — неизбежный фактор предпринимательской деятельности	5	1		1					8			ПК-3 ПК-10
1.3	<b>Тема 3</b> Классификационные схемы факторов риска в предпринимательской деятельности	5	1		-					8			ПК-3 ПК-10
2	<b>Раздел 2 Методы анализа экономических и управленческих рисков и неопределенности</b>	<b>5</b>	<b>2</b>		<b>2</b>					<b>20</b>			ПК-3 ПК-10
2.1	<b>Тема 4</b> Показатели оценки предпринимательского риска	5	1		1					10			ПК-3 ПК-10
2.2	<b>Тема 5</b> Критерии принятия рискового	5	1		1					10			ПК-3 ПК-10

№ п/п	Наименования разделов и тем	Семестр	Трудоемкость по видам учебной работы, час.										Коды формируемых компетенций
			лекции	лабораторная работа	практические занятия	семинары	курсовое проектирование	рефераты (эссе)	индивидуальные домашние задания	самостоятельное изучение вопросов	подготовка к занятиям	Промежуточная аттестация	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14
	решения в предпринимательской деятельности												
3	<b>Раздел 3 Управление рисками</b>	<b>5</b>	<b>3</b>		<b>3</b>					<b>24</b>			ПК-3 ПК-10
3.1	<b>Тема 6</b> Риск-менеджмент в организации	5	1		1					8			ПК-3 ПК-10
3.2	<b>Тема 7</b> Стратегические основы управления рисками в организации	5	1		1					8			ПК-3 ПК-10
3.3	<b>Тема 8</b> Методы управления риском	5	1		1					8			ПК-3 ПК-10
4	<b>Раздел 4 Прикладные аспекты управления рисками</b>	<b>5</b>	<b>1</b>		<b>1</b>					<b>20</b>			ПК-3 ПК-10
4.1	<b>Тема 9</b> Концептуальные подходы менеджмента риска по обеспечению финансовой устойчивости предприятия	5	1		-					10			ПК-3 ПК-10
4.2	<b>Тема 10</b> Страхование риска	5	-		1					10			ПК-3 ПК-10
5	<b>Контактная работа</b>		8		8							2	
5	<b>Самостоятельная работа</b>									<b>90</b>			
6	<b>Объем дисциплины в семестре</b>	5	8		8					<b>90</b>		2	
7	<b>Всего по дисциплине</b>		8		8					<b>90</b>		2	

## 5.2. Содержание дисциплины

### 5.2.1 – Темы лекций

№ п.п.	Наименование темы лекции	Объем, академические часы
Л-1	Риск — неизбежный фактор предпринимательской деятельности (интерактивная форма)	-
Л-2	Классификационные схемы факторов риска в предпринимательской деятельности (интерактивная форма)	1
Л-3	Показатели оценки предпринимательского риска (интерактивная форма)	1
Л-4	Критерии принятия рискованного решения в предпринимательской деятельности (интерактивная форма)	1
Л-5	Риск-менеджмент в организации (интерактивная форма)	1
Л-6	Стратегические основы управления рисками в организации (интерактивная форма)	1
Л-7	Методы управления риском (интерактивная форма)	1
Л-8	Концептуальные подходы менеджмента риска по обеспечению финансовой устойчивости предприятия (интерактивная форма)	1
Л-9	Страхование риска (интерактивная форма)	1
Итого по дисциплине		8

### 5.2.2 – Темы практических занятий

№ п.п.	Наименование темы практического занятия	Объем, академические часы
ПЗ-1	Риск как экономическая категория, его сущность и содержание	1
ПЗ-2	Риск — неизбежный фактор предпринимательской деятельности	1
ПЗ-3	Показатели оценки предпринимательского риска	1
ПЗ-4	Критерии принятия рискованного решения в предпринимательской деятельности	1
ПЗ-5	Риск-менеджмент в организации	1
ПЗ-6	Стратегические основы управления рисками в организации	1
ПЗ-7	Методы управления риском	1
ПЗ-8	Страхование риска	1
Итого по дисциплине		8

### 5.2.3 – Вопросы для самостоятельного изучения

№ п.п.	Наименования темы	Наименование вопроса	Объем, академические часы
1.	Риск как экономическая категория, его сущность и содержание	1. Понятие и сущность риска. Общие принципы классификации рисков.	2
		2. Экономические риски.	4
		3. Сущность хозяйственного риска.	2

		4. Целевые результаты проявления рискованной деятельности.	2
2	Риск — неизбежный фактор предпринимательской деятельности	1. Основы неоклассической теории рисков.	2
		2. Концепция приемлемого риска.	2
		3. Модель риск-менеджмента.	2
		4. Технология риск-менеджмента.	1
		5. Риск-анализ основных видов экономической деятельности организации.	1
3	Классификационные схемы факторов риска в предпринимательской деятельности	1. Классификационная схема видов риска в деятельности предпринимательских структур.	2
		2. Классификационная схема видов риска в деятельности финансовых учреждений.	4
		3. Классификационная схема видов риска в деятельности участников рынка ценных бумаг	2
4.	Показатели оценки предпринимательского риска	1. Технический анализ рынка ценных бумаг.	5
		2. Общая характеристика информации, необходимой для управления риском	5
5.	Критерии принятия рискованного решения в предпринимательской деятельности	1. Критерии принятия решения в условиях стохастической неопределенности.	2
		2. Критерии принятия решения в условиях нестохастической неопределенности.	4
		3. Эвристические правила принятия рискованного решения.	2
		4. Мониторинг внешней и внутренней среды предприятия.	2
6.	Риск-менеджмент в организации	1. Контроль и отчетность процесса управления рисками.	2
		2. Организация и политика службы управления риском.	3
		3. Концептуальные и стратегические направления снижения риска.	3
7.	Стратегические основы управления рисками в организации	1. Оценка и анализ финансовой устойчивости субъекта хозяйствования в условиях риска.	3
		2. Современные тенденции в выборе стратегии риск-менеджмента.	3

		3. Контроль и ответственность при управлении рисками.	2
8.	Методы управления риском	1. Выбор методов снижения экономического риска.	2
		2. Процедуры разработки, контроля и пересмотра программы управления рисками.	3
		3. Контроль и пересмотр программы управления рисками.	3
9.	Концептуальные подходы менеджмента риска по обеспечению финансовой устойчивости предприятия	1. Уровни "управляемого интереса" в сложном сочетании рискованной деятельности.	2
		2. Модели комплексной балльной оценки риска финансовой несостоятельности предприятия.	2
		3. Модели рейтингового финансового анализа и оценки риска финансовой несостоятельности предприятия.	3
		4. Модели прогнозирования риска финансовой несостоятельности на основе отечественных и зарубежных источников.	3
10	Страхование риска	1. Организационная структура страхования хозяйственных рисков.	2
		2. Сдерживающие факторы при страховании хозяйственных рисков.	2
		3. Оптимальные уровни удержания для самострахования риска	4
		4. Национальные страховые рынки.	2
Итого по дисциплине			90

## 6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

### 6.1 Основная литература, необходимая для освоения дисциплины

- 1 Балдин К.В., Воробьев С.Н. Управление рисками: [Электронный ресурс] Учебное пособие.- М.: Юнити-Дана, 2012.- ЭБС «Книгафонд»
2. Эриашвили Н.Д., Тепман Л.Н. Управление рисками в условиях финансового кризиса: [Электронный ресурс] учебное пособие.- М.: Юнити-Дана, 2012.- ЭБС «Книгафонд»

### 6.2 Дополнительная литература, необходимая для освоения дисциплины

1. Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия: [Электронный ресурс] Учебное пособие.- М.: Дашков и К, 2012.- 420 с. - ЭБС «Лань»
2. Джораев В.О. Практикум по экономической оценке инвестиций: учебное пособие / В.О. Джораев, Е.А. Беякова, Л.А. Добродомова. – Оренбург: Издательский центр ОГАУ, 2010. – 100с.

3. Ляпина С.Ю., Грачева М.В. Управление рисками в инновационной деятельности: [Электронный ресурс] учебное пособие.- М.: Юнити-Дана, 2010. - ЭБС «Книгафонд»
4. Королев В.Ю., Бенинг В.Е., Шоргин С.Я. Математические основы теории риска: [Электронный ресурс] Учебное пособие.- М.: Издательство ФИЗМАТЛИТ, 2011.- ЭБС «Книгафонд»
5. Шапкин А.С., Шапкин В.А. Экономические и финансовые риски: оценка, управление, портфель инвестиций.- М.: Дашков и К, 2012.- 544 с. - ЭБС «Лань»

### **6.3 Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины и другие материалы к занятиям**

- конспект лекций;
- методические указания по выполнению практических заданий.

### **6.4 Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине**

- Электронное учебное пособие включающее:
- методические рекомендации для студентов по самостоятельной работе.

### **6.5 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем**

1. OpenOffice

### **6.6 Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины**

1. ЭБС "КнигаФонд": [www.knigafund.ru/](http://www.knigafund.ru/)
2. ЭБС "Лань": [www.e.lanbook.com/](http://www.e.lanbook.com/)
3. ЭБС "ibooks.ru": [www.ibooks.ru/](http://www.ibooks.ru/)
4. eLIBRARY.RU: [www.elibrary.ru/](http://www.elibrary.ru/)
5. Википедия: <https://ru.wikipedia.org/>

## **7. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине**

Занятия лекционного типа проводятся в аудитории, оборудованной мультимедиапроектором, компьютером, учебной доской.

**Таблица 7.1 – Материально-техническое обеспечение лекций**

Название оборудования	Название технических и электронных средств обучения
Мультимедийное оборудование	Презентация в OpenOffice

Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине представлен в Приложении 1.

Программа разработана в соответствии с федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент, утвержденным приказом Министерства образования и науки РФ от 12 января 2016 г. №7

Разработал: \_\_\_\_\_ Л.А. Добродомова