

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце: Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
ФИО: Игнатенко Виталий Иванович высшего образования
Должность: Проректор по образовательной деятельности и молодежной политике
Дата подписания: 24.06.2025 17:15:54 «Заполярье» государственный университет им. Н.М. Федоровского»
Уникальный программный ключ: (ЗГУ)
a49ae343af5448d45d7e3e1e499659da8109ba78

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по ОД и МП
_____ Игнатенко В.И.

Управление рисками

рабочая программа дисциплины (модуля)

Закреплена за кафедрой **Экономика, менеджмент и организация производства**

Учебный план 38.03.02_бак-очн_МН-2025+.plx
Направление подготовки: Менеджмент

Квалификация **бакалавр**

Форма обучения **очная**

Общая трудоемкость **8 ЗЕТ**

Часов по учебному плану 288
в том числе:
аудиторные занятия 70
самостоятельная работа 155
часов на контроль 63

Виды контроля в семестрах:
зачеты 7
зачеты с оценкой 8

Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр (<Курс>.<Семестра курсе>)	7 (4.1)		8 (4.2)		Итого	
	Неделя		6			
Вид занятий	уп	рп	уп	рп	уп	рп
Лекции	14	14	18	18	32	32
Практические	14	14	24	24	38	38
В том числе инт.	4	4			4	4
Итого ауд.	28	28	42	42	70	70
Контактная работа	28	28	42	42	70	70
Сам. работа	71	71	84	84	155	155
Часы на контроль	9	9	54	54	63	63
Итого	108	108	180	180	288	288

Программу составил(и):

к.э.н Доцент Карпова Е.А _____

Согласовано:

к.э.н. зав.каф.ЭМиОП Н.А. Торгашова _____

Рабочая программа дисциплины

Управление рисками

разработана в соответствии с ФГОС:

Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - бакалавриат по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент (приказ Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 970)

составлена на основании учебного плана:

Направление подготовки: Менеджмент

утвержденного учёным советом вуза от 01.01.2025 протокол № 00-00.

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры

Экономика, менеджмент и организация производства

Протокол от 17.03.2025г. № №7

Срок действия программы: уч.г.

Зав. кафедрой к.э.н., доцент Н.А.Торгашова

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

к.э.н., доцент Н.А.Торгашова __ _____ 2026 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для
исполнения в 2026-2027 учебном году на заседании кафедры
Экономика, менеджмент и организация производства

Протокол от _____ 2026 г. № ____
Зав. кафедрой к.э.н., доцент Н.А.Торгашова

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

к.э.н., доцент Н.А.Торгашова __ _____ 2027 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для
исполнения в 2027-2028 учебном году на заседании кафедры
Экономика, менеджмент и организация производства

Протокол от _____ 2027 г. № ____
Зав. кафедрой к.э.н., доцент Н.А.Торгашова

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

к.э.н., доцент Н.А.Торгашова __ _____ 2028 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для
исполнения в 2028-2029 учебном году на заседании кафедры
Экономика, менеджмент и организация производства

Протокол от _____ 2028 г. № ____
Зав. кафедрой к.э.н., доцент Н.А.Торгашова

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

к.э.н., доцент Н.А.Торгашова __ _____ 2029 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для
исполнения в 2029-2030 учебном году на заседании кафедры
Экономика, менеджмент и организация производства

Протокол от _____ 2029 г. № ____
Зав. кафедрой к.э.н., доцент Н.А.Торгашова

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1	Цели дисциплины:
1.2	• Нахождение и минимизация рисков в различных экономических ситуациях. Обеспечение непрерывности производственного процесса и стабильности деятельности компании, путем ограничения степени воздействия на деятельность компании внешних и внутренних негативных факторов.
1.3	• Расширение и углубление знаний о качественных и количественных свойствах экономических и производственных процессов с учетом риска как характерного фактора современной экономики;
1.4	• Овладение методологией и методикой построения, анализа и использования экономико-математических моделей, которые учитывают риск;
1.5	• Изучение ряда наиболее типовых приемов моделирования и измерения риска в процессе принятия решений, овладение соответствующим аппаратом с целью практического использования при решении разнообразных проблем.
1.6	Задачи дисциплины:
1.7	1. Обеспечение полного контроля над рисками за счет описания и оценки всех рисков компании, эффективной системы мониторинга рисков и своевременного выявления новых рисков.
1.8	2. Внедрение принципов учета рисков при принятии управленческих решений на основе четких процедур выявления и оценки.
1.9	3. Анализ воздействия рисков на ключевые показатели деятельности компании, включая ее стоимость.
1.10	4. Обеспечение прогнозируемости рисков, которым подвержена компания и,
1.11	соответственно, страхование от потерь.
1.12	5. Возможная минимизация рисков и потерь при условии соблюдения экономической целесообразности.
1.13	6. Обеспечение эффективной связи между стремлением компании зарабатывать
1.14	прибыль и стремлением сделать это с минимальными потерями, т.е. обеспе-
1.15	чение оптимального сочетания доходности и риска.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП

Цикл (раздел) ООП:	Б1.В.ДВ.02
2.1	Требования к предварительной подготовке обучающегося:
2.1.1	Выполнение и защита выпускной квалификационной работы
2.1.2	Производственная практика. Технологическая (проектно-технологическая) практика
2.1.3	Учебная (ознакомительная) практика
2.1.4	Выполнение и защита выпускной квалификационной работы
2.1.5	Производственная практика. Технологическая (проектно-технологическая) практика
2.1.6	Учебная (ознакомительная) практика
2.2	Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:
2.2.1	Производственная практика. Технологическая (проектно-технологическая) практика
2.2.2	Выполнение и защита выпускной квалификационной работы
2.2.3	Производственная (преддипломная) практика
2.2.4	Производственная практика. Технологическая (проектно-технологическая) практика
2.2.5	Выполнение и защита выпускной квалификационной работы
2.2.6	Производственная (преддипломная) практика

3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

ПК-2.5: Регулирует процессы производства для устранения последствий в результате произошедших отклонений
Знать:
Уметь:
Владеть:
ПК-2.10: Оценивает потенциальные финансовые риски предприятия
Знать:
Уметь:
Владеть:

УК-10.6: Контролирует экономические и финансовые риски предприятия

Знать:
Уметь:
Владеть:

В результате освоения дисциплины обучающийся должен

3.1	Знать:
3.1.1	основные понятия формирования финансовой политики с учетом рисков.
3.1.2	основные концепции риск-менеджмента, особенности формирования организационных структур.
3.2	Уметь:
3.2.1	составлять расчетные схемы, Уметь: принимать эффективные управленческие решения в условиях неопределенности, экстремальных ситуаций, острой конкурентной борьбы.
3.2.2	классифицировать риски, определять сущность риска.
3.3	Владеть:
3.3.1	основные понятия формирования финансовой политики с учетом рисков.
3.3.2	навыками дополнительного контроля над деятельностью компании и уверенностью в отсутствии излишнего риска при принятии управленческих решений.

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Код занятия	Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр /Курс	Часов	Компетенции	Литература	Инте ракт.	Примечание
	Раздел 1. 5 семестр						
1.1	Понятие и сущность неопределенности риска. Виды рисков инвестирования /Лек/	7	7	ПК-2.10 УК-10.6	Л1.1Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	2	
1.2	Понятие и классификация рисков, меры оценки рисков, анализ рисков /Пр/	7	7	ПК-2.10 УК-10.6	Л1.1Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
1.3	Понятие и классификация рисков, меры оценки рисков, анализ рисков /Ср/	7	31	ПК-2.10 УК-10.6	Л1.1Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
1.4	Понятие и сущность неопределенности риска. Виды рисков инвестирования /Лек/	7	7	ПК-2.10 УК-10.6	Л1.1Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	2	
1.5	Матрица выигрыша, матрица риска, понятие игры с природой, измерение инвестиционных рисков /Пр/	7	7	ПК-2.10 УК-10.6	Л1.1Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
1.6	Матрица выигрыша, матрица риска, понятие игры с природой, измерение инвестиционных рисков /Ср/	7	40	ПК-2.10 УК-10.6	Л1.1Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
1.7	Методы учета факторов риска и неопределенности при оценке эффективности инвестиционных проектов /Лек/	8	8	ПК-2.10 УК-10.6	Л1.1Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
1.8	Оценка рисков в условиях полной неопределенности, критерии Вальда, Сервиджа, Гурвица. Риски при исследовании дерева решений /Пр/	8	8	ПК-2.10 УК-10.6	Л1.1Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
1.9	Оценка рисков в условиях полной неопределенности, критерии Вальда, Сервиджа, Гурвица. Риски при исследовании дерева решений /Ср/	8	28	ПК-2.10 УК-10.6	Л1.1Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
1.10	Многомерные статистические исследования /Лек/	8	5	ПК-2.10 УК-10.6	Л1.1Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0	

1.11	Эконометрика и ее место в ряду математико-статистических экономических дисциплин, регрессионный анализ, сущность задачи факторного анализа, основы компонентного анализа /Пр/	8	8	ПК-2.10 УК-10.6	Л1.1Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
1.12	Эконометрика и ее место в ряду математико-статистических экономических дисциплин, регрессионный анализ, сущность задачи факторного анализа, основы компонентного анализа /Ср/	8	28	ПК-2.10 УК-10.6	Л1.1Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
1.13	Оценка инвестиционных проектов в условиях неопределенности и риска /Лек/	8	5	ПК-2.10 УК-10.6	Л1.1Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
1.14	Классические методы оценки инвестиционных проектов: чистый дисконтированный доход, индекс рентабельности, внутренняя норма доходности, срок окупаемости. Учет вероятности и риска при классических моделях. Учет инфляции при оценке инвестиционных проектов /Пр/	8	8	ПК-2.10 УК-10.6	Л1.1Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
1.15	Классические методы оценки инвестиционных проектов: чистый дисконтированный доход, индекс рентабельности, внутренняя норма доходности, срок окупаемости. Учет вероятности и риска при классических моделях. Учет инфляции при оценке инвестиционных проектов /Ср/	8	28	ПК-2.10 УК-10.6	Л1.1Л1.2Л2.1 Э1 Э2 Э3 Э4	0	

5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

5.1. Контрольные вопросы и задания

1. Вероятностная природа понятия рисков.
2. Измерение рисков.
3. Классификация рисков предпринимательской деятельности.
4. Понятие полной неопределенности рисков.
5. Что такое стратегические игры?
6. Определение матрицы выигрыша при игре двух лиц.
7. как находится матрица риска.
8. Что такое игра с природой?
9. Критерии оценки игр двух лиц.
10. Чем отличаются критерии максиминный, макси-макси и критерий пессимизма-оптимизма?
11. Назовите этапы создания дерева решений.
12. Выбор наиболее эффективного проекта завода различного объема производства.
13. Каковы основные принципы минимизации рисков в управленческой деятельности?
14. Суть теории полезности и денежного эквивалента.
15. На чем базируется эконометрика?
16. В чем заключается роль эконометрики в стратегическом планировании?
17. Математические модели в эконометрике.
18. Регрессионный анализ.
19. Метод главных компонент.
20. Методы теории игр в эконометрике.
21. Математическая теория планирования эксперимента.

5.2. Темы письменных работ

Не предусмотрено курсом

5.3. Фонд оценочных средств

Основное содержание ФОС по управлению рисками
Теоретические основы управления рисками

Понятие риска, виды и классификация рисков (финансовые, операционные, стратегические и др.).

Элементы системы оценки и управления рисками.

Законодательство РФ и международные стандарты в области управления рисками.

Принципы и методы управления рисками, стратегии реагирования.

Процесс управления рисками

Идентификация рисков: методы и источники информации.

Оценка и анализ рисков: количественные и качественные методы, статистический и стохастический подходы.

Разработка мероприятий по снижению и контролю рисков.

Мониторинг и актуализация системы управления рисками.

Оценка эффективности управления рисками и экономическая обоснованность мер.

Практические навыки и компетенции

Анализ и применение методик оценки рисков с учетом отраслевой специфики.

Составление мероприятий и контрольных процедур по управлению рисками.

Выявление недостатков существующих систем и разработка рекомендаций по их совершенствованию.

Прогнозирование и тестирование методик управления рисками.

Мониторинг динамики ключевых рисков и индикаторов.

Тематика контрольных заданий

Тестовые вопросы по теории и практике управления рисками.

Анализ кейсов и ситуационных задач.

Практические задания по расчету и оценке рисков.

Разработка планов управления рисками и мероприятий по их снижению.

Подготовка рефератов, курсовых работ и проектов на тему управления рисками.

Примерные контрольные вопросы

Что такое риск и какие виды рисков выделяются?

Какие этапы включает процесс управления рисками?

Какие методы используются для идентификации и оценки рисков?

Каковы основные стратегии реагирования на риски?

В чем заключается роль мониторинга в системе управления рисками?

Какие законодательные и нормативные документы регулируют управление рисками?

Как оценить эффективность мероприятий по управлению рисками?

Какие современные информационные технологии применяются в управлении рисками?

5.4. Перечень видов оценочных средств

1. Доклад
2. Дискуссия
3. Деловая игра
4. Практические занятия
5. Тестирование

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)				
6.1. Рекомендуемая литература				
6.1.1. Основная литература				
	Авторы, составители	Заглавие, размещение	Издательство, год	Колич-во
Л1.1	Рогов В.А., Чудаков А.Д.	Управление рисками: допущено УМО вузов в качестве учеб. пособия для студентов вузов	Старый Оскол: ТНТ, 2015	10
Л1.2	Новиков А.И., Солодкая Т.И.	Теория принятия решений и управление рисками в финансовой и налоговой сферах: учеб. пособие для бакалавров	М.: Изд.-торг. корпорация "Дашков и К", 2015	10
6.1.2. Дополнительная литература				
	Авторы, составители	Заглавие, размещение	Издательство, год	Колич-во
Л2.1	Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С.	Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия: учеб. пособие для вузов	М.: Изд.-торг. корпорация "Дашков и К", 2015	10
6.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"				
Э1	Электронный каталог НГИИ http://biblionorvuz.ru			
Э2	ЭБС Лань https://e.lanbook.com			
Э3	IPR Book https://www.iprbookshop.ru			
Э4	Онлайн платформа ЗГУ https://learn.norvuz.ru/			
6.3.1 Перечень программного обеспечения				
6.3.1.1	MS Windows 7 (Номер лицензии 62693665 от 19.11.2013)			
6.3.1.2	MS Office Standard 2013 (Номер лицензии 62693665 от 19.11.2013)			
6.3.2 Перечень информационных справочных систем				
6.3.2.1	Электронная библиотека ЗГУ (http://biblio.norvuz.ru/MarcWeb2/Default.asp)			
6.3.2.2	Электронно-библиотечная система Лань (https://e.lanbook.com)			
6.3.2.3	Цифровая библиотека IPRsmart (https://www.iprbookshop.ru)			
6.3.2.4	Зарубежные электронные ресурсы издательства Springer Nature:			
6.3.2.5	Springer Journals (http://link.springer.com)			
6.3.2.6	Nature Journals (https://www.nature.com/siteindex)			
6.3.2.7	Springer Nature Experiments (https://experiments.springernature.com/)			
6.3.2.8	Springer Materials (http://materials.springer.com/)			
6.3.2.9	zbMATH (http://zbmath.org)			
6.3.2.10	Nano Database (https://nano.nature.com/)			
6.3.2.11	Зарубежный электронный ресурс издательства Elsevier:			
6.3.2.12	ScienceDirect (https://www.sciencedirect.com/)			
6.3.2.13	Freedom Collection (https://www.sciencedirect.com/)			
6.3.2.14	Freedom Collection eBook collection (https://www.sciencedirect.com/)			

7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)	
7.1	Аудитория: 422 – мультимедийный класс (проектор в комплекте Panasonic PT-vx51; экран настенный; 1 компьютер (Intel Pentium(R) G630 2.70GHz, 2Гб ОЗУ, HDD 160 Гб) (для преподавателя))
7.2	Аудитория: 424 – компьютерный, мультимедийный класс (моноблок Acer e Machines EZ1711 – 8 комплектов + персональный компьютер LG в комплекте (для преподавателя) (Intel Atom D525 1.80GHz, 2Гб ОЗУ, HDD 160 Гб); мультимедийный проектор Panasonic; экран с электроприводом настенный; интерактивный экран; проектор Epson EB-485Wi широко-угольный ультракороткофо. интерактивный;))

8. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)	
The App created this document is using the Obsolete license. Contact to the Support Team: mailto:support@sautinsoft.com	