

МИНОБРНАУКИ РОССИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования

«Костромской государственный университет»  
(КГУ)

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

**СИСТЕМА УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ**

Направление подготовки/специальность:  
38.03.01 Экономика

Направленность/специализация:  
Экономика бизнеса

Квалификация выпускника: бакалавр

**Кострома  
2021**

Рабочая программа дисциплины «Система управления рисками» разработана в соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования – бакалавриат по направлению подготовки 38.03.01 Экономика (приказ Минобрнауки России от 12 августа 2020 г. №954)

Разработал: Быстрова Ольга Юрьевна доцент кафедры экономики и управления КГУ, к.э.н.

Рецензенты: Осянин И.К., генеральный директор ООО «Ммкиисг»  
Солдатова И.Ю., директор Департамента государственного регулирования цен и тарифов Костромской области

ПРОГРАММА УТВЕРЖДЕНА  
на заседании кафедры экономики и управления  
(протокол от 20 мая 2021 г. № 15)

ПРОГРАММА ПЕРЕУТВЕРЖДЕНА  
на заседании кафедры экономики и управления  
(протокол от \_\_\_\_\_ 202\_\_ г. № \_\_\_\_)

ПРОГРАММА ПЕРЕУТВЕРЖДЕНА  
на заседании кафедры экономики и управления  
(протокол от \_\_\_\_\_ 202\_\_ г. № \_\_\_\_)

ПРОГРАММА ПЕРЕУТВЕРЖДЕНА  
на заседании кафедры экономики и управления  
(протокол от \_\_\_\_\_ 202\_\_ г. № \_\_\_\_)

ПРОГРАММА ПЕРЕУТВЕРЖДЕНА  
на заседании кафедры экономики и управления  
(протокол от \_\_\_\_\_ 202\_\_ г. № \_\_\_\_)

## 1. Цели и задачи освоения дисциплины

**Цель дисциплины** – формирование у студентов системы знаний об основных подходах и методах управления различными видами рисков, об организационных и экономических основах организации исследований на макро, мезо и микро уровнях; дать знания об основных принципах планирования, проведения, оформления результатов исследований и сформировать способности их применять в профессиональной деятельности.

### **Задачи дисциплины:**

- изучение научной методологии риск-менеджмента в экономике;
- формирование умений и навыков применять методы анализа рисков и неопределенностей, способы управления рисками;
- формирование умений и навыков представлять результаты проведенного исследования в виде отчета.

## 2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине

В результате освоения дисциплины обучающийся должен освоить компетенции:

**ПК-2** - Способен проводить анализ, обоснование и выбор решения.

Код и содержание индикаторов компетенции

**ИК.ПК-2.2.** Выявляет, анализирует и классифицирует риски и разрабатывает мероприятия по их минимизации.

### **Знать:**

- основные подходы и методы управления различными видами рисков.

### **Уметь:**

- выявлять, регистрировать, анализировать и классифицировать риски и разрабатывать комплекс мероприятий по их минимизации.

### **Владеть:**

- навыками использования количественных и качественных методов для выявления и управления рисками бизнес-процессов.

**ПК-3** - Способен разрабатывать инвестиционный проект.

Код и содержание индикаторов компетенции

**ИК.ПК-3.4.** Оценивает устойчивость проекта к изменению условий внутренней и внешней среды, риски проекта.

### **Знать:**

- основные факторы риска, методы их количественной оценки в рамках реализации инвестиционного проекта.

### **Уметь:**

- разрабатывать меры по снижению воздействия основных факторов риска на результаты эффективности проекта.

### **Владеть:**

- навыками подготовки стратегических и аналитических материалов для оценки и управления рисками бизнес-процессов.

## 3. Место дисциплины в структуре ОП ВО

Дисциплина относится к формируемой участниками образовательных отношений части учебного плана. Изучается в 7 семестре обучения.

Изучение дисциплины основывается на ранее освоенных дисциплинах/практиках:

- экономика организаций;
- исследование бизнес-среды организации;
- планирование деятельности организации;
- производственная технологическая практика.

Изучение дисциплины является основой для освоения последующих дисциплин/практик: используются при изучении профессиональных дисциплин:

- управление разработкой и реализацией нового продукта
- оценка стоимости бизнеса,

при прохождении преддипломной практики, выполнении выпускной квалификационной работы.

#### 4. Объем дисциплины

##### 4.1. Объем дисциплины в зачетных единицах с указанием академических часов и виды учебной работы

Виды учебной работы,	Очная форма	Очно-заочная	Заочная
Общая трудоемкость в зачетных единицах	4	4	4
Общая трудоемкость в часах	144	144	144
Аудиторные занятия в часах, в том числе:	52	46	18
Лекции	26	22	10
Практические занятия	26	24	8
Лабораторные занятия			
Практическая подготовка	14	14	8
Самостоятельная работа в часах	53,65	59,65	114,65
Форма промежуточной аттестации	Экзамен	Экзамен	Экзамен

##### 4.2. Объем контактной работы на 1 обучающегося

Виды учебных занятий	Очная форма	Очно-заочная	Заочная
Лекции	26	22	10
Практические занятия	26	24	8
Лабораторные занятия			
Консультации	2	2	2
Зачет/зачеты			
Экзамен/экзамены	0,35	0,35	0,35
Курсовые работы			
Курсовые проекты			
Практическая подготовка	14	14	8
<b>Всего</b>	<b>68,35</b>	<b>62,35</b>	<b>28,35</b>

#### 5. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам), с указанием количества часов и видов занятий

##### Очная форма обучения

№	Название раздела, темы	Всего з.е/час	Аудиторные занятия			Самостоятельная работа
			Лекц.	Практ.	Лаб.	
1.	Основы управление рисками, классификация рисков	15,65	6	6		3,65
2.	Риск-менеджмент: понятие, функции, принципы, стратегия, способы управления рисками	22	6	6		10
3.	Методы анализа и	36	8	8		20

	оценки риска. Анализ неопределенности риска					
4.	Управление специфическими видами рисков	32	6	6		20
	Экзамен	36				
	Итого:	-	26	26		53,65

**Очно-заочная форма обучения**

№	Название раздела, темы	Всего з.е/час	Аудиторные занятия			Самостоятельная работа
			Лекц.	Практ.	Лаб.	
1.	Основы управление рисками, классификация рисков	15,65	6	6		3,65
2.	Риск-менеджмент: понятие, функции, принципы, стратегия, способы управления рисками	22	6	6		10
3.	Методы анализа и оценки риска. Анализ неопределенности риска	32	6	6		20
4.	Управление специфическими видами рисков	36	4	6		26
	Экзамен	36				
	Итого:	-	22	24		59,65

**Заочная форма обучения**

№	Название раздела, темы	Всего з.е/час	Аудиторные занятия			Самостоятельная работа
			Лекц.	Практ.	Лаб.	
1.	Основы управление рисками, классификация рисков	28,65	2	2		24,65
2.	Риск-менеджмент: понятие, функции, принципы, стратегия, способы управления рисками	34	2	2		30
3.	Методы анализа и оценки риска. Анализ неопределенности риска	36	4	2		30
4.	Управление	34	2	2		30

	специфическими видами рисков					
	Экзамен	9				
	Итого:	-	10	8		114,65

## 5.2. Содержание:

### 5.3. Практическая подготовка очная форма

Код, направление, направленность	Наименование дисциплины	Количество часов дисциплины, реализуемые в форме практической подготовки								
		Всего	Семестр 7			Семестр ..				
			Лекции	Пр.зан.	Лаб.р.	...	...	...		
Направление подготовки/специальность: 38.03.01 Экономика Направленность/специализация: Экономика бизнеса	Система управления рисками	14		14						
		14		14						

Код компетенции	Индикатор компетенции	Содержание задания на практическую подготовку по выбранному виду деятельности	Число часов практической подготовки			
			Всего Очная форма	Лекции	Практ. занятия	
ПК-2	ИК.ПК-2.2.	1. Классификация рисков	2		2	
		2. Разработка стратегии минимизации рисков	2		2	
		3. Разработка системы тактических приемов минимизации рисков	2		2	
ПК-3	ИК.ПК-3.4.	1. Количественная оценка рисков 2. Подготовка аналитической документации по рисками бизнес-процессов	4		4	
			4		4	

### 5.3. Практическая подготовка очно-заочная форма

Код, направление, направленность	Наименование дисциплины	Количество часов дисциплины, реализуемые в форме практической подготовки								
		Всего	Семестр 7			Семестр ..				
			Лекции	Пр.зан.	Лаб.р.	...	...	...		
Направление подготовки/специальность: 38.03.01 Экономика Направленность/специализация: Экономика бизнеса	Система управления рисками	14		14						

		14		14			
--	--	----	--	----	--	--	--

Код компетенции	Индикатор компетенции	Содержание задания на практическую подготовку по выбранному виду деятельности	Число часов практической подготовки			
			Всего Очно- заочная форма	Лекции	Практ. занятия	
ПК-2	ИК.ПК-2.2.	1. Классификация рисков	2		2	
		2. Разработка стратегии минимизации рисков	2		2	
		3. Разработка системы тактических приемов минимизации рисков	2		2	
ПК-3	ИК.ПК-3.4.	1. Количественная оценка рисков	4		4	
		2. Подготовка аналитической документации по рисками бизнес-процессов	4		4	

### 5.3. Практическая подготовка заочная форма

Код, направление, направленность	Наименование дисциплины	Количество часов дисциплины, реализуемые в форме практической подготовки						
		Всего	Семестр 7			Семестр ..		
			Лекции	Пр.зан.	Лаб.р.	...	...	...
Направление подготовки/специальность: 38.03.01 Экономика Направленность/специализация: Экономика бизнеса	Система управления рисками	8		8				
		8		8				

Код компетенции	Индикатор компетенции	Содержание задания на практическую подготовку по выбранному виду деятельности	Число часов практической подготовки			
			Всего заочная форма	Лекции	Практ. занятия	
ПК-2	ИК.ПК-2.2.	3. Классификация рисков	2		2	
		4. Разработка стратегии минимизации рисков	2		2	
		3. Разработка системы тактических приемов минимизации рисков	2		2	
ПК-3	ИК.ПК-3.4.	1. Количественная	2		2	

		оценка рисков			
--	--	---------------	--	--	--

**6. Методические материалы для обучающихся по освоению дисциплины**

**6.1. Самостоятельная работа обучающихся по дисциплине (модулю)**

*Для очной формы обучения.*

№ п/п	Раздел (тема) дисциплины	Задание	Часы	Методические рекомендации по выполнению задания	Форма контроля
1.	Основы управление рисками, классификация рисков	Подготовиться к тематическому контролю Подготовиться к решению кейсов	3,65	Изучить лекции, литературу по проблематике	Тематический контроль
2.	Риск-менеджмент: понятие, функции, принципы, стратегия, способы управления рисками	Подготовиться к решению кейсов	10	Изучить лекции, литературу по проблематике	Решение кейсов Проблемная дискуссия,
3	Методы анализа и оценки риска. Анализ неопределенности риска	Подготовиться к решению задач	20	Изучить лекции, литературу по проблематике	Решение задач
4	Управление специфическим и видами рисков	Подготовиться к решению кейсов Индивидуальное задание	20	Изучить лекции, литературу по проблематике	Проблемная дискуссия, Решение кейсов Индивидуальное задание
	Итого		53,65		

*Для очно-заочной формы обучения.*

№ п/п	Раздел (тема) дисциплины	Задание	Часы	Методические рекомендации по выполнению задания	Форма контроля
1.	Основы управление рисками, классификация рисков	Подготовиться к тематическому контролю Подготовиться к решению кейсов	3,65	Изучить лекции, литературу по проблематике	Тематический контроль

2.	Риск-менеджмент: понятие, функции, принципы, стратегия, способы управления рисками	Подготовиться к решению кейсов	10	Изучить лекции, литературу по проблематике	Решение кейсов Проблемная дискуссия,
3	Методы анализа и оценки риска. Анализ неопределенности риска	Подготовиться к решению задач	20	Изучить лекции, литературу по проблематике	Решение задач
4	Управление специфическим и видами рисков	Подготовиться к решению кейсов Индивидуальное задание	26	Изучить лекции, литературу по проблематике	Проблемная дискуссия, Решение кейсов Индивидуальное задание
	Итого		59,65		

*Для заочной формы обучения.*

№ п/п	Раздел (тема) дисциплины	Задание	Часы	Методические рекомендации по выполнению задания	Форма контроля
1.	Основы управление рисками, классификация рисков	Подготовиться к тематическому контролю Подготовиться к решению кейсов	24,65	Изучить лекции, литературу по проблематике	Тематический контроль
2.	Риск-менеджмент: понятие, функции, принципы, стратегия, способы управления рисками	Подготовиться к решению кейсов	30	Изучить лекции, литературу по проблематике	Решение кейсов Проблемная дискуссия,
3	Методы анализа и оценки риска. Анализ неопределенности риска	Подготовиться к решению задач	30	Изучить лекции, литературу по проблематике	Решение задач
4	Управление специфическим и видами	Подготовиться к решению кейсов Индивидуальное	30	Изучить лекции, литературу по	Проблемная дискуссия, Решение кейсов

	рисков	задание		проблематике	Индивидуальное задание
	Итого		114,65		

## 6.2. Тематика и задания для практических занятий

### Темы и задания

Тема 1. Основы управление рисками, классификация рисков.

Задание: Подготовиться к тематическому контролю. Подготовиться к решению кейсов.

Тема 2. Риск-менеджмент: понятие, функции, принципы, стратегия, способы управления рисками.

Задание: Проблемная дискуссия по теме, решение кейса.

Тема 3. Методы анализа и оценки риска. Анализ неопределенности риска .

Задание: Решение задач по теме .

Тема 4. Управление специфическими видами рисков.

Задание: Решение кейсов. Защита индивидуального задания.

## 6.3. Тематика и задания для лабораторных занятий

### 6.4. Методические рекомендации для выполнения курсовых работ (проектов)

## 7. Перечень основной и дополнительной литературы, необходимой для освоения дисциплины

### а) основная:

1. Салихов В.А. Основы научных исследований: учебное пособие. – Москва, Берлин: Директ-Медиа, 2017. – 150 с.

2. Шапкин А.С, Шапкин В.А. Математические методы и модели исследования операций: учебник. – М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К °», 2017. – 398 с.

3. Сорокин А.В. Общая экономика: бакалавриат, магистратура, аспирантура: учебник. – Москва, Берлин: Директ-Медиа, 2016. – 640 с.

4. Экономическая теория. Экономические системы: формирование и развитие: учебник / Под ред. Ларионова И.К., Сильвестрова С.Н. – М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К °», 2017. – 874 с.

5. Войтов А.Г. История экономических учений: учебное пособие. – М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К °», 2017. – 228 с.

### б) дополнительная:

1. Экономическая теория: макроэкономика -1,2, метаэкономика, экономика трансформаций: учебник / Под общей ред. Журавлева Г.П. – М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К °», 2016. – 919 с.

2. Салихов Б.В. Экономическая теория: учебник. – М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К °», 2016. – 723 с.

3. Базилов А.А. Микроэкономика (продвинутый уровень): учебно-методическое пособие. – Москва, Берлин, 2016. – 141 с.

4. Институциональная экономика: учебник / Под ред. Ларионова И.К. – М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К °», 2017. – 360 с.

5. Магистерская диссертация: методология научно-исследовательской деятельности по направлению подготовки 38.04.01 «Экономика»: учебное пособие. – Архангельск: САФУ, 2014. – 136 с.

6. Овчаров А.О. Исследование социально-экономических и политических процессов: учебное пособие. – М.: Директ-Медиа, 2013. – 260 с.

7. Балдин К.В., Башлыков В.Н., Рокосцев А.В. Математические методы и модели в экономике: учебник. – М.: Флинта, 2012. -328 с.

8. Делен С.А. Методы экономических исследований. Конспект лекций: учебное пособие. – М.: А-Приор, 2011. – 160 с.

9. Шкляр М.Ф. Основы научных исследований: учебное пособие. – М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К °», 2017. – 208 с.

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

*Электронные библиотечные системы:*

1. ЭБС Университетская библиотека онлайн - <http://biblioclub.ru>
2. ЭБС «Лань» <https://e.lanbook.com>
3. ЭБС «ZNANIUM.COM» <http://znanium.com>

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

В зависимости от расписания занятий на текущий учебный год занятия могут проходить:

- лекционные – в ауд. 205, 206, 331, 325, 319, 303, 302, 231, каждая из которых оснащена мультимедийным проектором, и настенным экраном, в первых двух имеется безлимитный интернет, зона wi – fi;
- практические – в ауд. 204, 203, 205, 206. Аудитории 205, 206 оснащены компьютерами с офисным пакетом (по 8 в каждой), мультимедийным проектором, настенным экраном. Имеется безлимитный интернет, зона wi – fi;
- самостоятельная работа – Помещения для самостоятельной работы (главный корпус – 318 ауд.; корпус А – 309 ауд.; корпус Б – 302 ауд.; корпус Е – 406, 410 ад.; корпус Ж – 211 ауд.; корпус Б1 – 47, 48, 50, 54, 55, 63, 70 ауд.; корпус В1 – 48, 57, 59, 61, 64 ауд.) оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в ЭИОС КГУ