

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
"РЯЗАНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ РАДИОТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ ИМЕНИ
В.Ф. УТКИНА"**

СОГЛАСОВАНО
Зав. выпускающей кафедры

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по УР

А.В. Корячко

Риск-менеджмент

рабочая программа дисциплины (модуля)

Закреплена за кафедрой **Экономики, менеджмента и организации производства**

Учебный план 38.03.01_20_00.plx
38.03.01 Экономика

Квалификация **бакалавр**

Форма обучения **очная**

Общая трудоемкость **4 ЗЕТ**

Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	6 (3.2)		Итого	
	16			
Неделя	16			
Вид занятий	УП	РП	УП	РП
Лекции	32	32	32	32
Практические	32	32	32	32
Иная контактная работа	0,35	0,35	0,35	0,35
Консультирование перед экзаменом и практикой	2	2	2	2
Итого ауд.	66,35	66,35	66,35	66,35
Контактная работа	66,35	66,35	66,35	66,35
Сам. работа	51	51	51	51
Часы на контроль	26,65	26,65	26,65	26,65
Итого	144	144	144	144

г. Рязань

Программу составил(и):

к.э.н., доц., Куприянова Марина Владимировна

Рабочая программа дисциплины

Риск-менеджмент

разработана в соответствии с ФГОС ВО:

ФГОС ВО - бакалавриат по направлению подготовки 38.03.01 Экономика (приказ Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 954)

составлена на основании учебного плана:

38.03.01 Экономика

утвержденного учёным советом вуза от 28.01.2022 протокол № 6.

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры

Экономики, менеджмента и организации производства

Протокол от 18.05.2022 г. № 9

Срок действия программы: 2020-2024 уч.г.

Зав. кафедрой Евдокимова Елена Николаевна

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2023-2024 учебном году на заседании кафедры
Экономики, менеджмента и организации производства

Протокол от _____ 2023 г. № ____

Зав. кафедрой _____

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2024-2025 учебном году на заседании кафедры
Экономики, менеджмента и организации производства

Протокол от _____ 2024 г. № ____

Зав. кафедрой _____

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2025-2026 учебном году на заседании кафедры
Экономики, менеджмента и организации производства

Протокол от _____ 2025 г. № ____

Зав. кафедрой _____

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

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

Экономики, менеджмента и организации производства

Протокол от _____ 2026 г. № ____

Зав. кафедрой _____

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)	
1.1	Цель дисциплины – формирование у студентов профессиональных компетенций в сфере управления рисками, освоения современных теоретических концепций, методов и подходов к измерению, контролю и управлению рисками.
1.2	Задачи дисциплины:
1.3	- формирование знаний, необходимых для понимания особенностей проявления рисков, их классификацией и методов прогнозирования;
1.4	- изучение методов принятия решений в условиях неопределенности;
1.5	- овладение способами и методами эффективного управления рисками;
1.6	- формирование способностей к проведению исследований источников возникновения рисков, систематизации факторов и проведения их оценки для принятия решений и разрешению проблемных ситуаций;
1.7	- развитие способности использования для решения аналитических и исследовательских задач современных технических средств и информационных технологий.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ	
Цикл (раздел) ОП:	Б1.В
2.1	Требования к предварительной подготовке обучающегося:
2.1.1	Логистика
2.1.2	Производственный менеджмент
2.1.3	Корпоративные финансы
2.1.4	Ознакомительная практика
2.1.5	Менеджмент
2.2	Дисциплины (модули) и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:
2.2.1	WorldSkills: Предпринимательство
2.2.2	WorldSkills: Управление жизненным циклом
2.2.3	Контроллинг
2.2.4	Организация и планирование инвестиционной деятельности предприятия
2.2.5	Оценка и управление стоимостью промышленного предприятия
2.2.6	Планирование на предприятии
2.2.7	Бизнес-процессы промышленного предприятия
2.2.8	Организация инновационной деятельности на промышленном предприятии
2.2.9	Подготовка к процедуре защиты и процедура защиты выпускной квалификационной работы
2.2.10	Подготовка к сдаче и сдача государственного экзамена
2.2.11	Преддипломная практика
2.2.12	Стратегический менеджмент

3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)	
УК-10: Способен принимать обоснованные экономические решения в различных областях жизнедеятельности	
УК-10.1. Использует инструменты и методы принятия решений в различных областях жизнедеятельности	
Знать инструменты и методы принятия решений в области управления рисками	
Уметь проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании	
Владеть методами анализа и оценки степени риска	
УК-10.2. Экономически обосновывает принимаемые решения в различных областях жизнедеятельности	
Знать основы управления рисками на предприятиях	
Уметь проводить экономическое обоснование принимаемых решений в области управления рисками	
Владеть понятийным аппаратом экономического обоснования принимаемых решений в области управления рисками	

ПК-3: Способен к расчету экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов, к оценке рыночных возможностей и разработке бизнес планов
ПК-3.3. Выявляет риски и факторы их определяющие, оценивает риски и разрабатывает мероприятия по воздействию на риск
Знать основы анализа деятельности организации и оценки рисков с целью обоснования рационального управленческого решения.
Уметь выявлять факторы, определяющие риски, и проводить оценку рисков с целью обоснования рационального управленческого решения
Владеть навыками оценки рисков и экономической эффективности деятельности организации, навыками принятия управленческих решений с учетом оценки рисков

В результате освоения дисциплины (модуля) обучающийся должен

3.1 Знать:	
3.1.1	основы управления рисками на предприятиях;
3.1.2	инструменты и методы принятия решений в области управления рисками;
3.1.3	основы анализа деятельности организации и оценки рисков с целью обоснования рационального управленческого решения.
3.2 Уметь:	
3.2.1	проводить экономическое обоснование принимаемых решений в области управления рисками;
3.2.2	проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании;
3.2.3	выявлять факторы, определяющие риски, и проводить оценку рисков с целью обоснования рационального управленческого решения
3.3 Владеть:	
3.3.1	понятийным аппаратом экономического обоснования принимаемых решений в области управления рисками;
3.3.2	методами анализа и оценки степени риска;
3.3.3	навыками оценки рисков и экономической эффективности деятельности организации, навыками принятия управленческих решений с учетом оценки рисков

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Код занятия	Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр / Курс	Часов	Компетенции	Литература	Форма контроля
	Раздел 1. Теоретическое обучение					
1.1	Введение в риск-менеджмент /Тема/	6	0			
1.2	Процессы управления риском. Категории «риск» и «доходность». Основные элементы и этапы управления риском. Манипулирование риском. Глобальные задачи в области управления рисками: применение риск менеджмента; управление рисками по их типам; точность оценок рисков. Функции риск- менеджмента. Организация риск-менеджмента. Понятия: интуиция, инсайт, эвристика. Правила риск-менеджмента. Расчет коэффициента риска. Функции отдела рискованных вложений капитала. Информационное обеспечение функционирования риск-менеджмента. Перечень документов, характеризующих финансовое состояние организации. /Лек/	6	4	УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4	

1.3	Процессы управления риском. Категории «риск» и «доходность». Основные элементы и этапы управления риском. Манипулирование риском. Глобальные задачи в области управления рисками: применение риск менеджмента; управление рисками по их типам; точность оценок рисков. Функции риск-менеджмента. Организация риск-менеджмента. Понятия: интуиция, инсайт, эвристика. Правила риск-менеджмента. Расчет коэффициента риска. Функции отдела рискованных вложений капитала. Информационное обеспечение функционирования риск-менеджмента. Перечень документов, характеризующих финансовое состояние организации. /Пр/	6	4	УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4	
1.4	Процессы управления риском. Категории «риск» и «доходность». Основные элементы и этапы управления риском. Манипулирование риском. Глобальные задачи в области управления рисками: применение риск менеджмента; управление рисками по их типам; точность оценок рисков. Функции риск-менеджмента. Организация риск-менеджмента. Понятия: интуиция, инсайт, эвристика. Правила риск-менеджмента. Расчет коэффициента риска. Функции отдела рискованных вложений капитала. Информационное обеспечение функционирования риск-менеджмента. Перечень документов, характеризующих финансовое состояние организации. /Ср/	6	8	УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4	
1.5	Виды рисков /Тема/	6	0			
1.6	Классификация рисков по их функциональной направленности. Чистые и спекулятивные риски. Производственный риск. Коммерческий риск. Финансовый риск. Риски зависимости от основной причины их возникновения. Риски, связанные с покупательной способностью денег. Инвестиционные риски. Производственный риск. Коммерческий риск. Финансовый риск. Селективные риски. Риск банкротства. Биржевые риски. Транспортный риск – четыре группы по степени ответственности (Е, F, С, D). Валютный риск. Региональный риск. Отраслевой риск. Инновационный риск. Риски неисполнения хозяйственных договоров. Риски изменения рыночной конъюнктуры и усиления конкуренции. Риски возникновения непредвиденных расходов и снижения доходов. Риски потери имущества бизнеса. Риск невостребованности продукции. Форс – мажорные риски. /Лек/	6	4	УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4	

1.7	Классификация рисков по их функциональной направленности. Чистые и спекулятивные риски. Производственный риск. Коммерческий риск. Финансовый риск. Риски зависимости от основной причины их возникновения. Риски, связанные с покупательной способностью денег. Инвестиционные риски. Производственный риск. Коммерческий риск. Финансовый риск. Селективные риски. Риск банкротства. Биржевые риски. Транспортный риск – четыре группы по степени ответственности (Е, F, C, D.). Валютный риск. Региональный риск. Отраслевой риск. Инновационный риск. Риски неисполнения хозяйственных договоров. Риски изменения рыночной конъюнктуры и усиления конкуренции. Риски возникновения непредвиденных расходов и снижения доходов. Риски потери имущества бизнеса. Риск невостребованности продукции. Форс – мажорные риски. /Пр/	6	4	УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4	
1.8	Классификация рисков по их функциональной направленности. Чистые и спекулятивные риски. Производственный риск. Коммерческий риск. Финансовый риск. Риски зависимости от основной причины их возникновения. Риски, связанные с покупательной способностью денег. Инвестиционные риски. Производственный риск. Коммерческий риск. Финансовый риск. Селективные риски. Риск банкротства. Биржевые риски. Транспортный риск – четыре группы по степени ответственности (Е, F, C, D.). Валютный риск. Региональный риск. Отраслевой риск. Инновационный риск. Риски неисполнения хозяйственных договоров. Риски изменения рыночной конъюнктуры и усиления конкуренции. Риски возникновения непредвиденных расходов и снижения доходов. Риски потери имущества бизнеса. Риск невостребованности продукции. Форс – мажорные риски. /Ср/	6	7	УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4	
1.9	Идентификация и концептуальные направления анализа рисков /Тема/	6	0			

1.10	<p>Качественный анализ. Количественной оценки. Этапы идентификации и анализа рисков. Принципы информационного обеспечения системы управления риском. Полезность информации. Эффективность управления риском. Доступность информации. Достоверность информации. Общие группы источников информации при анализе конкретных рисков. Информационная система, обслуживающая процесс управления рисками. Визуализация рисков. Приемы визуализации рисков. Плотность распределения в связи с реализацией предупредительного мероприятия. Концепция приемлемого риска. Пороговые значения риска. Рисковый капитал. Система неопределенностей. Полная неопределенность. Полная определенность. Частичная неопределенность. Критерии определения оптимальности в сфере неопределенности. Определение степени риска. Методы оценки риска: количественный и качественный. Внутренняя норма доходности (IRR); ожидаемая норма доходности (ERR). Коэффициент вариации (CV). Нормальное распределение вероятностей и кривая рисков. Эмпирическая шкала допустимого уровня риска. Кривая рисков. Методы экспертных оценок при определении степени риска. Концепция рисковой стоимости (Value at risk – VAR). Ключевые параметры определения рисковой стоимости (VAR). Объективный метод установления доверительного интервала и временного горизонта. Традиционные техники аппроксимации распределения $Rt(T)$: параметрический метод; моделирование по историческим данным; метод Монте – Карло; анализ сценариев. /Лек/</p>	6	6	<p>УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В</p>	<p>Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4</p>	
------	--	---	---	---	--	--

1.11	<p>Качественный анализ. Количественной оценки. Этапы идентификации и анализа рисков. Принципы информационного обеспечения системы управления риском. Полезность информации. Эффективность управления риском. Доступность информации. Достоверность информации. Общие группы источников информации при анализе конкретных рисков. Информационная система, обслуживающая процесс управления рисками. Визуализация рисков. Приемы визуализации рисков. Плотность распределения в связи с реализацией предупредительного мероприятия. Концепция приемлемого риска. Пороговые значения риска. Рисковый капитал. Система неопределенностей. Полная неопределенность. Полная определенность. Частичная неопределенность. Критерии определения оптимальности в сфере неопределенности. Определение степени риска. Методы оценки риска: количественный и качественный. Внутренняя норма доходности (IRR); ожидаемая норма доходности (ERR). Коэффициент вариации (CV). Нормальное распределение вероятностей и кривая рисков. Эмпирическая шкала допустимого уровня риска. Кривая рисков. Методы экспертных оценок при определении степени риска. Концепция рисковой стоимости (Value at risk – VAR). Ключевые параметры определения рисковой стоимости (VAR). Объективный метод установления доверительного интервала и временного горизонта. Традиционные техники аппроксимации распределения Rt(T): параметрический метод; моделирование по историческим данным; метод Монте – Карло; анализ сценариев. /Пр/</p>	6	6	<p>УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В</p>	<p>Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4</p>	
------	--	---	---	---	--	--

1.12	<p>Качественный анализ. Количественной оценки. Этапы идентификации и анализа рисков. Принципы информационного обеспечения системы управления риском. Полезность информации. Эффективность управления риском. Доступность информации. Достоверность информации. Общие группы источников информации при анализе конкретных рисков. Информационная система, обслуживающая процесс управления рисками. Визуализация рисков. Приемы визуализации рисков. Плотность распределения в связи с реализацией предупредительного мероприятия. Концепция приемлемого риска. Пороговые значения риска. Рисковый капитал. Система неопределенностей. Полная неопределенность. Полная определенность. Частичная неопределенность. Критерии определения оптимальности в сфере неопределенности. Определение степени риска. Методы оценки риска: количественный и качественный. Внутренняя норма доходности (IRR); ожидаемая норма доходности (ERR). Коэффициент вариации (CV). Нормальное распределение вероятностей и кривая рисков. Эмпирическая шкала допустимого уровня риска. Кривая рисков. Методы экспертных оценок при определении степени риска. Концепция рисковой стоимости (Value at risk – VAR). Ключевые параметры определения рисковой стоимости (VAR). Объективный метод установления доверительного интервала и временного горизонта. Традиционные техники аппроксимации распределения Rt(T): параметрический метод; моделирование по историческим данным; метод Монте – Карло; анализ сценариев. /Ср/</p>	6	10	<p>УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В</p>	<p>Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4</p>	
1.13	Процесс управления рисками в организации и его этапы /Тема/	6	0			

1.14	<p>Идентификация и анализ риска. Анализ альтернатив управления риском. Методы минимизации негативного влияния неблагоприятных событий. Классификация методов управления рисками. Выбор методов управления риском. Исполнение выбранного метода управления риском. Мониторинг результатов и совершенствование системы управления риском. Методы управления рисками (четыре группы). Методы уклонения от риска. Схема методов управления рисками. Ограничения применения методов управления рисками. Основные реквизиты страхового полиса или свидетельства. Основные контракты, заключаемые при передаче риска. Методы локализации и диссипации риска. Четыре основных вида интеграции, как способ минимизации риска. Диверсификация, как разновидность методов диссипации риска. Виды диверсификации. Методы компенсации риска, как упреждающие методы управления рисками. Снижение предпринимательских рисков. Методы проверки деловых партнеров правила пяти «С». Управление информационными рисками. Группы информационных рисков. Методы финансирования рисков и схема их классификации. Покрытие убытка из текущего дохода (Current expensing of losses). Покрытие убытка из резервов (Reserving). Покрытие убытка за счет использования займа (Borrowing). Покрытие убытка на основе самострахования (Self-Insurance). Создание кэптиновых страховых организаций (captive insurance). Покрытие ущерба за счет передачи ответственности на основе договора (Contractual transfer). Покрытие убытка на основе поддержки государственных либо муниципальных органов (Budget support). Покрытие убытка на основе спонсорства (Sponsorship). /Лек/</p>	6	6	УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4	
------	---	---	---	--	---	--

1.15	<p>Идентификация и анализ риска. Анализ альтернатив управления риском. Методы минимизации негативного влияния неблагоприятных событий. Классификация методов управления рисками. Выбор методов управления риском. Исполнение выбранного метода управления риском. Мониторинг результатов и совершенствование системы управления риском. Методы управления рисками (четыре группы). Методы уклонения от риска. Схема методов управления рисками. Ограничения применения методов управления рисками. Основные реквизиты страхового полиса или свидетельства. Основные контракты, заключаемые при передаче риска. Методы локализации и диссипации риска. Четыре основных вида интеграции, как способ минимизации риска. Диверсификация, как разновидность методов диссипации риска. Виды диверсификации. Методы компенсации риска, как упреждающие методы управления рисками. Снижение предпринимательских рисков. Методы проверки деловых партнеров правила пяти «С». Управление информационными рисками. Группы информационных рисков. Методы финансирования рисков и схема их классификации. Покрытие убытка из текущего дохода (Current expensing of losses). Покрытие убытка из резервов (Reserving). Покрытие убытка за счет использования займа (Borrowing). Покрытие убытка на основе самострахования (Self-Insurance). Создание кэптиновых страховых организаций (captive insurance). Покрытие ущерба за счет передачи ответственности на основе договора (Contractual transfer). Покрытие убытка на основе поддержки государственных либо муниципальных органов (Budget support). Покрытие убытка на основе спонсорства (Sponsorship). /Пр/</p>	6	6	<p>УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В</p>	<p>Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4</p>	
------	--	---	---	---	--	--

1.16	<p>Идентификация и анализ риска. Анализ альтернатив управления риском. Методы минимизации негативного влияния неблагоприятных событий. Классификация методов управления рисками. Выбор методов управления риском. Исполнение выбранного метода управления риском. Мониторинг результатов и совершенствование системы управления риском. Методы управления рисками (четыре группы). Методы уклонения от риска. Схема методов управления рисками. Ограничения применения методов управления рисками. Основные реквизиты страхового полиса или свидетельства. Основные контракты, заключаемые при передаче риска. Методы локализации и диссипации риска. Четыре основных вида интеграции, как способ минимизации риска. Диверсификация, как разновидность методов диссипации риска. Виды диверсификации. Методы компенсации риска, как упреждающие методы управления рисками. Снижение предпринимательских рисков. Методы проверки деловых партнеров правила пяти «С». Управление информационными рисками. Группы информационных рисков. Методы финансирования рисков и схема их классификации. Покрытие убытка из текущего дохода (Current expensing of losses). Покрытие убытка из резервов (Reserving). Покрытие убытка за счет использования займа (Borrowing). Покрытие убытка на основе самострахования (Self-Insurance). Создание кэптиновых страховых организаций (captive insurance). Покрытие ущерба за счет передачи ответственности на основе договора (Contractual transfer). Покрытие убытка на основе поддержки государственных либо муниципальных органов (Budget support). Покрытие убытка на основе спонсорства (Sponsorship). /Ср/</p>	6	6	УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4	
1.17	Управление банковскими рисками /Тема/	6	0			

1.18	<p>Классы источников информационной неопределенности. Подход к управлению рисками Ф. Найта, основанный на математической базе для количественного измерения. Определение банковского риска. Виды банковских рисков. Риск невозврата размещенных ресурсов банка. Риск невозврата размещенных ресурсов банка. Оценка ссудного риска банка. Объект размещения ресурсов банка (ОРР). Суммарный риск нескольких банковских активов. Показатели рискованности ОРР банка. Базовая схема проведения оценки рискованности ОРР. Методика и основные этапы оценки рискованности ОРР банка. Методология формализованной оценки рискованности объекта размещения ресурсов банка. Управление рисками, возникающими при лизинговом инвестировании. Страховая защита участников лизинговой сделки. Превентивные и поддерживающие мероприятия риск-стратегий. Матрица стратегического потенциала. Риск-менеджмент в сфере агропромышленного производства. Хеджирование рисков. Форвардные и фьючерсные контракты. Опционы. Страхование или хеджирование. Модель хеджирования. /Лек/</p>	6	6	<p>УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В</p>	<p>Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4</p>	
1.19	<p>Классы источников информационной неопределенности. Подход к управлению рисками Ф. Найта, основанный на математической базе для количественного измерения. Определение банковского риска. Виды банковских рисков. Риск невозврата размещенных ресурсов банка. Риск невозврата размещенных ресурсов банка. Оценка ссудного риска банка. Объект размещения ресурсов банка (ОРР). Суммарный риск нескольких банковских активов. Показатели рискованности ОРР банка. Базовая схема проведения оценки рискованности ОРР. Методика и основные этапы оценки рискованности ОРР банка. Методология формализованной оценки рискованности объекта размещения ресурсов банка. Управление рисками, возникающими при лизинговом инвестировании. Страховая защита участников лизинговой сделки. Превентивные и поддерживающие мероприятия риск-стратегий. Матрица стратегического потенциала. Риск-менеджмент в сфере агропромышленного производства. Хеджирование рисков. Форвардные и фьючерсные контракты. Опционы. Страхование или хеджирование. Модель хеджирования. /Пр/</p>	6	6	<p>УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В</p>	<p>Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4</p>	

1.20	Классы источников информационной неопределенности. Подход к управлению рисками Ф. Найта, основанный на математической базе для количественного измерения. Определение банковского риска. Виды банковских рисков. Риск невозврата размещенных ресурсов банка. Риск невозврата размещенных ресурсов банка. Оценка ссудного риска банка. Объект размещения ресурсов банка (ОРР). Суммарный риск нескольких банковских активов. Показатели рискованности ОРР банка. Базовая схема проведения оценки рискованности ОРР. Методика и основные этапы оценки рискованности ОРР банка. Методология формализованной оценки рискованности объекта размещения ресурсов банка. Управление рисками, возникающими при лизинговом инвестировании. Страховая защита участников лизинговой сделки. Превентивные и поддерживающие мероприятия риск-стратегий. Матрица стратегического потенциала. Риск-менеджмент в сфере агропромышленного производства. Хеджирование рисков. Форвардные и фьючерсные контракты. Опционы. Страхование или хеджирование. Модель хеджирования. /Ср/	6	10	УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4	
1.21	Портфельный менеджмент /Тема/	6	0			
1.22	Анализ риска в инвестиционной программе с привлечением кредитов. Выбор оптимального инвестиционного проекта. Метод «ПАТТЕРН». График вероятностей периодов погашения кредита. Суммарные значения вероятностей периодов погашения кредита. Двухуровневые вероятности окупаемости программ инвестирования. Расчет совокупных вероятностей периодов окупаемости инвестиций. Совокупные вероятности обобщенных периодов окупаемости в программах инвестирования. Рейтинговые значения двухуровневых вероятностей окупаемости инвестиций. Расчет рейтинговых значений совокупных вероятностей периодов окупаемости инвестиций. Основные понятия и принципы оценки эффективности инвестиций. Эффективность участия в проекте собственного капитала. Объем собственных средств участника. Объем собственных средств, вкладываемых в проект. Интегральные показатели эффективности. Оценка эффективности: проекта в целом; участия в проекте. Показатели эффективности участия в проекте. Рациональный выбор инвестиционного портфеля. Реальные и финансовые инвестиции. Этапы процесса управления инвестициями. Портфельные стратегии: активные и пассивные. Диверсифицированный портфель. Кривые безразличия. Рисковые и безрисковые активы. Двухпараметрическая модель Гарри Марковица. Ковариационная матрица. Анализ значений риска портфелей. /Лек/	6	6	УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4	

1.23	<p>Анализ риска в инвестиционной программе с привлечением кредитов. Выбор оптимального инвестиционного проекта. Метод «ПАТТЕРН». График вероятностей периодов погашения кредита. Суммарные значения вероятностей периодов погашения кредита. Двухуровневые вероятности окупаемости программ инвестирования. Расчет совокупных вероятностей периодов окупаемости инвестиций. Совокупные вероятности обобщенных периодов окупаемости в программах инвестирования. Рейтинговые значения двухуровневых вероятностей окупаемости инвестиций. Расчет рейтинговых значений совокупных вероятностей периодов окупаемости инвестиций. Основные понятия и принципы оценки эффективности инвестиций. Эффективность участия в проекте собственного капитала. Объем собственных средств участника. Объем собственных средств, вкладываемых в проект. Интегральные показатели эффективности. Оценка эффективности: проекта в целом; участия в проекте. Показатели эффективности участия в проекте. Рациональный выбор инвестиционного портфеля. Реальные и финансовые инвестиции. Этапы процесса управления инвестициями. Портфельные стратегии: активные и пассивные. Диверсифицированный портфель. Кривые безразличия. Рисковые и безрисковые активы. Двухпараметрическая модель Гарри Марковица. Ковариационная матрица. Анализ значений риска портфелей. /Пр/</p>	6	6	УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4	
------	---	---	---	--	---	--

1.24	Анализ риска в инвестиционной программе с привлечением кредитов. Выбор оптимального инвестиционного проекта. Метод «ПАТТЕРН». График вероятностей периодов погашения кредита. Суммарные значения вероятностей периодов погашения кредита. Двухуровневые вероятности окупаемости программ инвестирования. Расчет совокупных вероятностей периодов окупаемости инвестиций. Совокупные вероятности обобщенных периодов окупаемости в программах инвестирования. Рейтинговые значения двухуровневых вероятностей окупаемости инвестиций. Расчет рейтинговых значений совокупных вероятностей периодов окупаемости инвестиций. Основные понятия и принципы оценки эффективности инвестиций. Эффективность участия в проекте собственного капитала. Объем собственных средств участника. Объем собственных средств, вкладываемых в проект. Интегральные показатели эффективности. Оценка эффективности: проекта в целом; участия в проекте. Показатели эффективности участия в проекте. Рациональный выбор инвестиционного портфеля. Реальные и финансовые инвестиции. Этапы процесса управления инвестициями. Портфельные стратегии: активные и пассивные. Диверсифицированный портфель. Кривые безразличия. Рисковые и безрисковые активы. Двухпараметрическая модель Гарри Марковица. Ковариационная матрица. Анализ значений риска портфелей. /Ср/	6	10	УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4	
Раздел 2. Промежуточная аттестация						
2.1	Подготовка к экзамену /Тема/	6	0			
2.2	Подготовка к экзамену и промежуточной аттестации /ИКР/	6	0,35	УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1	
2.3	Подготовка к экзамену и промежуточной аттестации /Кнс/	6	2	УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1	
2.4	Проведение экзамена /Экзамен/	6	26,65	УК-10.1-3 УК-10.1-У УК-10.1-В УК-10.2-3 УК-10.2-У УК-10.2-В ПК-3.3-3 ПК-3.3-У ПК-3.3-В	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Л2.6 Л2.7 Л2.8 Л2.9 Л2.10 Л2.11Л3.1	

5. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

ФОС по дисциплине "Риск-менеджмент" представлен в Приложении
--

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

6.1. Рекомендуемая литература

6.1.1. Основная литература

№	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Количество/название ЭБС
Л1.1	Балдин К. В.	Управление рисками : учебное пособие	Москва: ЮНИТИ-ДАНА, 2012, 512 с.	5-238-00861-9, http://www.iprbookshop.ru/10513.html
Л1.2	Балдин К. В., Воробьев С. Н.	Управление рисками : учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальностям экономики и управления (060000)	Москва: ЮНИТИ-ДАНА, 2017, 511 с.	5-238-00861-9, http://www.iprbookshop.ru/71229.html
Л1.3	Пасько Е. А.	Риск-менеджмент в корпоративном бизнесе : курс лекций на английском языке. направление подготовки 38.04.08 - финансы и кредит. магистерская программа «корпоративные финансы»	Ставрополь: СКФУ, 2016, 110 с.	, https://e.lanbook.com/book/155618
Л1.4	Барбаумов, В. Е., Рогов, М. А., Щукин, Д. Ф., Ситникова, Н. Ю., Бурков, П. В., Тихомиров, С. Н., Лобанов, А. А., Замковой, С. В., Шпрингель, В. К., Голембиовский, Д. Ю., Лобанова, А. А., Чугунова, А. В.	Энциклопедия финансового риск-менеджмента	Москва: Альпина Бизнес Букс, 2020, 932 с.	978-5-9614-0824-9, http://www.iprbookshop.ru/96867.html

6.1.2. Дополнительная литература

№	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Количество/название ЭБС
Л2.1	Титаренко Б. П.	Управление рисками в инновационных проектах : монография	Москва: Московский государственный строительный университет, ЭБС АСВ, 2011, 144 с.	978-5-7264-0548-3, http://www.iprbookshop.ru/16322.html
Л2.2	Белов П.Г.	Управление рисками, системный анализ и моделирование: в 2 т. : учеб. и практикум для бакалавриата и магистратуры	М.: Юрайт, 2015, 460с.	978-5-9916-4703-8, 978-5-9916-4719-9, 1
Л2.3	Белов П.Г.	Управление рисками, системный анализ и моделирование: в 2 т. : учеб. и практикум для бакалавриата и магистратуры	М.: Юрайт, 2015, 272с.	978-5-9916-4703-8, 978-5-9916-4720-5, 1
Л2.4	Алексеенко В. Б., Кутлыева Г. М., Мочалова Ю. И.	Управление рисками в производственно-хозяйственной деятельности предприятия : учебно-методическое пособие	Москва: Российский университет дружбы народов, 2013, 88 с.	978-5-209-04695-0, http://www.iprbookshop.ru/22224.html

№	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Количество/название ЭБС
Л2.5	Фирсова О. А.	Управление рисками организаций : учебно-методическое пособие	Орел: Межрегиональная Академия безопасности и выживания (МАБИВ), 2014, 82 с.	2227-8397, http://www.iprbookshop.ru/33447.html
Л2.6	Шкурко В. Е., Гребенкин А. В.	Управление рисками проектов : учебное пособие	Екатеринбург: Уральский федеральный университет, ЭБС АСВ, 2014, 184 с.	978-5-7996-1266-5, http://www.iprbookshop.ru/65997.html
Л2.7	Рахимова Н. Н.	Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебное пособие	Оренбург: Оренбургский государственный университет, ЭБС АСВ, 2016, 191 с.	978-5-7410-1538-4, http://www.iprbookshop.ru/69961.html
Л2.8	Кулешова Е. В.	Управление рисками проектов : учебное пособие	Томск: Томский государственный университет систем управления и радиоэлектроники, Эль Контент, 2015, 188 с.	978-5-4332-0251-1, http://www.iprbookshop.ru/72205.html
Л2.9	Пономарев В. А., Воскресенская А. Н., Федорова Н. В., Борисенко В. П., Царегородцев Ю. Н.	Управление инвестициями. Управление персоналом. Основы управления персоналом. Управление проектами. Управление рисками. Выпуск 6 : глоссарий	Москва: Московский гуманитарный университет, 2013, 216 с.	978-5-98079-918-2, http://www.iprbookshop.ru/22466.html
Л2.10	Васин С.М., Шутов В.С.	Управление рисками на предприятии : учеб. пособие	М.: КНОРУС, 2010, 304с.	978-5-406-00191-2, 1
Л2.11	Плошкин В.В.	Оценка и управление рисками на предприятиях : учеб. пособие	Старый Оскол: ТНТ, 2013, 447с.	978-5-94178-349-6, 1

6.1.3. Методические разработки

№	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Количество/название ЭБС
Л3.1	Швайка О.И.	Риск-менеджмент : Методические указания	Рязань: РИЦ РГРТУ, 2020,	, https://elib.rsreu.ru/ebs/download/2505

6.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"

Э1	Информационно-правовой портал ГАРАНТ.РУ [Электронный ресурс]. – URL: http://www.garant.ru .			
Э2	Официальный интернет-портал правовой информации [Электронный ресурс]. – URL: http://www.pravo.gov.ru .			
Э3	Электронно-библиотечная система «IPRbooks» [Электронный ресурс]. – Режим доступа: доступ из корпоративной сети РГРТУ – свободный, доступ из сети Интернет – по паролю. – URL: https://iprbookshop.ru/			
Э4	Электронная библиотека РГРТУ [Электронный ресурс]. – Режим доступа: из корпоративной сети РГРТУ – по паролю. – URL: https://elib.rsreu.ru/			

6.3 Перечень программного обеспечения и информационных справочных систем**6.3.1 Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства**

Наименование	Описание
Операционная система Windows	Коммерческая лицензия
Adobe Acrobat Reader	Свободное ПО
LibreOffice	Свободное ПО
OpenOffice	Свободное ПО
Chrome	Свободное ПО
Firefox	Свободное ПО
7 Zip	Свободное ПО
Операционная система Windows XP	Microsoft Imagine, номер подписки 700102019, бессрочно
Операционная система Windows XP	
Kaspersky Endpoint Security	Коммерческая лицензия

6.3.2 Перечень информационных справочных систем

6.3.2.1	Справочная правовая система «КонсультантПлюс» (договор об информационной поддержке №1342/455-100 от 28.10.2011 г.)
6.3.2.2	Система КонсультантПлюс http://www.consultant.ru
6.3.2.3	Информационно-правовой портал ГАРАНТ.РУ http://www.garant.ru

8. МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

Методическое обеспечение дисциплины приведено в приложении к рабочей программе дисциплины (см. документ "Методические указания к дисциплине "Риск-менеджмент")

Подписано заведующим кафедры

ФГБОУ ВО "РГРТУ", РГРТУ, Евдокимова Елена Николаевна, Заведующий кафедрой
Простая подпись

Подписано заведующим выпускающей кафедры

ФГБОУ ВО "РГРТУ", РГРТУ, Евдокимова Елена Николаевна, Заведующий кафедрой
Простая подпись

Подписано проректором по УР

ФГБОУ ВО "РГРТУ", РГРТУ, Корячко Алексей Вячеславович, Проректор по учебной работе
Простая подпись