

**АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ**  
**Управление рисками**

Образовательная программа: 38.03.02 Менеджмент, профиль: Менеджмент организации

Курс: 4, семестр : 7

Факультет бизнеса

|           |                                                                                                      | <b>Семестр</b> |
|-----------|------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|
| <b>№</b>  | <b>Вид деятельности</b>                                                                              | <b>7</b>       |
| <b>1</b>  | Всего зачетных единиц (кредитов)                                                                     | 4              |
| <b>2</b>  | Всего часов                                                                                          | 144            |
| <b>3</b>  | Всего занятий в контактной форме, час.                                                               | 66             |
| <b>4</b>  | Лекции, час.                                                                                         | 18             |
| <b>5</b>  | Практические занятия, час.                                                                           | 36             |
| <b>6</b>  | Лабораторные занятия, час.                                                                           | 0              |
| <b>7</b>  | из них в активной и интерактивной форме, час.                                                        | 36             |
| <b>8</b>  | Аттестация, час.                                                                                     | 2              |
| <b>9</b>  | Консультации, час.                                                                                   | 10             |
| <b>10</b> | Самостоятельная работа, час.                                                                         | 78             |
| <b>11</b> | Виды самостоятельной работы (курсовой проект, курсовая работа, РГЗ, подготовка к контрольной работе) | РГЗ            |
| <b>12</b> | Вид аттестации                                                                                       | 3              |

**Внешние требования**

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>Компетенция ФГОС: ПК.15</b> умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании; <i>в части следующих результатов обучения:</i>                                                                                                                                                                                                                                         |
| з1. знать содержание риск-стратегии для снижения вероятности риска и минимизации возможных негативных последствий                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| з2. знать основные подходы к управлению рисками                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| у1. уметь осуществлять выбор методов и инструментов управления рыночными и специфическими рисками                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| <b>Компетенция ФГОС: ПК.9</b> способность оценивать воздействие макроэкономической среды на функционирование организаций и органов государственного и муниципального управления, выявлять и анализировать рыночные и специфические риски, а также анализировать поведение потребителей экономических благ и формирование спроса на основе знания экономических основ поведения организаций, структур рынков и конкурентной среды отрасли; <i>в части следующих результатов обучения:</i> |
| у1. уметь идентифицировать основные факторы рисков, включая рыночные и специфические, осуществлять выбор методов и инструментов управления рисками                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

## Требования НГТУ к результатам освоения дисциплины

| Результаты изучения дисциплины по уровням освоения (иметь представление, знать, уметь, владеть) | Формы организации занятий |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|
|-------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|

### Управление рисками

|                                                                                                                                                               |                                                      |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|
| <b>ПК.9.y1 уметь идентифицировать основные факторы рисков, включая рыночные и специфические, осуществлять выбор методов и инструментов управления рисками</b> |                                                      |
| 1. уметь идентифицировать источники экономической неопределенности                                                                                            | Лекции; Практические занятия; Самостоятельная работа |
| 2. уметь классифицировать экономические риски                                                                                                                 | Лекции; Практические занятия; Самостоятельная работа |
| <b>ПК.15.z2 знать основные подходы к управлению рисками</b>                                                                                                   |                                                      |
| 3. знать организацию работы по управлению рисками на предприятии                                                                                              | Лекции; Практические занятия; Самостоятельная работа |
| <b>ПК.15.z1 знать содержание риск-стратегии для снижения вероятности риска и минимизации возможных негативных последствий</b>                                 |                                                      |
| 4. уметь выбирать риск-стратегию развития предприятия с помощью методов теории игр                                                                            | Практические занятия; Самостоятельная работа         |
| 5. уметь выбирать риск-стратегию развития предприятия с помощью стресс-тестирования                                                                           | Лекции; Самостоятельная работа                       |
| <b>ПК.15.y1 уметь осуществлять выбор методов и инструментов управления рыночными и специфическими рисками</b>                                                 |                                                      |
| 6. уметь выбирать необходимый для данного предприятия и соответствующего типа хозяйственной операции инструмент управления риском                             | Лекции; Самостоятельная работа                       |
| 7. уметь выбирать необходимый для данного предприятия и соответствующего типа хозяйственной операции метод измерения риска                                    | Лекции; Практические занятия; Самостоятельная работа |
| <b>ПК.15.z2 знать основные подходы к управлению рисками</b>                                                                                                   |                                                      |
| 8. уметь организовать деятельность по сбору информации и управлению рисками на предприятии                                                                    | Лекции; Практические занятия; Самостоятельная работа |
| <b>ПК.15.y1 уметь осуществлять выбор методов и инструментов управления рыночными и специфическими рисками</b>                                                 |                                                      |
| 9. уметь выбирать наиболее приемлемый способ ограничения риска с учетом предполагаемых затрат и результатов                                                   | Лекции; Практические занятия; Самостоятельная работа |
| 10. вычислять основные характеристики риска с использованием статистических методов                                                                           | Лекции; Практические занятия; Самостоятельная работа |
| 11. вычислять стоимость под риском (VaR)                                                                                                                      | Лекции; Практические занятия; Самостоятельная работа |

## Литература

### Основная литература

1. Шапкин, А. С. Теория риска и моделирование рискованных ситуаций [Электронный ресурс] : учебник для бакалавров / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 6-е изд. - М.: Дашков и К, 2014. - 880 с. - ISBN 978-5-394-02170-1. - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog.php> - Загл. с экрана.
2. Базисная система риск-менеджмент организаций реального сектора экономики: Монография / Соколов Д.В., Барчуков А.В. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2016. - 125 с.: 60х90 1/16. - (Научная мысль) (Обложка. КБС) ISBN 978-5-16-006862-6 - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog.php> - Загл. с экрана.

### Дополнительная литература

1. Балдин К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учебное пособие [для вузов] / К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов. - М., 2012. - 418 с.

2. Круи М. Основы риск-менеджмента : [учебное пособие для подготовки к экзамену на получение сертификата Associate PRM] / М. Круи, Д. Галай, Р. Марк ; науч. ред. В. Б. Минасян ; [пер. с англ. Н. С. Сологуба]. - М., 2011. - 389, [1] с.
3. Бартон Т. Л. Риск-менеджмент : практика ведущих компаний / Томас Л. Бартон, Уильям Г. Шенкир, Пол Л. Уокер ; пер. с англ. Т. В. Клекоты [и др.]. - М. [и др.], 2008. - 207 с. : ил., табл.

#### *Интернет-ресурсы*

1. FERMA [Electronic resource] : Federation of European Risk Management Associations. - FERMA, 2001-2013. - Mode of access: <http://www.ferma.eu>. - Title from screen.
2. ЭБС НГТУ : <http://elibrary.nstu.ru/>
3. Русское общество управления рисками [Электронный ресурс] : официальный сайт. - Некоммерческое партнерство «Русское общество управления рисками», 2004-2015. - Режим доступа: <http://www.rrms.ru>. - Загл. с экрана.
4. ЭБС «Издательство Лань» : <https://e.lanbook.com/>
5. ЭБС IPRbooks : <http://www.iprbookshop.ru/>
6. ЭБС "Znaniy.com" : <http://znaniy.com/>

### **Методическое и программное обеспечение**

#### Методическое обеспечение

1. Балабин А. А. Риск-менеджмент [Электронный ресурс] : электронный учебно-методический комплекс / А. А. Балабин ; Новосиб. гос. техн. ун-т. - Новосибирск, [2011]. - Режим доступа: <http://courses.edu.nstu.ru/index.php?show=155&kurs=1158>. - Загл. с экрана.
2. Дронова Ю. В. Слайд-конспект по курсу «Риск – менеджмент» [Электронный ресурс] : конспект лекций / Ю. В. Дронова ; Новосиб. гос. техн. ун-т. - Новосибирск, [2015]. - Режим доступа: [http://elibrary.nstu.ru/source?bib\\_id=vts000214182](http://elibrary.nstu.ru/source?bib_id=vts000214182). - Загл. с экрана.

#### Специализированное программное обеспечение

- 1 Microsoft Office

### **Материально-техническое обеспечение дисциплины**

#### Компьютерный класс

| № | Наименование                                                                      | Назначение                                                              |
|---|-----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------|
| 1 | Компьютерный класс (Компьютеры объединены в локальную сеть с выходом в Internet ) | используется для решения задач и выполнения расчетно-графической работы |