

УТВЕРЖДАЮ
Первый проректор, проректор
по УР

_____ А.Е. Рудин

Рабочая программа дисциплины

Б1.В.ДВ.02.02 Риск-менеджмент

Учебный план: 2025-2026 38.05.01 ИЭСТ Эконом безоп ОО №3-1-173.plx

Кафедра: **29** Менеджмента

Направление подготовки:
(специальность) 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль подготовки: Экономическая безопасность бизнеса
(специализация)

Уровень образования: специалитет

Форма обучения: очная

План учебного процесса

Семестр (курс для ЗАО)	Контактная работа обучающихся		Сам. работа	Контроль, час.	Трудоё мкость, ЗЕТ	Форма промежуточной аттестации	
	Лекции	Практ. занятия					
7	УП	32	16	59,75	0,25	3	Зачет
	РПД	32	16	59,75	0,25	3	
Итого	УП	32	16	59,75	0,25	3	
	РПД	32	16	59,75	0,25	3	

Рабочая программа дисциплины составлена в соответствии с федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по направлению подготовки 38.05.01 Экономическая безопасность, утвержденным приказом Минобрнауки России от 14.04.2021 г. № 293

Составитель (и):

кандидат экономических наук, Доцент

Касаткин Б.П.

От кафедры составителя:

Заведующий кафедрой менеджмента

Титова Марина Николаевна

От выпускающей кафедры:

Заведующий кафедрой

Фрадина Татьяна
Ильинична

Методический отдел:

1 ВВЕДЕНИЕ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1 Цель дисциплины: Сформировать компетенции обучающегося в области анализа и управления рисками в разных сферах деятельности, принятия решений по выбору наиболее эффективных методов управления и минимизации рисков.

1.2 Задачи дисциплины:

- раскрыть этапы и тенденции мирового опыта исследования рисков, теории рискологии
- раскрыть принципы выбора методов выявления риска, его оценки и определения пределов допустимого риска;
- продемонстрировать особенности разработки методов управления риском,
- раскрыть методы анализа, оценки и планирования последствий реализации рисков

1.3 Требования к предварительной подготовке обучающегося:

Предварительная подготовка предполагает создание основы для формирования компетенций, указанных в п. 2, при изучении дисциплин:

- Бизнес-планирование
- Экономика предприятия
- Инновационный менеджмент

2 КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

ПК-2: Способен формировать, анализировать и интерпретировать информацию в области управления рисками субъектов различных уровней и применять ее для принятия решений по предупреждению, локализации и нейтрализации угроз экономической безопасности

Знать: Понятие риска и неопределённости; основные подходы к классификации рисков; основные отечественные и зарубежные концепции менеджмента рисков; принципы управления рисками; методы нейтрализации риска

Уметь: Идентифицировать риски; использовать методы количественного и качественного анализа рисков; управлять предпринимательскими рисками; организовывать работу исполнителей для выполнения работ, в области менеджмента рисков.

Владеть: Навыками анализа получаемой информации; методами контроля, мониторинга и прогнозирования рисков; навыками проведения «антирисковых» мероприятий; навыками разработки внутрифирменных положений и инструкций в области управления рисками.

3 РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Наименование и содержание разделов, тем и учебных занятий	Семестр (курс для ЗАО)	Контактная работа		СР (часы)	Инновац. формы занятий	Форма текущего контроля
		Лек. (часы)	Пр. (часы)			
Раздел 1. Общие принципы и понятия риск -менеджмента, история возникновения рискологии	7					Д,Р,О
Тема 1. История развития рискологии. Зарубежный опыт риск–менеджмента. Неопределенность. Практическое занятие -Неопределенность и риск предпринимательской деятельности.		3	1	6,25	ГД	
Тема 2. Понятие риска. Риск и неопределенность. Характеристики и элементы риска. Практическое занятие -Характеристики и элементы риска.		3	2	6,25	Т	
Тема 3. Тема 3. Классификация рисков. Критерии классификации. Риски в различных сферах деятельности. Практическое занятие - по теме лекций		4	2	7,25	РИ	
Тема 4. Идеология риск – менеджмента. Управление риском. Цели и методы управления риском. Практическое занятие -Этапы процесса управления риском.		2	2	7,25	Т	
Раздел 2. Применение инструментов риск – менеджмента						Д,Р,О,К

Тема 5. Методы выявления наличия риска. Проблемно-ориентировочные таблицы, экстраполяционные модели, методы экспертного прогнозирования при выявлении риска. Визуализация риска. Практическое занятие - Определение уровня приемлемого риска и его пороговых значений. Методика рискованного капитала.		4	2	6,25	АС	
Тема 6. Оценка риска. Идентификация и анализ предпринимательского риска. Качественные и количественные методы оценки риска. Практическое занятие -Объективные и субъективные методы оценки риска.		4	2	6,25	Т	
Тема 7. Пути снижения риска. Выбор методов снижения предпринимательского риска, их сущность и значение. Практическое занятие - Страхование.		4	2	6,25	РИ	
Тема 8. Принятие рисков, ограничение рисков, уклонение от риска. Практическое занятие - Хеджирование риска, страхование рисков, продажа рисков, обеспечение рисков.		4	2	6	ГД	
Тема 9. . Финансирование риска. Затраты на риск. Практическое занятие - Методы и источники финансирования риска их применение и эффективность		4	1	8	АС	
Итого в семестре (на курсе для ЗАО)		32	16	59,75		
Консультации и промежуточная аттестация (Зачет)		0,25				
Всего контактная работа и СР по дисциплине		48,25		59,75		

4 КУРСОВОЕ ПРОЕКТИРОВАНИЕ

Курсовое проектирование учебным планом не предусмотрено

5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

5.1 Описание показателей, критериев и системы оценивания результатов обучения

5.1.1 Показатели оценивания

Код компетенции	Показатели оценивания результатов обучения	Наименование оценочного средства
ПК-2	Перечисляет методы идентификации риска организации креативной сферы, методы анализа и оценки риска с учетом поведения потребителей экономических благ на локальных и глобальных рынках Выявляет и анализирует содержание процесса оценки риска в соответствии с внутренней и внешней средой функционирования организации; Проводит оценку предложений по конкретным направлениям изучения рынка с целью определения перспектив развития организации на основе создания инвестиционных проектов с наименьшей вероятностью риска	Вопросы для устного собеседования Практико-ориентированные задания

5.1.2 Система и критерии оценивания

Шкала оценивания	Критерии оценивания сформированности компетенций	
	Устное собеседование	Письменная работа

Зачтено	Полный, исчерпывающий ответ, явно демонстрирующий глубокое понимание предмета в оцениваемой области. Все заданные вопросы освещены в необходимой полноте и с требуемым качеством. Ошибки отсутствуют. Самостоятельная работа проведена в достаточном объеме, но ограничивается только основными рекомендованными источниками информации.	
Не зачтено	Неспособность ответить на вопрос без помощи экзаменатора. Незнание значительной части принципиально важных элементов дисциплины. Многочисленные грубые ошибки. Отсутствие одного или нескольких обязательных элементов задания, либо многочисленные грубые ошибки в работе, либо грубое нарушение правил оформления или сроков представления работы.	

5.2 Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности

5.2.1 Перечень контрольных вопросов

№ п/п	Формулировки вопросов
Семестр 7	
1	Основные черты и элементы риска.
2	Риски, их особенности и классификация
3	Критерии классификации рисков
4	Внутренние и внешние риски
5	Предпринимательские риски, основные черты и классификация
6	Финансовые и коммерческие риски
7	Внешние риски: страновой, валютный, налоговый и др.
8	Внутренние риски: организационный, ресурсный, портфельный, кредитный и инновационный
9	Процесс управления рисками: цели, задачи и стадии управления
10	Методы управления рисками
11	Страхование как метод снижения риска
12	Основные понятия и виды страхования
13	Способы выявления наличия риска, анализ и визуализация риска
14	Применение проблемно-ориентировочных таблиц, математического прогнозирования, сценарного метода и метода Дельфи для выявления риска.
15	Методы анализа риска
16	Качественная и количественная оценка риска
17	Основные математические инструменты теории вероятностей, применяемые для оценки риска
18	Интегральная оценка риска
19	Определение пороговых значений риска, понятие «рисковый капитал».
20	Принятие управленческих решений в ситуациях, связанных с риском
21	Основные типы отношения предпринимателей к риску

5.2.2 Типовые тестовые задания

Не предусмотрено

5.2.3 Типовые практико-ориентированные задания (задачи, кейсы)

1 Задача: Имеются два варианта вложения капитала. В первом варианте из 100 случаев в 55 был получен доход 100 тыс. р, в 45 случаях – 80 тыс. р. Во втором варианте из 160 случаев в 10 был получен доход 300 тыс. р., в 80 случаях – 110 тыс. р., в 70 случаях - 20 тыс. р. Необходимо выбрать наиболее доходный вариант вложения капитала.

2 Задача: Вы располагаете определенным капиталом и рассматриваете альтернативные возможности вложения его либо в производство кинофильма, либо в торговлю.

Вероятность успеха вложения капитала в кинофильм – 0,2, то же в торговлю – 0,7.

Вероятность неуспеха вложения капитала в кинофильм – 0,8, то же в торговлю – 0,3.

В случае успеха кинофильм дает 90 % прибыли, торговля – 30 %.

В случае неуспеха кинофильм дает 10 %, торговля – 20 %.

Куда выгоднее вложить капитал?

3 Задача: На территории предприятия произошла авария водопровода. Общая длина трубопровода - 150 м, в том числе 50 м трубы приходится на труднодоступные места.

Каков риск того, что ремонт придется производить на труднодоступном участке?

4 Задача: Покупатель хочет купить у продавца товар на 10 млн р. Они оба обращаются в страховое общество, которое страхует сделку и покупателя и продавца. Страховой тариф составляет 10 %. Определить общую сумму страховой премии.

5 Задача: Определить количество застрахованных объектов на предприятии, если страховая сумма по договору страхования составила 40 млн р. По страховому случаю было выплачено возмещение 12 млн р. Число пострадавших объектов - 4 при тяжести ущерба 0,6.

5.3 Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, владений (навыков и (или) практического опыта деятельности)

5.3.1 Условия допуска обучающегося к промежуточной аттестации и порядок ликвидации академической задолженности

Проведение промежуточной аттестации регламентировано локальным нормативным актом СПбГУПТД «Положение о проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся»

5.3.2 Форма проведения промежуточной аттестации по дисциплине

Устная Письменная Компьютерное тестирование Иная

5.3.3 Особенности проведения промежуточной аттестации по дисциплине

На подготовку к ответу выделяется 40 минут.

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

6.1 Учебная литература

Автор	Заглавие	Издательство	Год издания	Ссылка
6.1.1 Основная учебная литература				
Таскаева, Н. Н., Прохорова, Ю. С.	Антикризисное управление и риск-менеджмент	Москва: МИСИ-МГСУ, ЭБС АСВ	2020	https://www.iprbooks.hop.ru/101862.html
Фомичев А. Н.	Риск-менеджмент: Учебник для бакалавров. — 8-е изд., перераб.	Москва: Дашков и К	2021	https://ibooks.ru/reading.php?short=1&productid=378547
Чижик, В. П.	Риск-менеджмент	Омск: Омский государственный технический университет	2022	https://www.iprbooks.hop.ru/131224.html
6.1.2 Дополнительная учебная литература				
Ларионова, И. А.	Риск-менеджмент	Москва: Издательский Дом МИСиС	2017	http://www.iprbookshop.ru/98124.html
Чигиринова М. В.	Риск-менеджмент. Самостоятельная работа. Контрольные работы	СПб.: СПбГУПТД	2018	http://publish.sutd.ru/tp_ext_inf_publish.php?id=2018351

Барбаумов, В. Е., Рогов, М. А., Шукин, 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	http://www.iprbookshop.ru/96867.html
--	--	--------------------------------	------	---

6.2 Перечень профессиональных баз данных и информационно-справочных систем

1. База данных Минэкономразвития РФ «Информационные системы Министерства в сети Интернет» [Электронный ресурс]. URL: <http://economy.gov.ru/minec/about/systems/infosystems/>
2. База программных средств налогового учета [Электронный ресурс]. URL: <https://www.nalog.ru/rn39/program/>
3. Федеральный образовательный портал «Экономика Социология Менеджмент» [Электронный ресурс]. URL: <http://ecsocman.hse.ru>
4. Базы данных информационного портала Restko.ru (Информационные системы рынка рекламы, маркетинга, PR – Базы рынка рекламы [Электронный ресурс]. URL: <https://www.restko.ru/>

6.3 Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения

MicrosoftOfficeProfessional

Microsoft Windows

1С:Предприятие 8. Комплект для обучения в высших и средних учебных заведениях. Продажа по договору с учебными заведениями об использовании в учебном процессе по заявкам

6.4 Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине

Аудитория	Оснащение
Лекционная аудитория	Мультимедийное оборудование, специализированная мебель, доска
Учебная аудитория	Специализированная мебель, доска