


Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф - Рабочая программа дисциплины		

УТВЕРЖДЕНО
решением Ученого совета ИФФВТ
от 24 мая 2023 г. протокол № 10

Председатель _____ (Рыбин В.В.)
(подпись, расшифровка подписи)



РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина	Риск-менеджмент
Факультет	Инженерно-физический факультет высоких технологий
Кафедра	Кафедра инженерной физики
Курс	4

Направление (специальность): **27.03.02 «Управление качеством» (бакалавриат)**
(код направления (специальности), полное наименование)

Направленность (профиль/специализация): **Управление качеством в производственно-технологических комплексах**
(полное наименование)

Форма обучения: **очная**
(очная, заочная, очно-заочная (указать только те, которые реализуются))

Дата введения в учебный процесс УлГУ: **«01» сентября 2023 г.**


Программа актуализирована на заседании кафедры: протокол № _____ от _____ 20__ г.


Программа актуализирована на заседании кафедры: протокол № _____ от _____ 20__ г.

Программа актуализирована на заседании кафедры: протокол № _____ от _____ 20__ г.

Сведения о разработчиках:

ФИО	Кафедра	Должность, ученая степень, звание
Андреева Е.В.	Кафедра инженерной физики	к.э.н.

СОГЛАСОВАНО
Заведующий кафедрой ИФ
 _____ /С.Б. Бакланов/ <i>(подпись)</i> <i>(ФИО)</i>
«16_»мая 2023 г.

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф - Рабочая программа дисциплины		

1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Цели освоения дисциплины:

- формирование у студента теоретических знаний и практических навыков в области управления рисками.

Задачи освоения дисциплины:

- изучение основных теоретических концепций управления рисками;
- изучение подходов к прогнозированию изменений внешней и внутренней среды, а так же методических подходов к корректировке планов развития и проектной документации с учетом рисков;
- изучение методов мониторинга внешней и внутренней среды;
- изучение систем управления рисками;
- изучение систем страхования от рисков;
- изучение систем ухода от рисков и уменьшения воздействия рисков.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП

Дисциплина относится к обязательной части Блока 1 «Дисциплины (модули)» основной профессиональной образовательной программы (ОПОП) бакалавриата 27.03.02 «Управление качеством», устанавливаемой вузом. Она является одной из дисциплин, формирующих общепрофессиональные и профессиональные компетенции обучающегося, Дисциплина нацелена на приобретение обучающимися знаний о методах управления рисками, а так же о системе управления рисками организации. Дисциплина дает знания о методах учета рисков в деятельности организации, на основе которых строится дальнейшее обучение.

Дисциплина читается в 7 -ом семестре 4 -ого курса студентам очной формы обучения. Для ее успешного освоения необходимы знания таких дисциплин, как:


- Управление качеством
- Квалиметрия
- Управление процессами
- Маркетинг
- Основы надежности технических систем
- Основы статистического контроля
- Общая логистика
- Внутрипроизводственная логистика
- Методы и средства контроля, измерений и испытаний
- Аудит качества
- Безопасность развития предприятия
- Взаимозаменяемость
- Единая система допусков и посадок
- Профессиональная этика аудитора

А так же практик:

- Организационно-управленческая практика
- Практика по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности

Результаты освоения дисциплины будут необходимы для дальнейшего процесса обучения в рамках поэтапного формирования компетенций при изучении следующих специальных дисциплин:

- Управление персоналом


Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф - Рабочая программа дисциплины		

- Исследование операций
- а также для прохождения преддипломной практики, подготовке к процедуре защиты и защите выпускной квалификационной работы.

3. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ), СООТНЕСЕННЫХ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОПОП

Изучение дисциплины должно быть направлено на формирование таких компетенций как:

Код и наименование реализуемой компетенции	Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с индикаторами достижения компетенций
ОПК-10 Способен оценивать и учитывать риски при управлении качеством	Знать: принципы контроля рисков внешней и внутренней среды Уметь: осуществлять мониторинг рисков Владеть: методами контроля рисков
ПК-2 способностью применять проблемно-ориентированные методы анализа, синтеза и оптимизации процессов обеспечения качества	Знать: основные характеристики рисков, способы оценки характеристик риска Уметь: использовать методы анализа рисков и прогнозов развития среды и выбирать оптимальное решение Владеть: навыками постановки проблемы, разработки альтернатив и выбора альтернатив при принятии рискованных решений
ПК-3 способностью осуществлять мониторинг и владеть методами оценки прогресса в области улучшения качества	Знать: источники ущерба и дополнительных затрат, возникающих в результате реализации рискованных решений Уметь: оценивать ущерб и дополнительные затраты, возникающие в результате реализации рискованных решений Владеть: навыками анализа экономических рисков, а так же стоимостных характеристик риска
ПК-6 способностью идти на оправданный риск при принятии решений	Знать: критерии допустимости риска, типовые вознаграждения за риск Уметь: принимать рискованные решения, преодолевая негативные ощущения Владеть: методами снижения отрицательных

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф - Рабочая программа дисциплины		

	последствий риска
--	-------------------

4. ОБЩАЯ ТРУДОЕМКОСТЬ ДИСЦИПЛИНЫ

4.1. Объем дисциплины в зачетных единицах (всего) – 2 ЗЕТ.


4.2. Объем дисциплины по видам учебной работы (в часах): -72.

Вид учебной работы	Количество часов (форма обучения – очная)								
	Всего по плану	в т.ч. по семестрам							
		1	2	3	4	5	6	7	8
Контактная работа обучающихся с преподавателем в соответствии с УП	36	-	-	-	-	-	-	36	-
Аудиторные занятия:									
• лекции	18	-	-	-	-	-	-	18	-
• семинары и практические занятия	18	-	-	-	-	-	-	18	-
• лабораторные работы, практикумы	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Самостоятельная работа	36	-	-	-	-	-	-	36	-
Форма текущего контроля знаний и контроля самостоятельной работы: тестирование, контр. работа, коллоквиум, реферат и др. (не менее 2 видов)	решение задач, устный опрос	-	-	-	-	-	-	решение задач, устный опрос	-
Курсовая работа	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Виды промежуточной аттестации (экзамен, зачет)	Зачет	-	-	-	-	-	-	Зачет	-
Всего часов по дисциплине	72	-	-	-	-	-	-	72	-

4.3. Содержание дисциплины (модуля). Распределение часов по темам и видам учебной работы:

Форма обучения – очная

Название разделов и тем	Всего	Виды учебных занятий					Форма текущего контроля знаний
		Аудиторные занятия			Занятия в интерактивной форме	Самостоятельная работа	
		лекции	практические занятия, семинары	лабораторные работы, практикумы			
1	2	3	4	5	6	7	8
1. Понятие и	8	2	2	-	-	4	устный

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф - Рабочая программа дисциплины		

характеристика рисков							опрос
2. Принятия рисковых решений	8	2	2	-	-	4	решение задач, устный опрос
3. Критерии принятия рисковых решений	8	2	2	-	-	4	решение задач,
4. Принятия рисковых решений с помощью дерева решений	8	2	2	-	-	4	решение задач, устный опрос
5. Прогнозирование изменений внешней и внутренней среды	16	4	4	-	-	8	решение задач, устный опрос
6. Планирование с учетом рисков	8	2	2	-	-	4	решение задач, устный опрос
7. Методы защиты от рисков.	8	2	2	-	-	4	решение задач, устный опрос
8. Организация работы по риск-менеджменту в фирме	8	2	2	-	-	4	устный опрос
ИТОГО:	72	18	18	-	-	36	-

5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Тема 1. Понятие и характеристика рисков

Понятие неопределенности внешней среды. Предпринимательское и приростное поведение. Понятие рисков с точки зрения экономики и с точки зрения управления. Спекулятивные риски. Риск-менеджмент в системе управления предприятием. Виды рисков. Характеристики рисков: вероятность, ущерб (прибыль), степень, уровень, правомерность рисков. Концепция соотношения риска и доходности. Факторы риска, классификация факторов риска.


Тема 2. Принятия рисковых решений

Этапы принятия рисковых решений: анализ внешней и внутренней среды, выявление проблемы, разработка альтернатив поведения, выбор альтернативы в зависимости от желания рисковать лица принимающего решения, критерии выбора рискового решения, построение прогнозов с учетом риска, избежание риска, страхование от риска. Влияние лица, принимающего решение на выработанное решение.

Тема 3. Критерии принятия рисковых решений

Математическое ожидание прибыли (убытка). Стандартное отклонение как способ оценки риска. Интегральная оценка риска. Критерии оценки рисковых решений: Вальда, Сэвиджа, Гурвица, Лапласа, критерий оптимизма.

Тема 4. Принятия рисковых решений с помощью дерева решений

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф - Рабочая программа дисциплины		

Факторы, влияющие на принятие решения. Последовательность построения дерева решений. Дерево решений как способ кратко записать прогноз и ключевые факторы. Расчет ожидаемой прибыли (убытков) в узлах. Принятие решения с помощью дерева решений.

Тема 5. Прогнозирование изменений внешней и внутренней среды

Причины возникновения неопределенности при принятии решений. Типы неопределенности. Снижение неопределенности внешней среды с помощью планирования. Снижение неопределенности внешней среды с помощью прогнозирования. Статистические методы прогнозирования. Экспертные методы прогнозирования. Смешанные методы прогнозирования.

Тема 6. Планирование с учетом рисков

Отражение прогнозов риска и методов нивелирования риска в бизнес-плане. Интегральная оценка риска и сфера ее применения в качестве корректора бизнес-планов. Дисконтирование как метод учета рисков. Факторный анализ и сценарии развития компании.

Тема 7. Методы защиты от рисков.

Страхование в бизнесе: страхование ключевых персон, страхование имущества, страхование ответственности. Хеджирование. Распределение рисков. Уход от рисков.

Тема 8. Организация работы по риск-менеджменту в фирме

Принятие решения о необходимости отдельной службы анализа и учета рисков. Распределение аналитических задач риск-менеджмента внутри отдела. Организация системы мониторинга рисков. Оценка эффективности деятельности по управлению рисками.

Лекционный курс предполагает систематизированное изложение основных вопросов учебной дисциплины и должен давать наибольший объем информации и обеспечивать более глубокое понимание учебных вопросов при значительно меньших затратах времени, чем это требуется большинству студентов на самостоятельное изучение материала.

6. ТЕМЫ ПРАКТИЧЕСКИХ И СЕМИНАРСКИХ ЗАНЯТИЙ

Тема 1. Понятие и характеристика рисков


ЗАНЯТИЕ 1

Форма проведения – семинар, дискуссия.

Вопросы по теме (для обсуждения на занятии, для самостоятельного изучения).

1. Различия предпринимательского и приростного стиля поведения.
2. Происхождение и трансформация понятия рисков.
3. Риск-менеджмент в системе управления предприятием
4. Необходимость классификации рисков, методические подходы к классификации рисков.
5. Влияние соотношения риска и доходности на отраслевую структуру в России и мире.
6. Специфические факторы риска для ведения бизнеса в России.

Тема 2. Принятие рискованных решений

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф - Рабочая программа дисциплины		

ЗАНЯТИЕ 2

Форма проведения – семинар, дискуссия, практическое занятие.

Вопросы по теме (для обсуждения на занятии, для самостоятельного изучения).

1. Соотнесение этапов принятия рискованных решений с этапами принятия управленческих решений.
 1. Особенности управления рисками.
 2. В каких случаях не целесообразно выделять ресурсы на учет и анализ рисков. Соотношение рисков и этапов жизненного цикла организации.
 3. Какие факторы риска наиболее характерны для стадии упадка в жизненном цикле организации, продукции, услуг?
 4. Влияние лица, принимающего решение на выработанное решение.

Задача

(З-1)

Составьте классификацию представленных ниже рисков. Поэтапно опишите Ваши действия.

- договорные риски, т.е. риски, связанные с ошибками и упущениями при оформлении договоров (невозможность защитить права фирмы).
- изменение курсов валют, изменение процентных ставок,
- изменение ставок и условий кредитов
- компетенция руководства и исполнителей,
- компетенция сотрудников, отвечающих за финансовое обеспечение,
- риск изменения нормативов, регламентирующих отдельные виды деятельности (бухучет, транспорт, трудовое законодательство и т.д.)
- риск изменения потребительских предпочтений;
- риск отраслевых изменений,
- риск роста конкуренции.

Тема 3. Критерии принятия рискованных решений

ЗАНЯТИЕ 3

Форма проведения – практическое занятие.

Задачи

(З-2)

Сравните 3 проекта и выберите один из них для осуществления инвестиций.

Обоснуйте решение.

проект	вероятность наступления рисков	возможный ущерб от рисков, %	возможная прибыль по проекту, тыс. руб
1	0,9	10	1500
2	0,05	30	1200
3	0,1	20	1700


(З-3)

Компания планирует закупать и продавать некоторый продукт. Спрос на этот продукт за день может быть равен 0, 1, 2, 3, 4, 5 штук. Стоимость закупки товара 40 руб. Стоимость продажи - 60 руб. Если товар не будет реализован его можно вернуть поставщику по цене 30 рублей за штуку.

Какое количество товаров стоит закупать? Решите задачу методом минимакса.

(З-4)

Компания планирует закупать и продавать некоторый продукт. Спрос на этот продукт за день может быть равен 0, 1, 2, 3, 4, 5 штук. Стоимость закупки товара 40 руб. Стоимость продажи - 60 руб. Если товар не будет реализован его можно вернуть

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф - Рабочая программа дисциплины		

поставщику по цене 30 рублей за штуку.

Какое количество товаров стоит закупать? Решите задачу методом максимина.

(3-5)

Компания планирует закупать и продавать некоторый продукт. Спрос на этот продукт за день может быть равен 0, 1, 2, 3, 4, 5 штук. Стоимость закупки товара 40 руб. Стоимость продажи - 60 руб. Если товар не будет реализован его можно вернуть поставщику по цене 30 рублей за штуку.

Какое количество товаров стоит закупать? Решите задачу методом максимакса.

(3-6)

Компания планирует закупать и продавать некоторый продукт. Спрос на этот продукт за день может быть равен 0, 1, 2, 3, 4, 5 штук. Стоимость закупки товара 40 руб. Стоимость продажи - 60 руб. Если товар не будет реализован его можно вернуть поставщику по цене 30 рублей за штуку.

Какое количество товаров стоит закупать? Решите задачу, используя критерий Гурвица.

(3-7)

Компания планирует закупать и продавать некоторый продукт. Спрос на этот продукт за день может быть равен 0, 1, 2, 3, 4, 5 штук. Стоимость закупки товара 40 руб. Стоимость продажи - 60 руб. Если товар не будет реализован его можно вернуть поставщику по цене 30 рублей за штуку.

Какое количество товаров стоит закупать? Решите задачу, используя критерий Лапласа.

(3-8)

Компания планирует закупать и продавать некоторый продукт. Спрос на этот продукт за день может быть равен 0, 1, 2, 3, 4 штук. Наблюдения показывают, что спрос 0 был в 1 случае из 10, 1 в 2 случаях из 10, 3 в 2 случаях из 10, 3 в 3 случаях из 10, 4 в 2 случаях из 10. Стоимость закупки товара 40 руб. Стоимость продажи - 60 руб. Если товар не будет реализован его можно вернуть поставщику по цене 30 рублей за штуку.

Какое количество товаров стоит закупать? Решите задачу, используя математическое ожидание прибыли.

Тема 4. Принятия рискованных решений с помощью дерева решений

ЗАНЯТИЕ 4

Форма проведения – семинар, практическое занятие.


Вопросы по теме (для обсуждения на занятии, для самостоятельного изучения).

1. Зависимость решения от лица, принимающего решения.
2. Потребность в схематичном описании последовательности принятия решений.
3. Как выделить ключевые факторы, влияющие на решение?
4. Преимущества модели дерева решений.
5. Сходна ли модель с другими «деревьями», применяемыми для принятия управленческих решений.
6. Как еще можно использовать дерево решений, помимо принятия рискованных решений?

Задача

(3-9)

Производственная фирма задумывается о строительстве собственных торговых площадей, при этом есть вариант строительства небольшого магазина, стоимость постройки 1,5 млн руб. и торгового центра, стоимость постройки 7 млн. руб. В случае большого спроса на продукцию планируется прибыль от магазина 4 млн., от торгового

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф - Рабочая программа дисциплины		

центра 14 млн. в случае маленького спроса маленький магазин принесет прибыль 3 млн. руб., большой 4 млн. Вероятность большого спроса составляет 0,3. выберите вариант действия, используя дерево решений.

Тема 5. Прогнозирование изменений внешней и внутренней среды

ЗАНЯТИЕ 5

Форма проведения – практическое занятие.

Задача

(3-10)

1. Составьте классификацию факторов рисков предприятия

1	внутренний контроль качества не позволит выявить критические дефекты
2	договорные риски, т.е. риски, связанные с ошибками и упущениями при оформлении договоров (невозможность защитить права фирмы).
3	изменение курсов валют, изменение процентных ставок
4	изменение ставок и условий кредитов
5	компетенция руководства и исполнителей,
6	компетенция сотрудников, отвечающих за финансовое обеспечение,
7	риск изменения нормативов, регламентирующих отдельные виды деятельности (бухучет, транспорт, трудовое законодательство и т.д.)
8	риск изменения потребительских предпочтений;
9	риск недостижения стратегических целей;
10	риск низкого качества исследований, служащих основой для принятия стратегических решений.
11	риск отраслевых изменений,
12	риск принятия неправильных стратегических решений.
13	риск роста конкуренции;
14	риск связанный с компетенцией руководства,
15	риски гражданской ответственности, т.е. связанные с исками о причинении вреда со стороны третьих лиц, в т.ч. риски ответственности производителя;
16	риски изменения финансовой конъюнктуры;
17	риски контактов с государственными органами (регистрация, лицензирование, акционерные дела, претензии налоговых и антимонопольных органов, уголовные преследования и т.д.);
18	риски неправильного выполнения производственных операций (ошибки, упущения, сбои и т.д.)
19	риски неправильного планирования и осуществления финансовой деятельности фирмы.
20	риски неправильной организации бизнес-процессов, технологических процессов
21	структура портфеля
22	трудовая дисциплина


2. Присвойте полученным группам или отдельным факторам дополнительные характеристики, которые Вы сочтете уместными. Например: предсказуемый, непредвиденный.

ЗАНЯТИЕ 6

Форма проведения – семинар, дискуссия, практическое занятие.

Вопросы по теме (для обсуждения на занятии, для самостоятельного изучения).

1. Зависимость метода прогнозирования от уровня неопределенности внешней среды.

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф - Рабочая программа дисциплины		

2. Прогнозирование и поведение фирмы в турбулентной среде.
3. Типы неопределенности внешней среды в Российской экономике в целом и в отраслях.

Задачи

(З-11)

Постройте регрессионную модель:

X	1	2	3	4	1,6
Y	30	7	8	1	?

(З-12)

Некоторая фирма занимается поставками различных грузов на короткие расстояния внутри города. Оценить стоимость таких услуг, зависящую от затрачиваемого на поставку времени. В качестве наиболее важного фактора, влияющего на время поставки, выбрано пройденное расстояние. Были собраны исходные данные о десяти поставках

Расстояние, миль	3,5	2,4	4,9	4,2	3,0	1,3	1,0	3,0	1,5	4,1
Время, мин	16	13	19	18	12	11	8	14	9	16

Определите характер зависимости между расстоянием и затраченным временем, используя мастер диаграмм MS Excel, проанализируйте применимость метода наименьших квадратов, постройте уравнение регрессии, используя метод наименьших квадратов, проанализируйте силу регрессионной связи. Проведите регрессионный анализ, используя режим работы "Регрессия" в MS Excel и сравните с результатами, полученными ранее. Сделайте прогноз времени поездки на 2 мили. Посчитать и построить графически меру ошибки регрессионной модели используя табличный процессор Excel.

Тема 6. Планирование с учетом рисков

ЗАНЯТИЕ 7

Форма проведения – семинар, дискуссия.

Вопросы по теме (для обсуждения на занятии, для самостоятельного изучения).

1. Способы отражения прогнозов риска и методов нивелирования риска в бизнес-плане.
2. Сферы применения сценариев развития компании.

Задача

(З-13)

Составьте 4 варианта финансового плана (2 варианта наиболее вероятных планов). Рассчитайте интегральную оценку риска. В прошлом году прибыль 20 млн., в текущем планируется 26 млн.

Факторы риска	Вероятность риска	Ущерб, % от прибыли
Ф1	0,5	10
Ф2	0,2	50
Ф3	0,1	18
Ф4	0,4	6
Ф5	0,03	8
Ф6	0,02	4


Тема 7. Методы защиты от рисков.

ЗАНЯТИЕ 8

Форма проведения – семинар, дискуссия.

Вопросы по теме (для обсуждения на занятии, для самостоятельного изучения).

1. Развитие российского рынка страхования, условия, выгодность коммерческого страхования в России.

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф - Рабочая программа дисциплины		

2. Защита от рисков при спекуляции активами и долгосрочном приобретении активов.
3. Примеры распределения рисков в корпоративной практике инвестирования.

Тема 8. Организация работы по риск-менеджменту в фирме

ЗАНЯТИЕ 9

Форма проведения – семинар, дискуссия.

Вопросы по теме (для обсуждения на занятии, для самостоятельного изучения).

1. Взаимосвязь размера организации и потребности в организации отдельной структуры, занимающейся учетом рисков.
2. Как оценить работу эффективность работы персонала в департаменте, анализирующем риски.
3. При наличии отдела, занимающегося анализом рисков, кто принимает рисковые решения.

Практические (семинарские занятия) проводятся в целях закрепления лекционного курса и детализации наиболее важных и сложных для понимания теоретических разделов. Кроме того, занятия направлены на формирование умений на практике использовать методы, рассматриваемые в ходе лекционных занятий.

Основной формой проведения практических занятий является проработка лекционного материала, включая обсуждение вопросов по изучаемой теме, обсуждение непонятого обучающимися материала, решение заданий, помогающих закрепить материал, ответы на дополнительные вопросы студентов. В обязанности преподавателя входят: оказание методической помощи и консультирование студентов по соответствующим темам курса.

Активность на практических занятиях оценивается по следующим критериям:

- правильность ответов и настойчивость студента в поиске ответов на заданные вопросы, оригинальность и правильность суждений,
- решение задач и заданий, способность правильно выбрать подход к решению задач;
- участие в обсуждениях и дискуссиях.

7. ЛАБОРАТОРНЫЕ РАБОТЫ, ПРАКТИКУМЫ


Данный вид работы не предусмотрен УП.

8. ТЕМАТИКА КУРСОВЫХ, КОНТРОЛЬНЫХ РАБОТ, РЕФЕРАТОВ

Данный вид работы не предусмотрен УП.

9. ПЕРЕЧЕНЬ ВОПРОСОВ К ЗАЧЕТУ

1. Понятие неопределенности среды. Типы неопределенности среды.
2. Предпринимательское и приростное поведение.
3. Понятие рисков с точки зрения экономики и с точки зрения управления.
4. Риск-менеджмент в системе управления предприятием
5. Виды рисков.
6. Характеристики рисков.
7. Концепция соотношения риска и доходности.

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф - Рабочая программа дисциплины		


8. Факторы риска и их классификация.
9. Этапы принятия рискованных решений.
10. Влияние лица, принимающего решение на выработанное решение.
11. Математическое ожидание прибыли (убытка) – понятие, способ расчета.
12. Стандартное отклонение как способ оценки риска.
13. Нахождение и применение интегральной оценки риска.
14. Критерии оценки рискованных решений: Вальда.
15. Критерии оценки рискованных решений: Сэвиджа.
16. Критерии оценки рискованных решений: Гурвица.
17. Критерии оценки рискованных решений: Лапласа.
18. Критерии оценки рискованных решений: критерий оптимизма.
19. Факторы, влияющие на принятие решения.
20. Последовательность построения дерева решений.
21. Расчет ожидаемой прибыли (убытков) в узлах дерева решений.
22. Понятие планирования и прогнозирования и их роль в снижении неопределенности внешней среды.
23. Статистические методы прогнозирования.
24. Сфера применения статистических методов прогнозирования.
25. Экспертные методы прогнозирования.
26. Сфера применения экспертных методов прогнозирования.
27. Смешанные методы прогнозирования.
28. Сфера применения смешанных методов прогнозирования.
29. Отражение прогнозов риска и методов снижения отрицательных последствий риска в бизнес-плане.
30. Интегральная оценка риска и сфера ее применения в качестве корректора бизнес-планов.
31. Дисконтирование как метод учета рисков.
32. Способы определения ставки дисконтирования.
33. Факторный анализ и сценарии развития компании.
34. Страхование топ-менеджеров как мера защиты от риска
35. Страхование имущества как мера защиты от риска
36. Страхование ответственности, как мера защиты от риска
37. Хеджирование как мера снижения от риска и сфера его применения.
38. Распределение рисков.
39. Уход от рисков.
40. Принятие решения о необходимости отдельной службы анализа и учета рисков.
41. Распределение аналитических задач риск-менеджмента внутри отдела.
42. Организация системы мониторинга рисков.
43. Наиболее влиятельные Оценка эффективности деятельности по управлению рисками.

10. САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА СТУДЕНТОВ


Содержание, требования, условия и порядок организации самостоятельной работы обучающихся с учетом формы обучения определяются в соответствии с «Положением об организации самостоятельной работы обучающихся», утвержденным Ученым советом УлГУ (протокол №8/268 от 26.03.2019 г.).

Форма обучения – очная.

Название разделов и тем	Вид самостоятельной работы	Объем	Форма
-------------------------	----------------------------	-------	-------

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф - Рабочая программа дисциплины		

	<i>(проработка учебного материала, решение задач, реферат, доклад, контрольная работа, подготовка к сдаче зачета, экзамена и др.)</i>	в часах	контроля <i>(проверка решения задач, реферата и др.)</i>
1. Понятие и характеристика рисков	<ul style="list-style-type: none"> • Проработка учебного материала с использованием ресурсов учебно-методического и информационного обеспечения дисциплины; • Подготовка к сдаче зачета 	4	устный опрос, зачет
2. Принятия рискованных решений	<ul style="list-style-type: none"> • Проработка учебного материала с использованием ресурсов учебно-методического и информационного обеспечения дисциплины; • Решение задач; • Подготовка к сдаче зачета 	4	устный опрос, проверка решения задач зачет
3. Критерии принятия рискованных решений	<ul style="list-style-type: none"> • Проработка учебного материала с использованием ресурсов учебно-методического и информационного обеспечения дисциплины; • Решение задач; • Подготовка к сдаче зачета 	4	проверка решения задач зачет
4. Принятия рискованных решений с помощью дерева решений	<ul style="list-style-type: none"> • Проработка учебного материала с использованием ресурсов учебно-методического и информационного обеспечения дисциплины; • Решение задач; • Подготовка к сдаче зачета 	4	устный опрос, проверка решения задач зачет
5. Прогнозирование изменений внешней и внутренней среды	<ul style="list-style-type: none"> • Проработка учебного материала с использованием ресурсов учебно-методического и информационного обеспечения дисциплины; • Решение задач; • Подготовка к сдаче зачета 	8	устный опрос, проверка решения задач зачет
6. Планирование с учетом рисков	<ul style="list-style-type: none"> • Проработка учебного материала с использованием ресурсов учебно-методического и информационного обеспечения дисциплины; • Решение задач; • Подготовка к сдаче зачета 	4	устный опрос, проверка решения задач зачет
7. Методы защиты от рисков.	<ul style="list-style-type: none"> • Проработка учебного материала с использованием ресурсов учебно-методического и информационного обеспечения дисциплины; • Подготовка к сдаче зачета 	4	устный опрос, зачет
8. Организация работы по риск-менеджменту в фирме	<ul style="list-style-type: none"> • Проработка учебного материала с использованием ресурсов учебно-методического и информационного 	4	устный опрос, зачет

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф - Рабочая программа дисциплины		

	обеспечения дисциплины; • Подготовка к сдаче зачета		
--	--	--	--

11. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

а) Список рекомендуемой литературы

основная:

1. Шкурко Валентина Евгеньевна. Управление рисками проекта : Учебное пособие для вузов / Шкурко В. Е. ; под науч. ред. Гребенкина А.В. - 2-е изд. - Москва : Юрайт, 2021. - 182 с. - (Высшее образование). - URL: <https://urait.ru/bcode/473824> (дата обращения: 26.10.2021). - Режим доступа: Электронно-библиотечная система Юрайт, для авториз. пользователей. - Электрон. дан. - ISBN 978-5-534-05843-7 : 469.00.

2. Воронцовский Алексей Владимирович. Управление рисками : Учебник и практикум для вузов / Воронцовский А. В. - 2-е изд. - Москва : Юрайт, 2021. - 485 с. - (Высшее образование). - URL: <https://urait.ru/bcode/469401> (дата обращения: 26.10.2021). - Режим доступа: Электронно-библиотечная система Юрайт, для авториз. пользователей. - Электрон. дан. - ISBN 978-5-534-12206-0 : 1359.00.

дополнительная:

1. Пименов Николай Анатольевич. Управление финансовыми рисками в системе экономической безопасности : учебник и практикум для вузов / Н. А. Пименов. - 3-е изд. ; пер. и доп. - Москва : Юрайт, 2023. - 353 с. - (Высшее образование). - URL: <https://urait.ru/bcode/530834> (дата обращения: 26.06.2023). - Режим доступа: Электронно-библиотечная система Юрайт, для авториз. пользователей. - Электрон. дан. - ISBN 978-5-534-16342-1 : 1379.00.

2. Вяткин Валерий Нурович. Риск-менеджмент : Учебник / Вяткин В. Н., Гамза В. А., Маевский Ф. В. - 2-е изд. ; пер. и доп. - Москва : Юрайт, 2021. - 365 с. - (Высшее образование). - URL: <https://urait.ru/bcode/469020> (дата обращения: 26.10.2021). - Режим доступа: Электронно-библиотечная система Юрайт, для авториз. пользователей. - Электрон. дан. - ISBN 978-5-9916-3502-8 : 1049.00.


3. Воронцовский Алексей Владимирович. Управление инвестициями: инвестиции и инвестиционные риски в реальном секторе экономики : Учебник и практикум для вузов / Воронцовский А. В. - Москва : Юрайт, 2021. - 391 с. - (Высшее образование). - URL: <https://urait.ru/bcode/476569> (дата обращения: 26.10.2021). - Режим доступа: Электронно-библиотечная система Юрайт, для авториз. пользователей. - Электрон. дан. - ISBN 978-5-534-12441-5 : 1119.00.

учебно-методическая:

1. Андреева Е. В. Методические указания для самостоятельной работы студентов по дисциплине «Риск-менеджмент» для направления 27.03.02 «Управление качеством» всех форм обучения / УлГУ, ИФФВТ. - 2019. - Загл. с экрана. - Неопубликованный ресурс. - Электрон. текстовые дан. (1 файл : 278 КБ). - Режим доступа: ЭБС УлГУ. - Текст : электронный. / ISBN 0_42028.

Согласовано:

Вед. Специалист ООП НБ УлГУ Чамеева А.Ф.  /2023

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф - Рабочая программа дисциплины		

б) Программное обеспечение:

- 1) ОС Альт Рабочая станция 8
- 2) СПС Консультант Плюс
- 3) Система «Антиплагиат.ВУЗ»
- 4) ОС Microsoft Windows
- 5) Microsoft Office 2016
- 6) МойОфис Стандартный

в) в)Профессиональные базы данных, информационно-справочные системы:

1. Электронно-библиотечные системы:

1.1. Цифровой образовательный ресурс IPRsmart : электронно-библиотечная система : сайт / ООО Компания «Ай Пи Ар Медиа». - Саратов, [2023]. – URL: <http://www.iprbookshop.ru>. – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. - Текст : электронный.

1.2. Образовательная платформа ЮРАЙТ : образовательный ресурс, электронная библиотека : сайт / ООО Электронное издательство «ЮРАЙТ». – Москва, [2023]. - URL: <https://urait.ru>. – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. - Текст : электронный.

1.3. База данных «Электронная библиотека технического ВУЗа (ЭБС «Консультант студента») : электронно-библиотечная система : сайт / ООО «Политехресурс». – Москва, [2023]. – URL: <https://www.studentlibrary.ru/cgi-bin/mb4x>. – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. – Текст : электронный.

1.4. Консультант врача. Электронная медицинская библиотека : база данных : сайт / ООО «Высшая школа организации и управления здравоохранением-Комплексный медицинский консалтинг». – Москва, [2023]. – URL: <https://www.rosmedlib.ru>. – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. – Текст : электронный.

1.5. Большая медицинская библиотека : электронно-библиотечная система : сайт / ООО «Букап». – Томск, [2023]. – URL: <https://www.books-up.ru/ru/library/> . – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. – Текст : электронный.

1.6. ЭБС Лань : электронно-библиотечная система : сайт / ООО ЭБС «Лань». – Санкт-Петербург, [2023]. – URL: <https://e.lanbook.com>. – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. – Текст : электронный.

1.7. ЭБС Znanium.com :электронно-библиотечная система : сайт / ООО «Знаниум». - Москва, [2023]. - URL: <http://znanium.com> . – Режим доступа : для зарегистрир. пользователей. - Текст : электронный.

2. КонсультантПлюс [Электронный ресурс]: справочная правовая система. / ООО «Консультант Плюс» - Электрон.дан. - Москва :КонсультантПлюс, [2023].

3. Базы данных периодических изданий:

3.1. eLIBRARY.RU: научная электронная библиотека : сайт / ООО «Научная Электронная Библиотека». – Москва, [2023]. – URL: <http://elibrary.ru>. – Режим доступа : для авториз. пользователей. – Текст : электронный

3.2. Электронная библиотека «Издательского дома «Гребенников» (Grebinnikon) : электронная библиотека / ООО ИД «Гребенников». – Москва, [2023]. – URL: <https://id2.action-media.ru/Personal/Products>. – Режим доступа : для авториз. пользователей. – Текст : электронный.

4. Федеральная государственная информационная система «Национальная электронная библиотека»: электронная библиотека : сайт / ФГБУ РГБ. – Москва, [2023]. – URL:<https://нэб.рф>. – Режим доступа : для пользователей научной библиотеки. – Текст : электронный.

5. Российское образование: федеральный портал / учредитель ФГАУ «ФИЦТО». – URL: <http://www.edu.ru>. – Текст : электронный.

