

МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ АВТОНОМНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ ТРАНСПОРТА»

УТВЕРЖДАЮ:

Директор ИЭФ



Ю.И. Соколов

26 июня 2019 г.

Кафедра «Экономика транспортной инфраструктуры и управление
строительным бизнесом»

Автор Капустина Надежда Валерьевна, д.э.н., доцент

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Теория риска

Направление подготовки: 38.03.02 – Менеджмент

Профиль: Управление проектами

Квалификация выпускника: Бакалавр

Форма обучения: очная

Год начала подготовки 2019

Одобрено на заседании Учебно-методической комиссии института Протокол № 8 25 июня 2019 г. Председатель учебно-методической комиссии  М.В. Ишханян	Одобрено на заседании кафедры Протокол № 17 24 июня 2019 г. Заведующий кафедрой  Д.А. Мачерет
---	---

Рабочая программа учебной дисциплины (модуля) в виде
электронного документа выгружена из единой
корпоративной информационной системы управления
университетом и соответствует оригиналу

Простая электронная подпись, выданная РУТ (МИИТ)
ID подписи: 3344
Подписал: Заведующий кафедрой Мачерет Дмитрий
Александрович
Дата: 24.06.2019

Москва 2019 г.

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Целями освоения учебной дисциплины «Теория риска» являются: формирование у студентов теоретических знаний и практических навыков в области управления рисками, умение применять компетенции, связанные с пониманием фундаментальной сущности и общих закономерностей, характеризующих риски в экономике в целом и в строительном бизнесе в частности, а также при осуществлении иной деятельности в профессиональной сфере, включая научно-исследовательскую и преподавательскую работу.

Основными видами формируемых у обучающихся компетенций в области управления рисками, являются способности проводить анализ рыночных и специфических рисков и использовать его результаты для принятия управленческих решений

2. МЕСТО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОП ВО

Учебная дисциплина "Теория риска" относится к блоку 1 "Дисциплины (модули)" и входит в его вариативную часть.

2.1. Наименования предшествующих дисциплин

Для изучения данной дисциплины необходимы следующие знания, умения и навыки, формируемые предшествующими дисциплинами:

2.1.1. Маркетинг:

Знания: принципы работы в глобальных компьютерных сетях

Умения: оценивать экономические и социальные условия осуществления предпринимательской деятельности

Навыки: способностью оценивать воздействие макроэкономической среды на функционирование организаций и органов государственного и муниципального управления, выявлять и анализировать рыночные и специфические риски

2.1.2. Математика:

Знания: понятийный аппарат математического анализа, методы дифференциального и интегрального исчисления, необходимые для решения экономических задач.

Умения: применять методы математического анализа для решения экономических задач.

Навыки: основными понятиями математики, инструментарием математического анализа, навыками анализа реальных ситуаций и решения задач методами математического анализа.

2.1.3. Теория менеджмента:

Знания: функции менеджмента, основные задачи менеджера и подходы в управлении, методы принятия управленческих решений

Умения: подготавливать организационные и распорядительные документы, необходимые для создания новых предпринимательских структур

Навыки: формулировать обязанности и полномочия должностей, входящих в построенную структуру управления организацией

2.1.4. Экономика:

Знания: - основные понятия и модели микроэкономической теории, макроэкономики и мировой экономики;

Умения: -Проводить анализ отрасли, используя экономические модели.

Навыки: Экономическими методами анализа поведения потребителей, производителей, собственников ресурсов и государства.

2.2. Наименование последующих дисциплин

Результаты освоения дисциплины используются при изучении последующих учебных дисциплин:

2.2.1. Государственная итоговая аттестация

2.2.2. Инвестиционный анализ

2.2.3. Инженерно-экономическая экспертиза

**3. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ),
СООТНЕСЕННЫЕ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ
ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ**

В результате освоения дисциплины студент должен:

№ п/п	Код и название компетенции	Ожидаемые результаты
1	ПКС-7 Способен разрабатывать и обосновывать проектные решения, эффективно управлять процессом реализации проекта на различных стадиях жизненного цикла	ПКС-7.1 Имеет навыки разработки и обоснования элементов проектных решений. ПКС-7.2 Способен анализировать управляемые параметры инвестиционного проекта на различных стадиях жизненного цикла.

4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) В ЗАЧЕТНЫХ ЕДИНИЦАХ И АКАДЕМИЧЕСКИХ ЧАСАХ

4.1. Общая трудоемкость дисциплины составляет:

4 зачетных единиц (144 ак. ч.).

4.2. Распределение объема учебной дисциплины на контактную работу с преподавателем и самостоятельную работу обучающихся

Вид учебной работы	Количество часов	
	Всего по учебному плану	Семестр 7
Контактная работа	50	50,15
Аудиторные занятия (всего):	50	50
В том числе:		
лекции (Л)	34	34
практические (ПЗ) и семинарские (С)	16	16
Самостоятельная работа (всего)	94	94
ОБЩАЯ трудоемкость дисциплины, часы:	144	144
ОБЩАЯ трудоемкость дисциплины, зач.ед.:	4.0	4.0
Текущий контроль успеваемости (количество и вид текущего контроля)	ПК1, ПК2	ПК1, ПК2
Виды промежуточной аттестации (экзамен, зачет)	ЗаО	ЗаО

4.3. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам)

№ п/п	Семестр	Тема (раздел) учебной дисциплины	Виды учебной деятельности в часах/ в том числе интерактивной форме						Формы текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации
			Л	ЛР	ПЗ/ТП	КСР	СР	Всего	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
1	7	Тема 1 Понятие риска. Экономическая природа и содержание риска. Основные показатели и свойства риска. Причины возникновения и модификации риска.	2		2		14	18	, Контрольные вопросы (1-я неделя)
2	7	Тема 2 Классификация рисков. Классификация по: характеристике опасности; подверженности риску; уязвимости, взаимодействию с другими рисками, информации о риске, величине риска, размеру расходов. Специфические классификации рисков.	6		1		6	13	, Контрольные вопросы (2-я неделя)
3	7	Тема 3 Характеристика рисков в различных сферах бизнеса. Внешние (страновой, валютный, налоговый, форс-мажорных обстоятельств) и внутренние (организационный, ресурсный, портфельный, кредитный, инновационный) риски строительного бизнеса	4		2		12	18	
4	7	Тема 4 Методы анализа риска. Технократическое, экономическое и психологическое направления анализа риска	4		3		12	19	
5	7	Тема 5	4		4			8	ПК1

№ п/п	Семестр	Тема (раздел) учебной дисциплины	Виды учебной деятельности в часах/ в том числе интерактивной форме						Формы текущего контроля успеваемости и промежу- точной аттестации
			Л	ЛР	ПЗ/ТП	КСР	СР	Всего	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
		Методы оценки риска Аналитические, статистические и экспертные модели оценки риска							
6	7	Тема 6 Методы оценки риска Аналитические, статистические и экспертные модели оценки риска	4				14	18	
7	7	Тема 7 Основные принципы управления риском. Разукрупнение риска, распределение экспозиции во времени или пространстве, изоляция синергетических факторов.	6		2		12	20	
8	7	Тема 8 Стратегия управления рисками. Статическая и динамическая концепция управления рисками	2		1		12	15	ПК2
9	7	Тема 9 Психология риска. Склонность к предпринимательскому рisku. Импульсивность, решительность, фатализм – как факторы принятия рискованных решений. Минимизация риска в неопределённой ситуации.	2		1		12	15	
10	7	Зачет						0	ЗаО
11		Всего:	34		16		94	144	

4.4. Лабораторные работы / практические занятия

Лабораторные работы учебным планом не предусмотрены.

Практические занятия предусмотрены в объеме 16 ак. ч.

№ п/п	№ семестра	Тема (раздел) учебной дисциплины	Наименование занятий	Всего часов/ из них часов в интерактивной форме
1	2	3	4	5
1	7	Тема: Понятие риска. Экономическая природа и содержание риска. Основные показатели и свойства риска. Причины возникновения и модификации риска.	Экономическая природа и содержание риска. Основные показатели и свойства риска. Причины возникновения и модификации риска. Причины возникновения и модификации риска. Классификация риска по различным критериям.	2
2	7	Тема: Характеристика рисков в различных сферах бизнеса.	Внешние (страновой, валютный, налоговый, форс-мажорных обстоятельств) и внутренние (организационный, ресурсный, портфельный, кредитный, инновационный) риски малого бизнеса	2
3	7	Тема: Методы анализа риска. Технократическое, экономическое и психологическое направления анализа риска	Решение задач по вариантам	2
4	7	Тема: Методы анализа риска. Технократическое, экономическое и психологическое направления анализа риска	Решение задач по вариантам	2
5	7	Тема: Методы оценки риска Аналитические, статистические и экспертные модели оценки риска	Решение задач по вариантам	3
6	7	Тема: Методы оценки риска Аналитические, статистические и экспертные модели оценки риска	Решение задач по вариантам	3
7	7	Тема: Основные принципы управления риском. Разукрупнение риска, распределение экспозиции во времени или пространстве, изоляция синергетических факторов.	Тестирование на склонность к риску;	2

№ п/п	№ семестра	Тема (раздел) учебной дисциплины	Наименование занятий	Всего ча- сов/ из них часов в интерак- тивной форме
1	2	3	4	5
8	7		Классификация рисков. Классификация по: характеристике опасности; подверженности рisku; уязвимости, взаимодействию с другими рисками, информации о риске, величине риска, размеру расходов. Специфические классификации рисков.	1
9	7		Методы анализа риска. Технократическое, экономическое и психологическое направления анализа риска	1
10	7		Методы оценки риска Аналитические, статистические и экспертные модели оценки риска	1
11	7		Стратегия управления рисками. Статическая и динамическая концепция управления рисками	1
12	7		Психология риска. Склонность к предпринимательскому риску. Импульсивность, решительность, фатализм – как факторы принятия рискованных решений. Минимизация риска в неопределённой ситуации.	1
ВСЕГО:				21/0

4.5. Примерная тематика курсовых проектов (работ)

Курсовые работы (проекты) не предусмотрены.

5. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

Преподавание дисциплины «Теория риска» осуществляется в форме лекций и практических занятий.

Лекции проводятся в традиционной классно-урочной организационной форме, по типу управления познавательной деятельностью и на 50 % являются традиционными классически-лекционными (объяснительно-иллюстративные), и на 50 % с использованием интерактивных (диалоговых) технологий.

Практические занятия организованы с использованием технологий развивающего обучения. Часть практического курса выполняется в виде традиционных практических занятий (объяснительно-иллюстративное решение задач) в объёме 8 часов. Остальная часть практического курса (10 часов) проводится с использованием интерактивных (диалоговых) технологий, в том числе разбор и анализ конкретных ситуаций.

Самостоятельная работа студента организована с использованием традиционных видов работы и интерактивных технологий. К традиционным видам работы относятся отработка лекционного материала и отработка отдельных тем по учебным пособиям. К интерактивным (диалоговым) технологиям относится отработка отдельных тем по интернет-ресурсам и написание эссе.

Оценка полученных знаний, умений и навыков основана на рейтинговой технологии.

Фонды оценочных средств освоенных компетенций включают как вопросы теоретического характера для оценки знаний, так и задания практического содержания (решение ситуационных задач, анализ конкретных ситуаций, работа с данными) для оценки умений и навыков. Теоретические знания проверяются путём применения таких организационных форм, как индивидуальные и групповые опросы.

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДЛЯ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

№ п/п	№ семестра	Тема (раздел) учебной дисциплины	Вид самостоятельной работы студента. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы	Всего часов
1	2	3	4	5
1	7	Тема 1: Понятие риска. Экономическая природа и содержание риска. Основные показатели и свойства риска. Причины возникновения и модификации риска.	Работа с основной и дополнительной литературой и интернет-источниками	14
2	7	Тема 2: Классификация рисков.	Работа с основной и дополнительной литературой и интернет-источниками	6
3	7	Тема 3: Характеристика рисков в различных сферах бизнеса.	Работа с основной и дополнительной литературой и интернет-источниками	12
4	7	Тема 4: Методы анализа риска. Технократическое, экономическое и психологическое направления анализа риска	Работа с основной и дополнительной литературой и интернет-источниками	12
5	7	Тема 6: Методы оценки риска Аналитические, статистические и экспертные модели оценки риска	Работа с основной и дополнительной литературой и интернет-источниками	14
6	7	Тема 7: Основные принципы управления риском. Разукрупнение риска, распределение экспозиции во времени или пространстве, изоляция синергетических факторов.	Работа с основной и дополнительной литературой и интернет-источниками.	12
7	7	Тема 8: Стратегия управления рисками. Статическая и динамическая концепция управления рисками	Работа с основной и дополнительной литературой и интернет-источниками.	12
8	7	Тема 9: Психология риска. Склонность к предпринимательскому риску. Импульсивность, решительность, фатализм – как факторы принятия рискованных решений. Минимизация риска в неопределённой	Работа с основной и дополнительной литературой и интернет-источниками.	12

		ситуации.		
ВСЕГО:				94

7. ПЕРЕЧЕНЬ ОСНОВНОЙ И ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

7.1. Основная литература

№ п/п	Наименование	Автор (ы)	Год и место издания Место доступа	Используется при изучении разделов, номера страниц
1	Общая теория рисков	Вишняков Яков Дмитриевич;	Академия, , 2015 МИИТ НТБ 658.3 В55 ч.з..1-1, фб-3	Все разделы
2	Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски	Тактаров Г.А., Григорьева Е.М.	М. : Финансы и статистика, 2014 ЭБС "Издательство "Лань" http://e.lanbook.com/book/69226	Все разделы

7.2. Дополнительная литература

№ п/п	Наименование	Автор (ы)	Год и место издания Место доступа	Используется при изучении разделов, номера страниц
3	Управление рисками в малом бизнесе	И.А.Чернигина	М: МИИТ, 2014 43с.	Все разделы
4	Управление рисками при реализации инвестиционных проектов	Москвин Виктор Андреевич	ФиС М. , 2004 351с. 5-279-02675-1	Все разделы
5	Управление системными финансовыми рисками в условиях глобализации	Саввина О.В.	М. : Дашков и К, 2015 ЭБС "Издательство "Лань" http://e.lanbook.com/book/72414	Все разделы

8. ПЕРЕЧЕНЬ РЕСУРСОВ ИНФОРМАЦИОННО-ТЕЛЕКОММУНИКАЦИОННОЙ СЕТИ "ИНТЕРНЕТ", НЕОБХОДИМЫЕ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

1. <http://library.mii.ru/> - электронно-библиотечная система Научно-технической библиотеки МИИТ.
2. <http://rzd.ru/> - сайт ОАО «РЖД».
3. <http://elibrary.ru/> - научно-электронная библиотека.
4. Поисковые системы: Yandex, Google, Mail.

9. ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ИНФОРМАЦИОННЫХ СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ, ИСПОЛЪЗУЕМЫХ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

Для проведения лекционных занятий необходима специализированная лекционная аудитория с мультимедиа аппаратурой и интерактивной доской.

Для проведения практических занятий необходимы компьютеры с рабочими местами в компьютерном классе. Компьютеры должны быть обеспечены стандартными

лицензионными программными продуктами и обязательно программным продуктом Microsoft Office не ниже Microsoft Office 2007 (2013).

10. ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

Для проведения аудиторных занятий и самостоятельной работы требуется:

1. Рабочее место преподавателя с персональным компьютером, подключённым к сетям INTERNET и INTRANET.
2. Специализированная лекционная аудитория с мультимедиа аппаратурой и интерактивной доской.
3. Компьютерный класс с кондиционером. Рабочие места студентов в компьютерном классе, подключённые к сетям INTERNET и INTRANET
4. Для проведения практических занятий: компьютерный класс; кондиционер; компьютеры с минимальными требованиями – Pentium 4, ОЗУ 4 ГБ, HDD 100 ГБ, USB 2.0.

11. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Обучающимся необходимо помнить, что качество полученного образования в немалой степени зависит от активной роли самого обучающегося в учебном процессе.

Обучающийся должен быть нацелен на максимальное усвоение подаваемого лектором материала, после лекции и во время специально организуемых индивидуальных встреч он может задать лектору интересующие его вопросы.

Лекционные занятия составляют основу теоретического обучения и должны давать систематизированные основы знаний по дисциплине, раскрывать состояние и перспективы развития соответствующей области науки, концентрировать внимание обучающихся на наиболее сложных и узловых вопросах, стимулировать их активную познавательную деятельность и способствовать формированию творческого мышления. Главная задача лекционного курса – сформировать у обучающихся системное представление об изучаемом предмете, обеспечить усвоение будущими специалистами основополагающего учебного материала, принципов и закономерностей развития соответствующей научно-практической области, а также методов применения полученных знаний, умений и навыков.

Основные функции лекций: 1. Познавательно-обучающая; 2. Развивающая; 3. Ориентирующе-направляющая; 4. Активизирующая; 5. Воспитательная; 6. Организующая; 7. Информационная.

Выполнение практических заданий служит важным связующим звеном между теоретическим освоением данной дисциплины и применением ее положений на практике. Они способствуют развитию самостоятельности обучающихся, более активному освоению учебного материала, являются важной предпосылкой формирования профессиональных качеств будущих специалистов.

Проведение практических занятий не сводится только к органическому дополнению лекционных курсов и самостоятельной работы обучающихся. Их вместе с тем следует рассматривать как важное средство проверки усвоения обучающимися тех или иных положений, даваемых на лекции, а также рекомендуемой для изучения литературы; как форма текущего контроля за отношением обучающихся к учебе, за уровнем их знаний, а следовательно, и как один из важных каналов для своевременного подтягивания отстающих обучающихся.

При подготовке специалиста важны не только серьезная теоретическая подготовка, знание основ управления рисками в строительстве, но и умение ориентироваться в

разнообразных практических ситуациях, ежедневно возникающих в его деятельности. Этому способствует форма обучения в виде практических занятий. Задачи практических занятий: закрепление и углубление знаний, полученных на лекциях и приобретенных в процессе самостоятельной работы с учебной литературой, формирование у обучающихся умений и навыков работы с исходными данными, научной литературой и специальными документами. Практическому занятию должно предшествовать ознакомление с лекцией на соответствующую тему и литературой, указанной в плане этих занятий.

Самостоятельная работа может быть успешной при определенных условиях, которые необходимо организовать. Ее правильная организация, включающая технологии отбора целей, содержания, конструирования заданий и организацию контроля, систематичность самостоятельных учебных занятий, целесообразное планирование рабочего времени позволяет привить студентам умения и навыки в овладении, изучении, усвоении и систематизации приобретаемых знаний в процессе обучения, привить навыки повышения профессионального уровня в течение всей трудовой деятельности.

Каждому студенту следует составлять еженедельный и семестровый планы работы, а также план на каждый рабочий день. С вечера всегда надо распределять работу на завтра. В конце каждого дня целесообразно подводить итог работы: тщательно проверить, все ли выполнено по намеченному плану, не было ли каких-либо отступлений, а если были, по какой причине это произошло. Нужно осуществлять самоконтроль, который является необходимым условием успешной учебы. Если что-то осталось невыполненным, необходимо изыскать время для завершения этой части работы, не уменьшая объема недельного плана.

Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения учебной дисциплины, рассмотрены через соответствующие знания, умения и владения. Для проверки уровня освоения дисциплины предлагаются вопросы к экзамену и написание эссе.

Фонд оценочных средств является составной частью учебно-методического обеспечения процедуры оценки качества освоения образовательной программы и обеспечивает повышение качества образовательного процесса и входит, как приложение, в состав рабочей программы дисциплины.

Основные методические указания для обучающихся по дисциплине указаны в разделе основная и дополнительная литература.