

**МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**  
**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ АВТОНОМНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ**  
**УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ**  
**«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ ТРАНСПОРТА»**  
**(РУТ (МИИТ))**



Рабочая программа дисциплины (модуля),  
как компонент образовательной программы  
высшего образования - программы магистратуры  
по направлению подготовки  
38.04.02 Менеджмент,  
утвержденной первым проректором РУТ (МИИТ)  
Тимониным В.С.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

**Управление рисками на предприятии**

Направление подготовки: 38.04.02 Менеджмент

Направленность (профиль): Менеджмент в строительном бизнесе

Форма обучения: Заочная

Рабочая программа 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: 4329  
Подписал: заведующий кафедрой Шкурина Лидия  
Владимировна  
Дата: 01.10.2022

## 1. Общие сведения о дисциплине (модуле).

Целью освоения учебной дисциплины «Управление рисками на предприятии» является формирование у обучающихся компетенций соответствии с требованиями самостоятельно установленного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки 38.04.02 «Менеджмент» и овладение комплексом знаний, умений и навыков в области управления рисками.

Исходя из цели, в процессе изучения дисциплины решаются следующие задачи:

- ознакомить с понятиями, классификацией рисков в современной экономике;
- показать место рисков в строительном бизнесе, их классификацию;
- раскрыть общие принципы организации системы управления рисками и внутреннего контроля;
- рассмотреть и сравнить общие методы и показатели, применяемые для оценки рисков в строительном бизнесе;
- дать систему количественных показателей оценки рисков (вероятность, ожидаемая доходность, стандартное отклонение, др.);
- охарактеризовать и сравнить подходы и методы управления рисками и определить их особенности в строительном бизнесе.

## 2. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю).

Перечень формируемых результатов освоения образовательной программы (компетенций) в результате обучения по дисциплине (модулю):

**ПК-72** - Способен организовывать финансово-хозяйственную деятельность строительной организации.

Обучение по дисциплине (модулю) предполагает, что по его результатам обучающийся будет:

### **Владеть:**

Навыками проведения количественной оценки рисков, в том числе стресс тестирование в рамках операционной, инвестиционной и финансовой деятельности

Навыками разработки комплекса мероприятий, направленных на нивелирование рисков, оценки эффективности предложенных управленческих решений

Навыками формирования необходимого информационного обеспечения

для осуществления внутреннего контроля, оценки эффективности системы внутреннего контроля

**Знать:**

Сущность и типологию рисков

Принципы и порядок организации системы управления рисками и внутреннего контроля

Методы идентификации и оценки рисков

**Уметь:**

Управлять экономико-финансовыми показателями организации с учетом внешних и внутренних изменений в текущей и стратегической перспективе

Оценить уровень риск-аппетита

Интегрировать систему внутреннего контроля в деятельность организации и ее структурных подразделений

3. Объем дисциплины (модуля).

3.1. Общая трудоемкость дисциплины (модуля).

Общая трудоемкость дисциплины (модуля) составляет 3 з.е. (108 академических часа(ов)).

3.2. Объем дисциплины (модуля) в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении учебных занятий:

Тип учебных занятий	Количество часов	
	Всего	Сем. №3
Контактная работа при проведении учебных занятий (всего):	12	12
В том числе:		
Занятия лекционного типа	4	4
Занятия семинарского типа	8	8

3.3. Объем дисциплины (модуля) в форме самостоятельной работы обучающихся, а также в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении промежуточной аттестации составляет 96 академических часа (ов).

3.4. При обучении по индивидуальному учебному плану, в том числе при ускоренном обучении, объем дисциплины (модуля) может быть реализован полностью в форме самостоятельной работы обучающихся, а также в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении промежуточной аттестации.

#### 4. Содержание дисциплины (модуля).

##### 4.1. Занятия лекционного типа.

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
1	<p>Теоретические аспекты рисков</p> <p>Риск и неопределённость. Модель риска. Факторы риска. Соотношение риска и доходности. Типология рисков. Способы классификации рисков для целей принятия управленческих решений. Управляемые и неуправляемые риски. Внутренние и внешние риски. Общеэкономические и политические риски (риски окружающей среды). Риски бизнес-процессов: виды и причины возникновения. Риски, связанные с информацией для принятия решений. Операционный риск. Стратегический риск. Финансовые риски.</p>
2	<p>Методология управления рисками</p> <p>Условия функционирования системы управления рисками. Эволюция моделей управления рисками. Общепринятые принципы: COSO / FERMA / ISO 31000</p> <p>Компоненты управления рисками и внутреннего контроля. Организация системы управления рисками и внутреннего контроля (СУРiBK). Ограничения СУРiBK. Участники СУРiBK. Риск-культура и контрольная среда. Риск-аппетит. Интеграция СУРiBK в деятельность организации</p> <p>Основные этапы процесса управления риском. Концепции управления рисками</p>

##### 4.2. Занятия семинарского типа.

##### Практические занятия

№ п/п	Тематика практических занятий/краткое содержание
1	<p>Оценка рисков</p> <p>Классификация методов оценки и анализа финансовых рисков.</p> <p>Количественные методы оценки и анализа финансовых рисков: методы математической статистики: метод математического ожидания, метод стандартного отклонения, метод коэффициента вариации, методы корреляционно-регрессионного анализа, метод анализа безубыточности, метод анализа чувствительности, метод анализа сценариев, методы многофакторного анализа.</p> <p>Качественные методы оценки и анализа финансовых рисков: экспертные методы оценки, метод рейтинговых оценок, метод «Due Diligence», метод «дерево решений», метод построения «деревьев событий».</p> <p>Комбинированные качественно-количественные методы оценки и анализа финансовых рисков: методы имитационного моделирования, метод Дельфи, метод «Монте-Карло».</p>
2	<p>Методы управления рисками</p> <p>Методы трансформации рисков. Отказ от риска. Снижение вероятности ущерба или предотвращение</p>

№ п/п	Тематика практических занятий/краткое содержание
	убытка. Уменьшение размера убытков. Разделение риска (дифференциация и дублирование). Аутсорсинг риска. Методы финансирования рисков.

#### 4.3. Самостоятельная работа обучающихся.

№ п/п	Вид самостоятельной работы
1	Теоретические аспекты рисков
2	Методология управления рисками
3	Оценка рисков
4	Методы управления рисками
5	Хеджирование финансовых рисков с использованием производных финансовых инструментов
6	Выполнение курсовой работы.
7	Подготовка к промежуточной аттестации.
8	Выполнение курсовой работы.
9	Подготовка к промежуточной аттестации.

#### 4.4. Примерный перечень тем курсовых работ

Курсовая работа по дисциплине «Управление рисками на предприятии» ? это комплексная самостоятельная работа обучающегося. Темой курсовой работы является «Оценка рисков».

Задание на курсовую работу предполагает выполнение поставленных задач по 10 вариантам, которые представлены в оценочных материалах.

5. Перечень изданий, которые рекомендуется использовать при освоении дисциплины (модуля).

№ п/п	Библиографическое описание	Место доступа
1	Риск-менеджмент В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский Юрайт , 2022	ЭБС Юрайт
2	Основы риск-менеджмента М. Кроуи, Д. Гэлаи, В. Б. Минасян, Р. Марк Юрайт , 2022	ЭБС Юрайт
3	Управление финансовыми рисками. Практикум И. П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И. П. Хоминич. Юрайт , 2022	ЭБС Юрайт

6. Перечень современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем, которые могут использоваться при освоении дисциплины (модуля).

1. Официальный сайт РОАТ – <https://roat-rut.ru/>
2. Официальный сайт МИИТ – <http://miit.ru/>
3. Электронно-библиотечная система РОАТ – <http://www.biblioteka.rgotups.ru/>
4. Электронно-библиотечная система Научно-технической библиотеки МИИТ - <http://library.miit.ru/>
5. Электронные расписания занятий – <http://appnn.rgotups.ru:8080/scripts/B23.exe/R01>
6. Система дистанционного обучения РОАТ – <https://sdo.roat-rut.ru>
8. Поисковые системы «Яндекс», «Google» для доступа к тематическим информационным ресурсам
9. Электронно-библиотечная система издательства «Лань» – <http://e.lanbook.com/>
11. Электронно-библиотечная система «ЮРАЙТ» – <https://urait.ru/>
15. <http://www.minfin.ru/ru/> официальный сайт Министерства финансов РФ.
16. <http://www.cbr.ru/> официальный сайт Банка России.
17. <http://www.arbitr.ru> официальный сайт ВАС РФ
18. <http://www.rbc.ru> РИА «Росбизнес консалтинг».

7. Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства, необходимого для освоения дисциплины (модуля).

Офисный пакет приложений Microsoft Office для демонстрации презентаций и ведения интерактивных занятий; для выполнения практических заданий; для самостоятельной работы студентов Microsoft Internet Explorer, Mozilla Firefox, Google Chrome или аналог для выполнения текущего контроля успеваемости

8. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю).

Учебные аудитории для проведения занятий соответствуют требованиям охраны труда по освещенности, количеству рабочих (посадочных) мест студентов и качеству учебной (аудиторной) доски, а также соответствуют условиям пожарной безопасности. Освещённость рабочих мест соответствует

действующим СНиПам.

Учебные аудитории для проведения лекций, практических занятий, выполнения курсовых работ (проектов), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации укомплектованы специализированной мебелью и техническими средствами обучения, служащими для представления учебной информации (переносной мультимедийный проектор, переносной компьютер).

Для проведения занятий лекционного типа имеются наборы демонстрационного оборудования и учебно-наглядных пособий (презентации, графические материалы, видеоматериалы). Для проведения практических занятий используется раздаточный материал.

Для организации самостоятельной работы имеется помещение, оснащенное компьютерной техникой с подключением к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду университета.

Технические требования к оборудованию для осуществления учебного процесса с использованием дистанционных образовательных технологий:

колонки, наушники или встроенный динамик (для участия в аудиоконференции); микрофон или гарнитура (для участия в аудиоконференции); веб-камеры (для участия в видеоконференции); для ведущего: компьютер с процессором Intel Core 2 Duo от 2 ГГц (или аналог) и выше, от 2 Гб свободной оперативной памяти.

#### 9. Форма промежуточной аттестации:

Курсовая работа в 3 семестре.

Экзамен в 3 семестре.

#### 10. Оценочные материалы.

Оценочные материалы, применяемые при проведении промежуточной аттестации, разрабатываются в соответствии с локальным нормативным актом РУТ (МИИТ).

## Авторы

Доцент, доцент, к.н. кафедры  
«Экономика, финансы и управление  
на транспорте»

Никифорова Анна  
Николаевна

## Лист согласования

Заведующий кафедрой ЭИФ РОАТ  
Председатель учебно-методической  
комиссии

Л.В. Шкурина

С.Н. Климов