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 бакалавриата
по направлению подготовки
38.03.02 Менеджмент,
утвержденной первым проректором РУТ (МИИТ)
Тимониным В.С.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Управление рисками

Направление подготовки: 38.03.02 Менеджмент

Направленность (профиль): Процессное управление бизнесом

Форма обучения: Очная

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: 2017
Подписал: заведующий кафедрой Ефимова Ольга Владимировна
Дата: 02.06.2025

1. Общие сведения о дисциплине (модуле).

Целью освоения учебной дисциплины является знакомство студентов с теорией и методологией управления рисками.

К задачам дисциплины относится формирование у студентов системы знаний и практических умений для использования методов управления рисками в профессиональной сфере, приобретение навыков обоснования решений в условиях риска, в т.ч. с использованием программного обеспечения.

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю).

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

ПК-1 - Способен систематизировать информацию о бизнес-процессах, формулировать и обосновывать предложения по их улучшению с учетом возможных рисков.

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

Знать:

- основные понятия теории риска;
- стратегии управления риском;
- основные критерии принятия решений в условиях неопределенности;
- основные критерии принятия решений в условиях риска;
- методические аспекты оценки величины риска

Уметь:

- количественно оценивать величину риска;
- оценивать стоимостную меру риска (VaR);
- количественно оценивать склонность к риску лиц, принимающих решение;
- осуществлять выбор бизнес-альтернативы по критерию MVC и EVC;
- оптимизировать состав бизнес-портфеля по критерию минимума риска

Владеть:

- навыками использования критериев Сэвиджа и Гурвица;
- навыками использования критериев MVC и EVC;
- навыками оценки стоимостной меры риска (VaR);
- навыками построения дерева бизнес-решений;

- навыками использования программного обеспечения для решения задач управления рисками

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	Семестр №6
Контактная работа при проведении учебных занятий (всего):	48	48
В том числе:		
Занятия лекционного типа	16	16
Занятия семинарского типа	32	32

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 60 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	Введение в теорию риска Рассматриваемые вопросы: - риск как двумерная величина (рисковая ситуация, величина риска); - классификация ситуаций принятия решений; - причины риска; - стратегии управления риском
2	Количественные характеристики величины риска Рассматриваемые вопросы: - теоретико-вероятностные характеристики величины риска; - математико-статистические характеристики величины риска; - основные теоретические законы распределения величины риска; - методические аспекты статистической оценки величины риска
3	Свойства статистических характеристик величины риска Рассматриваемые вопросы: - свойства выборочного среднего; - свойства выборочной дисперсии; - свойства стандартного отклонения; - свойства коэффициента вариации
4	Принятие решений в условиях неопределенности Рассматриваемые вопросы: - понятие бизнес-альтернативы; - проектирование ситуации неопределенности: матричный подход; - критерий безразличия; - критерий Сэвиджа; - критерии оптимизма и пессимизма (критерий Вальда); - критерий Гурвица
5	Оценка склонности к риску Рассматриваемые вопросы: - типы отношения лиц, принимающих решение, к риску; - общая аналитическая модель склонности к риску; - графическое моделирование склонности к риску (линии уровня); - понятие безрисковой бизнес-альтернативы; - расчет параметра линий уровня по фактическим данным
6	Выбор бизнес-альтернативы по критерию EVC Рассматриваемые вопросы: - экономический смысл критерия EVC; - методические аспекты использования критерия EVC; - типовые ситуации выбора бизнес-альтернативы по критерию EVC
7	Выбор бизнес-альтернативы по критерию MVC Рассматриваемые вопросы: - экономический смысл критерия MVC; - методические аспекты использования критерия MVC; - типовые ситуации выбора бизнес-альтернативы по критерию MVC
8	Методы диссипации риска Рассматриваемые вопросы: - концептуальная модель диссипации риска; - долевое участие в бизнес-альтернативе (партнерство); - реализация бизнес-альтернатив в рамках контракта; - оценка доходности бизнес-альтернативы в условиях риска; - типовые ситуации диссипации риска

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
9	Графическое моделирование процесса принятия решения в условиях риска Рассматриваемые вопросы: - нотации моделирования процесса принятия решения; - методические аспекты построения дерева решений; - выбор бизнес-альтернативы на основе анализа дерева решений; - оценка ожидаемой ценности дополнительной информации о бизнес-альтернативе
10	Оценка стоимостной меры риска Рассматриваемые вопросы: - понятие стоимостной меры риска (VaR); - параметры стоимостной меры риска; - непараметрические методы оценки стоимостной меры риска; - параметрические методы оценки стоимостной меры риска; - метод Монте-Карло для оценки стоимостной меры риска
11	Управление бизнес-портфелем в условиях риска Рассматриваемые вопросы: - основы портфельной теории Марковица; - критерии оптимизации структуры и состава бизнес-портфеля; - метод множителей Лагранжа для оптимизации структуры бизнес-портфеля; - методические аспекты оптимизации состава бизнес-портфеля в условиях риска
12	Информационное обеспечение управления бизнес-рисками Рассматриваемые вопросы: - национальные стандарты в сфере менеджмента риска; - инструментальные средства поддержки принятия решений в условиях риска; - основные участники рынка ПО для управления рисками

4.2. Занятия семинарского типа.

Практические занятия

№ п/п	Тематика практических занятий/краткое содержание
1	Теоретико-вероятностные характеристики величины риска В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навык расчета теоретико-вероятностных характеристик величины риска, имеющей дискретное или непрерывное распределение
2	Математико-статистические характеристики величины риска В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навык расчета абсолютных и относительных математико-статистических характеристик величины риска на основе выборочных данных
3	Принятие решений в условиях неопределенности: критерий Сэвиджа В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навык выбора бизнес-альтернативы в условиях неопределенности по критерию Сэвиджа
4	Принятие решений в условиях неопределенности: критерий Гурвица В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навык выбора бизнес-альтернативы в условиях неопределенности по критерию Гурвица
5	Оценка склонности к риску В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навыки построения графических моделей склонности к риску (линий уровня) и расчета их параметров по фактическим данным

№ п/п	Тематика практических занятий/краткое содержание
6	Принятие решений в условиях риска: критерий EVC В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навык выбора бизнес-альтернативы по критерию EVC в случае дискретного или непрерывного распределения величины риска
7	Принятие решений в условиях риска: критерий MVC В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навык выбора бизнес-альтернативы по критерию MVC в случае дискретного или непрерывного распределения величины риска
8	Методы диссипации риска В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навыки обоснования управленческих решений по диссипации бизнес-рисков в рамках партнерских или контрактных отношений
9	Графическое моделирование процесса принятия решений В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навык построения дерева решений для анализа и выбора бизнес-альтернативы в условиях риска
10	Непараметрические методы оценки стоимостной меры риска В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навык непараметрической оценки стоимостной меры риска (VaR)
11	Параметрические методы оценки стоимостной меры риска В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навык параметрической оценки стоимостной меры риска (VaR)
12	Оптимизация структуры бизнес-портфеля В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навык оптимизации структуры бизнес-портфеля по критерию минимума риска

4.3. Самостоятельная работа обучающихся.

№ п/п	Вид самостоятельной работы
1	Изучение рекомендуемой литературы
2	Подготовка к практическим занятиям
3	Подготовка к промежуточной аттестации.
4	Подготовка к текущему контролю.

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

№ п/п	Библиографическое описание	Место доступа
1	Антонов, Г. Д. Управление рисками организации : учебник / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. — Москвуа : ИНФРА-М, 2023. — 153 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). — DOI 10.12737/6216. - ISBN 978-5-16-013060-6.	https://znanium.com/catalog/product/1897324 (дата обращения: 13.05.2023). - Текст : электронный.

2	Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 365 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-3502-8.	https://urait.ru/bcode/450164 (дата обращения: 13.05.2023). - Текст : электронный.
3	Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 485 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12206-0.	https://urait.ru/bcode/450664 (дата обращения: 13.05.2023). - Текст : электронный.

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

Научно-техническая библиотека РУТ (МИИТ): https://library.miit.ru/

Образовательная платформа Юрайт: https://urait.ru/

Электронно-библиотечная система Znanium: https://znanium.com/

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

Пакет приложений Microsoft Office или аналог

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

Для проведения лекционных занятий необходима аудитория с мультимедиа аппаратурой. Для проведения практических занятий требуется аудитория, оснащенная мультимедиа аппаратурой и ПК с необходимым программным обеспечением и подключением к сети интернет.

9. Форма промежуточной аттестации:

Зачет в 6 семестре.

10. Оценочные материалы.

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

Авторы:

доцент, к.н. кафедры «Экономика, организация производства и менеджмент» В.М. Моргунов

Согласовано:

Заведующий кафедрой ЭОПМ О.В. Ефимова

Председатель учебно-методической комиссии М.В. Ишханян