

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Андрей Драгомирович Хлутков
Должность: директор
Дата подписания: 09.03.2023 19:29:57
Уникальный программный ключ:
880f7c07c583b07b775f6604a630284b13ca9fd2

**Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования
«РОССИЙСКАЯ АКАДЕМИЯ НАРОДНОГО ХОЗЯЙСТВА И
ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ ПРИ ПРЕЗИДЕНТЕ РОССИЙСКОЙ
ФЕДЕРАЦИИ»**

**СЕВЕРО-ЗАПАДНЫЙ ИНСТИТУТ УПРАВЛЕНИЯ
Факультет таможенного администрирования и безопасности
Кафедра безопасности**

УТВЕРЖДЕНА

Решением методической комиссии по специальности 38.05.01 «Экономическая
безопасность» СЗИУ РАНХиГС
Протокол № 1 от 31.08.2021 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.О.27 Оценка рисков

по специальности

38.05.01 «Экономическая безопасность»
(код, наименование специальности)

Специализация №1 «Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности»

Квалификация: экономист

Формы обучения: очная, заочная

Год набора - 2021

Санкт-Петербург, 2021 г.

Автор–составитель:

кандидат экономических наук,
доцент кафедры безопасности

Андреева Д. А.

Заведующий кафедрой безопасности

к.э.н.

Тарасова Т.Н.

СОДЕРЖАНИЕ

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы
2. Объем дисциплины в зачетных единицах с указанием количества академических и астрономических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся и место дисциплины в структуре образовательной программы
3. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических и астрономических часов, видов учебных занятий и структура дисциплины
4. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся и фонд оценочных средств промежуточной аттестации по дисциплине
5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины
6. Основная и дополнительная учебная литература, необходимая для освоения дисциплины, ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", включая перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине
7. Материально-техническая база, информационные технологии, используемые при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем

Общие сведения.

Настоящая программа учебной дисциплины устанавливает требования к образовательным результатам и результатам обучения студента и определяет содержание и виды учебных занятий и отчетности.

Программа дисциплины является частью основной образовательной программы в соответствии с ФГОС высшего образования по направлению подготовки 38.05.01 Экономическая безопасность, уровень Специалист.

Программа разработана в соответствии с требованиями Порядка организации и осуществления образовательной деятельности по образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалиста, программам магистратуры, утвержденного приказом Министерства образования и науки РФ от 06.04.2021 № 245.

Образовательная деятельность по дисциплине осуществляется на государственном языке РФ.

Трудоемкость дисциплины в зачетных единицах характеризует ее объем как части образовательной программы. Величина зачетной единицы определяется нормативными документами образовательной организации.

Качество обучения по дисциплине определяется в рамках внутренней системы оценки, а также внешней системы оценки, в которой образовательная организация принимает участие на добровольной основе в рамках профессионально-общественной аккредитации.

К оценке качества обучения могут привлекаться работодатели и их объединения с целью подготовки обучающихся в соответствии с профессиональными стандартами и требованиями рынка труда к специалистам данного профиля.

В целях совершенствования образования к оценке качества также могут привлекаться обучающиеся, которым предоставляется возможность выразить свое мнение относительно условий, содержания и качества учебного процесса.

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

1.1. Дисциплина Б1.О.27 «Оценка рисков» обеспечивает овладение следующими компетенциями:

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
ОПК ОС-4	Способность на основе данных хозяйственного, налогового и бюджетного учетов, учетной документации, бухгалтерской (финансовой), налоговой и статистической отчетности выявлять, предупреждать,	ОПК ОС-4.1	Реализует методы выявления и предупреждения внутренних и внешних угроз и рисков деятельности хозяйствующего субъекта на основе данных учетной документации;

	локализовать и нейтрализовать внутренние и внешние угрозы и риски деятельности хозяйствующего субъекта	ОПК ОС-4.2	Применяет методики локализации и нейтрализации внутренних и внешних угроз деятельности хозяйствующего субъекта.
ОПК ОС-6	Способность разрабатывать и принимать экономически и финансово обоснованные организационно-управленческие решения	ОПК ОС-6.1	Применяет экономические и финансовые методы для обоснования организационно-управленческих решений;
		ОПК ОС-6.2	Применяет инструментарий оценки рисков для обоснования организационно-управленческих решений.
ПКo2 ОС-2	Способность использовать методы принятия инвестиционных решений для управления финансами компании	ПКo2 ОС-2.1	Применяет экономические и финансовые методы для обоснования и принятия инвестиционных решений;
		ПКo2 ОС-2.2	Применяет методы принятия инвестиционных решений для управления финансами компании.

1.2. В результате освоения дисциплины Б1.О.27 «Оценка рисков» у выпускника должны быть сформированы:

ОТФ/ТФ (при наличии профстандарта)/ профессиональные действия¹	Код этапа освоения компетенции	Результаты обучения
Способность на основе данных хозяйственного, налогового и бюджетного учетов, учетной документации, бухгалтерской (финансовой), налоговой и статистической отчетности	ОПК ОС-4.1	на уровне знаний: - способы, методы, алгоритмы и процедуры выявления внутренних и внешних угроз, рисков деятельности хозяйствующего субъекта; - методы локализации и нейтрализации внутренних и внешних угроз деятельности хозяйствующего субъекта;
	ОПК ОС-4.2	

¹ В отсутствие профессионального стандарта состав профессиональных действий был определен в рамках Форсайт-сессии Протокол № 1 от 24.08.2016 г.

<p>выявлять, предупреждать, локализовать и нейтрализовать внутренние и внешние угрозы и риски деятельности хозяйствующего субъекта</p>		<ul style="list-style-type: none"> - способы, методы, алгоритмы и процедуры оценки, анализа и интерпретации данных. на уровне умений: <ul style="list-style-type: none"> - использовать знания о способах, методах, алгоритмах и процедурах выявления внутренних и внешних угроз, рисков деятельности хозяйствующего субъекта; - использовать знания и методах локализации и нейтрализации внутренних и внешних угроз деятельности хозяйствующего субъекта; - уметь применять способы, методы, алгоритмы и процедуры оценки, анализа и интерпретации данных. на уровне навыков: <ul style="list-style-type: none"> - навыки реализации способов, методов, алгоритмов и процедур выявления внутренних и внешних угроз, рисков деятельности хозяйствующего субъекта; - навыки локализации и нейтрализации внутренних и внешних угроз деятельности хозяйствующего субъекта; - навыки оценки, анализа и интерпретации данных.
<p>Способность разрабатывать и принимать экономически и финансово обоснованные организационно-управленческие решения</p>	<p>ОПК ОС-6.1 ОПК ОС-6.1</p>	<p>на уровне знаний:</p> <ul style="list-style-type: none"> - знания методов разработки экономически и финансово обоснованных организационно-управленческих решений; - знания методов экономического и финансового обоснования организационно-управленческих решений. <p>на уровне умений:</p> <ul style="list-style-type: none"> - использовать знания методов разработки экономически и финансово обоснованных организационно-управленческих решений; - применять методы экономического и финансового обоснования организационно-управленческих решений; <p>на уровне навыков:</p> <ul style="list-style-type: none"> - навыки применения методов разработки экономически и финансово обоснованных организационно-управленческих решений; - навыки экономического и финансового обоснования организационно-управленческих решений.

Способность использовать методы принятия инвестиционных решений для управления финансами компании	ПКo2 OC-2.1	на уровне знаний:
	ПКo2 OC-2.2	- знания методов принятия инвестиционных решений для управления финансами компании; - знания способов управления финансами компании; на уровне умений: - использовать знания о методах принятия инвестиционных решений для управления финансами компании; - использовать знания о способах управления финансами компании; на уровне навыков: - применения методов принятия инвестиционных решений для управления финансами компании; - применения способов управления финансами компании.

2. Объем и место дисциплины в структуре образовательной программы

Объем дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины (очная/заочная) составляет 4 зачетные единицы или 144 академических часа. Дисциплина реализуется с применением дистанционных образовательных технологий (*далее – ДОТ*)

Очная форма обучения

Вид работы	Трудоемкость в акад. часах ауд./ЭО, ДОТ	Трудоемкость в астрон. часах ауд./ЭО, ДОТ
Общая трудоемкость	144	108
Контактная работа с преподавателем	64	48
Лекции	16/16	12/12
Практические занятия	16/16	12/12
Лабораторные занятия		
Самостоятельная работа	80	60
Контроль		
Формы текущего контроля	тестирование, решение задач, устный опрос, подготовка докладов, выполнение самостоятельных работ	
Форма промежуточной аттестации	Зачет	

Заочная форма обучения

Вид работы	Трудоемкость в акад. часах ауд./ЭО, ДОТ	Трудоемкость в астрон. часах ауд./ЭО, ДОТ
Общая трудоемкость	144	108
Контактная работа с преподавателем	20	15
Лекции	6/4	4,5/3
Практические занятия	6/4	4,5/3
Лабораторные занятия		
Самостоятельная работа	120	90

Контроль	4	3
Формы текущего контроля	тестирование, решение задач, устный опрос, подготовка докладов, выполнение самостоятельных работ	
Форма промежуточной аттестации	Зачет	

Дисциплина относится к блоку 1 (Б1), обязательная часть (О.27).

Предшествующие (обеспечивающие) и последующие дисциплины исходя из формируемых компетенций:

ОПК ОС-4. Способность на основе данных хозяйственного, налогового и бюджетного учетов, учетной документации, бухгалтерской (финансовой), налоговой и статистической отчетности выявлять, предупреждать, локализовать и нейтрализовать внутренние и внешние угрозы и риски деятельности хозяйствующего субъекта:

- Экономическая безопасность;
- Статистика;
- Бухгалтерский учет;
- Финансы;
- Деньги, кредит, банки;
- Налоги и налогообложение;
- Преступления в сфере экономики.

ОПК ОС-6. Способность разрабатывать и принимать экономически и финансово обоснованные организационно-управленческие решения:

- Экономическая теория;
- Государственное регулирование экономики;
- Экономика организации (предприятия).

ПКo2 ОС-2. Способность использовать методы принятия инвестиционных решений для управления финансами компании:

- Финансы;
- Обеспечение экономической безопасности хозяйствующих субъектов;
- Управление экономикой организации (предприятия);
- Корпоративное управление;
- Инвестиции и инвестиционный анализ;
- Бизнес-планирование.

Дисциплина для очной формы обучения изучается на 4 курсе в 8 семестре. Дисциплина для заочной формы обучения изучается на 5 курсе в 9 и 10 семестрах.

Формой промежуточной аттестации в соответствии с учебным планом является зачет.

Доступ к системе дистанционных образовательных технологий осуществляется каждым обучающимся самостоятельно с любого устройства на портале: <https://szu-de.ranepa.ru/>.

Пароль и логин к личному кабинету / профилю предоставляется студенту в деканате.

3.Содержание и структура дисциплины

№ п/п	Наименование тем и/или разделов	Объем дисциплины (модуля), час.			Форма текущего контроля успеваемо
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий	СР	

			Л/Э О, ДОТ	ЛР/Э О, ДОТ	ПЗ/Э О, ДОТ	КСР ² / ЭО, ДОТ		сти**, промежу- точной аттестаци и***
Очная форма обучения								
Тема 1	Научные основы оценки рисков предпринимательской деятельности	18	2/2		2/2		10	ДЗ, О, 3
Тема 2	Методология оценки риска банкротства предприятия	18	2/2		2/2		10	ДЗ, О, 3, КР1
Тема 3	Методология оценки риска снижения финансовой устойчивости предприятия	20	2/2		2/2		12	ДЗ, О, 3
Тема 4	Методология оценки риска снижения деловой активности предприятия	20	2/2		2/2		12	ДЗ, О, 3
Тема 5	Методология оценки риска снижения эффективности производственной деятельности предприятия	24	3/3		3/3		12	ДЗ, О, 3, КР2
Тема 6	Методология оценки риска снижения эффективности кадрового обеспечения предприятия	24	3/3		3/3		12	ДЗ, О, 3
Тема 7	Методология оценки риска снижения эффективности маркетинговой деятельности предприятия	20	2/2		2/2		12	ДЗ, О, 3
	Промежуточная аттестация							Зачет
	Всего:	144	16/ 16		16/ 16		80	
	Всего в астрон. часах	108	12/ 12		12/ 12		60	
Заочная форма обучения								
Тема 1	Научные основы оценки рисков предпринимательской деятельности	18	0,5 / 0,5		0,5 / 0,5		16	ДЗ, О, 3
Тема 2	Методология оценки риска банкротства предприятия	18	1		1		16	ДЗ, О, 3, КР1
Тема 3	Методология оценки риска снижения финансовой устойчивости предприятия	18	1		1		16	ДЗ, О, 3
Тема 4	Методология оценки риска снижения деловой активности предприятия	22	1/1		1/1		18	ДЗ, О, 3
Тема 5	Методология оценки риска снижения эффективности	22	1/1		1/1		18	ДЗ, О, 3, КР2

² Не входит в объем дисциплины.

	производственной деятельности предприятия							
Тема 6	Методология оценки риска снижения эффективности кадрового обеспечения предприятия	22	1/1		1/1		18	ДЗ, О, З
Тема 7	Методология оценки риска снижения эффективности маркетинговой деятельности предприятия	20	0,5 / 0,5		0,5 / 0,5		18	ДЗ, О, З
	Промежуточная аттестация	4						Зачет
	Всего:	144	6/ 4		6/ 4		120	
	Всего в астрон. часах	108	4,5/ 3		4,5/ 3		90	

Содержание учебной дисциплины

Тема 1. Научные основы оценки рисков предпринимательской деятельности

Оценка рисков как наука и учебная дисциплина. Современные подходы к классификации рисков.

Место и роль рисков в предпринимательской деятельности.

Экономические, правовые и финансовые аспекты предпринимательских рисков.

Риск как вероятность неблагоприятного исхода предпринимательской деятельности.

Оценка степени предпринимательского риска в условиях неопределенности.

Предпринимательские риски и экономическая свобода предпринимательства.

Области риска в предпринимательской деятельности. Возникновение рисков при постановке миссии и целей фирмы. Риски развития.

Тема 2. Методология оценки риска банкротства предприятия

Теоретические аспекты банкротства. Виды банкротства: фиктивное, преднамеренное, реальное, техническое. Причины банкротства: субъективные; объективные; внешние; внутренние. Основные факторы.

Основные подходы к предсказанию банкротства: количественный, качественный, метод интегральной бальной оценки достоинства и недостатки каждого из них.

Модель диагностики вероятности банкротства Э.Альтмана: содержание, достоинства и недостатки.

Модель диагностики вероятности банкротства У.Бивера: содержание, достоинства и недостатки.

Модель оценки вероятности банкротства организации по Р.Лису: содержание, достоинства и недостатки.

Модель диагностики вероятности банкротства Р.Таффлера: содержание, достоинства и недостатки.

Модель диагностики вероятности банкротства Г.Спрингейта: содержание, достоинства и недостатки.

Модель оценки платежеспособности Ж.Конана и М.Голдера: содержание, достоинства и недостатки.

Модель оценки вероятности банкротства организации по Дж.Фулмеру: содержание, достоинства и недостатки.

Модель прогнозирования банкротства предприятия Р.С.Сайфуллина и Г.Г. Кадыкова: содержание, достоинства и недостатки.

Модель прогнозирования банкротства предприятия А.Б.Перфильева.

Модель прогнозирования банкротства предприятия Г.В.Савицкой.

Модель оценки вероятности банкротства организации по Г.В.Давыдовой и А.Д.Беликову: содержание, достоинства и недостатки.

Модель оценки вероятности банкротства организации по А.С.Кучеренко: содержание, достоинства и недостатки.

Методика оценки вероятности банкротства организации по Л.В.Донцовой и Н.А.Никифоровой: содержание, достоинства и недостатки.

Модель оценки вероятности банкротства организации по В.В.Ковалеву: содержание, достоинства и недостатки.

Модель оценки вероятности банкротства организации по А.Н.Жилкиной: содержание, достоинства и недостатки.

Тема 3. Методология оценки риска снижения финансовой устойчивости предприятия

Показатели финансовой устойчивости: коэффициент концентрации собственного капитала; коэффициент финансовой зависимости; коэффициент маневренности собственного капитала; коэффициент концентрации заемного капитала; коэффициент структуры долгосрочных вложений; коэффициент долгосрочного привлечения заемных средств; коэффициент структуры заемного капитала; коэффициент задолженности; коэффициент соотношения заемного и собственного капитала; коэффициент финансовой устойчивости организации.

Тема 4. Методология оценки риска снижения деловой активности предприятия

Факторы, оказывающие влияние на деловую активность организации: мезоуровень – отраслевая принадлежность; сфера деятельности; масштаб деятельности; влияние информационных ресурсов; характер хозяйственных связей с партнерами; отраслевая принадлежность; микроуровень – Эффективность стратегии управления активами; ценовая политика; методика оценки товарно-материальных ценностей и запасов.

Влияние изменений в среде поставщиков на финансовую деятельность предприятий.

Макросреда предпринимательства и факторы на нее влияющие.

Структура оценки деловой активности: качественные и количественные критерии.

Показатели деловой активности: коэффициент оборачиваемости всех активов; коэффициент оборачиваемости оборотных активов; коэффициент оборачиваемости материальных средств; коэффициент оборачиваемости денежных средств; коэффициент оборачиваемости дебиторской задолженности; оборачиваемость в днях дебиторской задолженности; коэффициент оборачиваемости кредиторской задолженности; оборачиваемость в днях кредиторской задолженности; коэффициент оборачиваемости собственного капитала.

Тема 5. Методология оценки риска снижения эффективности производственной деятельности предприятия

Оценка технического риска на предприятии.

Оценка транспортного риска на предприятии.

Оценка риска снижения эффективности хранения готовой продукции.

Оценка риска снабжения предприятия.

Оценка риска снижения эффективности управленческой деятельности предприятия.

Оценка риска снижения эффективности сбытовой деятельности предприятия.

Тема 6. Методология оценки риска снижения эффективности кадрового обеспечения предприятия

Оценка риска снижения эффективности структуры управления организации.

Оценка риска снижения эффективности системы мотивации персонала организации.

Оценка риска снижения эффективности системы трудовой адаптации сотрудников организации.
 Оценка риска снижения эффективности маркетинга персонала организации.
 Оценка риска снижения производительности труда персонала организации.
 Оценка риска снижения эффективности системы повышения квалификации персонала организации.

Тема 7. Методология оценки риска снижения эффективности маркетинговой деятельности предприятия

Оценка риска снижения эффективности структуры управления маркетинговой деятельности предприятия.
 Оценка риска снижения эффективности структуры управления ассортиментом.
 Оценка риска снижения эффективности ценовой политики организации.
 Оценка риска снижения эффективности коммуникационной политики организации.
 Оценка риска снижения эффективности рекламной деятельности.

4. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся и фонд оценочных средств промежуточной аттестации по дисциплине

Промежуточная аттестация проводится устно в ДОТ/письменно с прокторингом/ тестирование с прокторингом. Для успешного освоения курса учащемуся рекомендуется ознакомиться с литературой, размещенной в разделе 6, и материалами, выложенными в ДОТ.

4.1. Формы и методы текущего контроля успеваемости обучающихся и промежуточной аттестации.

4.1.1. В ходе реализации дисциплины Б1.О.27 «Оценка рисков» используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

Тема	Методы текущего контроля успеваемости
1. Научные основы оценки рисков предпринимательской деятельности	ДЗ, О, З
2. Методология оценки риска банкротства предприятия	ДЗ, О, З, КР1
3. Методология оценки риска снижения финансовой устойчивости предприятия	ДЗ, О, З
4. Методология оценки риска снижения деловой активности предприятия	ДЗ, О, З
5. Методология оценки риска снижения эффективности производственной деятельности предприятия	ДЗ, О, З, КР2
6. Методология оценки риска снижения эффективности кадрового обеспечения предприятия	ДЗ, О, З
7. Методология оценки риска снижения эффективности маркетинговой деятельности предприятия	ДЗ, О, З

Примечание*: контрольные работы (К), опрос (О), тестирование (Т), домашнее задание (ДЗ), решение задач (З)

4.1.2. Промежуточная аттестация проводится с применением следующих методов(средств)

Промежуточная аттестация проводится в форме зачета по билетам. Зачет в ДОТ может проводиться на основе компьютерного тестирования.

4.2. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся

В ходе реализации дисциплины используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

- при проведении занятий лекционного типа: контрольные вопросы;
- при проведении занятий семинарского типа: устный опрос, тестирование, дискуссии, контрольные работы, решение задач;

На занятиях для решения воспитательных и учебных задач применяются следующие формы интерактивной работы: диалого-дискуссионное обсуждение проблем, поисковый метод, исследовательский метод, деловые игры, разбор конкретных ситуаций.

Материалы текущего контроля успеваемости:

1. Тестовые задания.
2. Примеры варианта контрольной работы.
3. Задания для самостоятельной работы.
4. Контрольные вопросы по дисциплине.
5. Перечень вопросов для полготовки к зачету.
6. Методические рекомендации для обучающихся по освоению дисциплины.

Пример задач для решения обучающимися

Задача 1.1

При заключении сделки между двумя предприятиями по реализации проекта аналитики одной фирмы, получающей большую выгоду от сделки, полагают, что сделка принесет успех с вероятностью, равной 0,73, если руководителем проектной команды будет назначен их менеджер. Если другая фирма откажется от назначения, то вероятность успеха равна 0,38. Предполагается, что вероятность назначения менеджера составляет 0,82. Чему равна вероятность успеха сделки?

Задача 1.2

При заключении сделки между двумя предприятиями по реализации проекта аналитики одной фирмы, получающей большую выгоду от сделки, полагают, что сделка принесет успех с вероятностью, равной 0,57, если руководителем проектной команды будет назначен их менеджер. Если другая фирма откажется от назначения, то вероятность успеха равна 0,48. Предполагается, что вероятность назначения менеджера составляет 0,44. Чему равна вероятность успеха сделки?

Задача 1.3

При заключении сделки между двумя предприятиями по реализации проекта аналитики одной фирмы, получающей большую выгоду от сделки, полагают, что сделка принесет успех с вероятностью, равной 0,83, если руководителем проектной команды будет назначен их менеджер. Если другая фирма откажется от назначения, то вероятность успеха равна 0,28. Предполагается, что вероятность назначения менеджера составляет 0,62. Чему равна вероятность успеха сделки?

Задача 1.4

При заключении сделки между двумя предприятиями по реализации проекта аналитики одной фирмы, получающей большую выгоду от сделки, полагают, что сделка принесет успех с вероятностью, равной 0,67, если руководителем проектной команды будет назначен их менеджер. Если другая фирма откажется от назначения, то вероятность успеха равна 0,25. Предполагается, что вероятность назначения менеджера составляет 0,77. Чему равна вероятность успеха сделки?

Задача 1.5

При заключении сделки между двумя предприятиями по реализации проекта аналитики одной фирмы, получающей большую выгоду от сделки, полагают, что сделка принесет успех с вероятностью, равной 0,44, если руководителем проектной команды будет назначен их менеджер. Если другая фирма откажется от назначения, то вероятность успеха равна 0,48. Предполагается, что вероятность назначения менеджера составляет 0,66. Чему равна вероятность успеха сделки?

Задача 1.6

При заключении сделки между двумя предприятиями по реализации проекта аналитики одной фирмы, получающей большую выгоду от сделки, полагают, что сделка принесет успех с вероятностью, равной 0,69, если руководителем проектной команды будет назначен их менеджер. Если другая фирма откажется от назначения, то вероятность успеха равна 0,32. Предполагается, что вероятность назначения менеджера составляет 0,74. Чему равна вероятность успеха сделки?

Задача 1.7

При заключении сделки между двумя предприятиями по реализации проекта аналитики одной фирмы, получающей большую выгоду от сделки, полагают, что сделка принесет успех с вероятностью, равной 0,53, если руководителем проектной команды будет назначен их менеджер. Если другая фирма откажется от назначения, то вероятность успеха равна 0,78. Предполагается, что вероятность назначения менеджера составляет 0,42. Чему равна вероятность успеха сделки?

Задача 1.8

При заключении сделки между двумя предприятиями по реализации проекта аналитики одной фирмы, получающей большую выгоду от сделки, полагают, что сделка принесет успех с вероятностью, равной 0,58, если руководителем проектной команды будет назначен их менеджер. Если другая фирма откажется от назначения, то вероятность успеха равна 0,49. Предполагается, что вероятность назначения менеджера составляет 0,81. Чему равна вероятность успеха сделки?

Задача 2.1

Акционерному обществу предлагаются два рискованных проекта.

Оцените риск и эффективность реализации проекта

	Проект 1	Проект 2
Вероятность события	0,4 0,2 0,4	0,2 0,6 0,2
Наличие поступления, млн. руб.	50 60 70	0 40 120

Задача 2.2

Акционерному обществу предлагаются два рискованных проекта.

Оцените риск и эффективность реализации проекта

	Проект 1	Проект 2
Вероятность события	0,3 0,4 0,3	0,5 0,2 0,3

Наличие поступления, млн. руб.	40 50 60	20 50 70
--------------------------------	----------	----------

Задача 2.3

Акционерному обществу предлагаются два рискованных проекта.

Оцените риск и эффективность реализации проекта

	Проект 1	Проект 2
Вероятность события	0,5 0,3 0,2	0,4 0,4 0,2
Наличие поступления, млн. руб.	20 30 50	30 50 100

Задача 2.4

Акционерному обществу предлагаются два рискованных проекта.

Оцените риск и эффективность реализации проекта

	Проект 1	Проект 2
Вероятность события	0,3 0,6 0,1	0,3 0,4 0,3
Наличие поступления, млн. руб.	40 50 0	10 60 80

Задача 2.5

Акционерному обществу предлагаются два рискованных проекта.

Оцените риск и эффективность реализации проекта

	Проект 1	Проект 2
Вероятность события	0,5 0,2 0,3	0,3 0,6 0,1
Наличие поступления, млн. руб.	80 50 75	85 70 20

Задача 2.6

Акционерному обществу предлагаются два рискованных проекта.

Оцените риск и эффективность реализации проекта

	Проект 1	Проект 2
Вероятность события	0,7 0,15 0,15	0,5 0,2 0,3
Наличие поступления, млн. руб.	45 50 70	60 65 100

Задача 2.7

Акционерному обществу предлагаются два рискованных проекта.

Оцените риск и эффективность реализации проекта

	Проект 1	Проект 2
Вероятность события	0,45 0,25 0,3	0,3 0,5 0,2
Наличие поступления, млн. руб.	60 30 50	30 50 80

Задача 2.8

Акционерному обществу предлагаются два рискованных проекта.

Оцените риск и эффективность реализации проекта

	Проект 1	Проект 2
Вероятность события	0,35 0,4 0,25	0,7 0,1 0,2
Наличие поступления, млн. руб.	65 0 100	70 40 90

Задача 3.1

Имеется проект, который может обеспечить максимальный выпуск 9400 ед. в год некоторой продукции и имеет период полезного использования, равный пяти годам. Цена реализации единицы продукции составляет 30 руб.

Показатель	Период					
	0	1	2	3	4	5
Коэффициент использования мощностей, %	-	40	50	70	80	100
Максимальный объем выпуска, ед. изд.	-	9400	9400	9400	9400	9400
Цена реализации, руб.	-	30	30	30	30	30
Выручка, руб.	0					
Инвестиции, руб.	53000					
Поток условно-постоянных издержек, руб.	-	56500	56500	58500	59500	59500
Поток условно-переменных расходов, руб./ед.продукции	-	15	15	16	17	17

Задача 3.2

Имеется проект, который может обеспечить максимальный выпуск 8400 ед. в год некоторой продукции и имеет период полезного использования, равный пяти годам. Цена реализации единицы продукции составляет 40 руб.

Показатель	Период					
	0	1	2	3	4	5
Коэффициент использования мощностей, %	-	50	70	90	100	100
Максимальный объем выпуска, ед. изд.	-	8400	8400	8400	8400	8400
Цена реализации, руб.	-	40	40	40	40	40
Выручка, руб.	0					
Инвестиции, руб.	255000					
Поток условно-постоянных издержек, руб.	-	56500	56500	58500	59500	59500
Поток условно-переменных расходов, руб./ед.продукции	-	14	15	16	17	18

Задача 3.3

Имеется проект, который может обеспечить максимальный выпуск 8000 ед. в год некоторой продукции и имеет период полезного использования, равный пяти годам. Цена реализации единицы продукции составляет 45 руб.

Показатель	Период					
	0	1	2	3	4	5
Коэффициент использования мощностей, %	-	40	50	70	80	100
Максимальный объем выпуска, ед. изд.	-	8000	8000	8000	8000	8000
Цена реализации, руб.	-	45	45	45	45	45
Выручка, руб.	0					
Инвестиции, руб.	260000					
Поток условно-постоянных издержек, руб.	-	46500	46500	48500	49500	49500
Поток условно-переменных расходов, руб./ед.продукции	-	15	15	16	17	17

Задача 3.4

Имеется проект, который может обеспечить максимальный выпуск 9400 ед. в год некоторой продукции и имеет период полезного использования, равный пяти годам. Цена реализации единицы продукции составляет 35 руб.

Показатель	Период					
	0	1	2	3	4	5
Коэффициент использования мощностей, %	-	50	55	60	90	100
Максимальный объем выпуска, ед. изд.	-	9400	9400	9400	9400	9400
Цена реализации, руб.	-	35	35	35	35	35
Выручка, руб.	0					
Инвестиции, руб.	173000					
Поток условно-постоянных издержек, руб.	-	56500	56500	58500	59500	59500
Поток условно-переменных расходов, руб./ед.продукции	-	13	13	14	14	15

Задача 3.5

Имеется проект, который может обеспечить максимальный выпуск 10400 ед. в год некоторой продукции и имеет период полезного использования, равный пяти годам. Цена реализации единицы продукции составляет 30 руб.

Показатель	Период					
	0	1	2	3	4	5
Коэффициент использования мощностей, %	-	40	50	70	80	100
Максимальный объем выпуска, ед. изд.	-	104000	104000	104000	104000	104000
Цена реализации, руб.	-	30	30	30	30	30
Выручка, руб.	0					
Инвестиции, руб.	1883000					
Поток условно-постоянных издержек, руб.	-	56500	46500	48500	51500	53500
Поток условно-переменных расходов, руб./ед.продукции	-	14	15	16	16	17

Задача 3.6

Имеется проект, который может обеспечить максимальный выпуск 9400 ед. в год некоторой продукции и имеет период полезного использования, равный пяти годам. Цена реализации единицы продукции составляет 50 руб.

Показатель	Период					
	0	1	2	3	4	5
Коэффициент использования мощностей, %	-	50	50	60	90	100
Максимальный объем выпуска, ед. изд.	-	9400	9400	9400	9400	9400
Цена реализации, руб.	-	50	50	50	50	50
Выручка, руб.	0					
Инвестиции, руб.	366000					
Поток условно-постоянных издержек, руб.	-	66500	66500	68500	69500	69500
Поток условно-переменных расходов, руб./ед.продукции	-	14	15	15	17	17

Задача 3.7

Имеется проект, который может обеспечить максимальный выпуск 7400 ед. в год некоторой продукции и имеет период полезного использования, равный пяти годам. Цена реализации единицы продукции составляет 55 руб.

Показатель	Период					
	0	1	2	3	4	5

Коэффициент использования мощностей, %	-	50	60	70	90	100
Максимальный объем выпуска, ед. изд.	-	7400	7400	7400	7400	7400
Цена реализации, руб.	-	55	55	55	55	55
Выручка, руб.	0					
Инвестиции, руб.	344000					
Поток условно-постоянных издержек, руб.	-	56500	56500	58500	59500	59500
Поток условно-переменных расходов, руб./ед.продукции	-	15	15	16	17	17

Задача 3.8

Имеется проект, который может обеспечить максимальный выпуск 8400 ед. в год некоторой продукции и имеет период полезного использования, равный пяти годам. Цена реализации единицы продукции составляет 30 руб.

Показатель	Период					
	0	1	2	3	4	5
Коэффициент использования мощностей, %	-	55	65	70	95	100
Максимальный объем выпуска, ед. изд.	-	8400	8400	8400	8400	8400
Цена реализации, руб.	-	30	30	30	30	30
Выручка, руб.	0					
Инвестиции, руб.	64500					
Поток условно-постоянных издержек, руб.	-	56500	56500	58500	59500	59500
Поток условно-переменных расходов, руб./ед.продукции	-	13	14	15	17	17

Задача 3.9

Имеется проект, который может обеспечить максимальный выпуск 7600 ед. в год некоторой продукции и имеет период полезного использования, равный пяти годам. Цена реализации единицы продукции составляет 40 руб.

Показатель	Период					
	0	1	2	3	4	5
Коэффициент использования мощностей, %	-	50	70	80	100	100

Максимальный объем выпуска, ед. изд.	-	7600	7600	7600	7600	7600
Цена реализации, руб.	-	40	40	40	40	40
Выручка, руб.	0					
Инвестиции, руб.	246000					
Поток условно-постоянных издержек, руб.	-	56500	56500	58500	59500	59500
Поток условно-переменных расходов, руб./ед.продукции	-	14	14	15	15	15

Задача 3.10

Имеется проект, который может обеспечить максимальный выпуск 8800 ед. в год некоторой продукции и имеет период полезного использования, равный пяти годам. Цена реализации единицы продукции составляет 35 руб.

Показатель	Период					
	0	1	2	3	4	5
Коэффициент использования мощностей, %	-	40	60	80	90	100
Максимальный объем выпуска, ед. изд.	-	8800	8800	8800	8800	8800
Цена реализации, руб.	-	35	35	35	35	35
Выручка, руб.	0					
Инвестиции, руб.	153000	-	-	-	-	-
Поток условно-постоянных издержек, руб.	-	56500	56500	58500	59500	59500
Поток условно-переменных расходов, руб./ед.продукции	-	14	15	16	17	17

Задача 3.11

Имеется проект, который может обеспечить максимальный выпуск 8000 ед. в год некоторой продукции и имеет период полезного использования, равный пяти годам. Цена реализации единицы продукции составляет 44 руб.

Показатель	Период					
	0	1	2	3	4	5
Коэффициент использования мощностей, %	-	50	50	70	80	100
Максимальный объем выпуска, ед. изд.	-	8000	8000	8000	8000	8000

Цена реализации, руб.	-	44	44	44	44	44
Выручка, руб.	0					
Инвестиции, руб.	155000					
Поток условно-постоянных издержек, руб.	-	56500	56500	58500	59500	59500
Поток условно-переменных расходов, руб./ед.продукции	-	15	15	16	17	17

Необходимо:

Показатель	Период					
	0	1	2	3	4	5
Поток доходов, руб.						
Поток операционных расходов, руб.						
Инвестиционные расходы, руб.						
Денежный поток, руб.						

Расчетный показатель	Ставка процента, %									
	0	5	10	15	20	25	30	35	40	45
Чистая настоящая стоимость, руб.										
Индекс доходности										

Ставка процента, %	Чистая настоящая стоимость проекта, руб.	Значение производной, руб.	Коэффициент эластичности
0			
5			
10			
15			
20			
25			
30			
35			
40			
45			

Задача по ABC-анализу

Таблица 1. ABC Анализ ассортимента. Исходные данные

Товар	Стоимость 1 упаковки, руб.	Годовой объем продаж, шт.
Спагетти №1	130	1500
Спагетти №2	150	4600
Спагетти №3	270	1000
Спагетти №4	164	1500
Спагетти №5	200	6000
Спагетти №6	194	28000
Спагетти №7	235	24000

Спагетти №8	350	200
Спагетти №9	215	4000
Спагетти №10	290	700
Итого		

Произвести ранжирование - распределение исследуемых объектов в порядке убывания и рассчитать долю анализируемого параметра нарастающим итогом.

Годовой объем продаж нарастающим итогом рассчитываем как сумму вычисляемого параметра и всех предыдущих.

Таблица 2. ABC Анализ ассортимента. Пример

Товар	Годовой объем продаж, шт.	Годовой объем продаж, тыс. руб.	Годовой объем продаж, %	Годовой объем продаж нарастающим итогом, %
...				
Итого				

Разбить на 3 группы: А, В и С и сделать выводы.

Задача - Инвестор решает вопрос о вложении средств в активы другой организации. Он изучил изменения КТЛ за последние 6 полугодий (табл. 1).

Какова вероятность того, что организация восстановит свою платежеспособность?

Решить задачу используя неравенство Чебышева, взяв отклонение из таблицы (а), и найдя отклонение самостоятельно (б). Найти точное значение вероятности используя распределение Стьюдента (в) (число степеней свободы $k = \text{количество групп (наблюдений)} - 3$).

	вариант								
Значения КТЛ	1	1,8	2,4	1,6	1,8	2,2	1,8	значения отклонения, %	15
	2	1,7	2,0	2,1	2,2	1,8	2,0		20
	3	1,9	2,1	2,3	1,8	2,1	2,2		17
	4	2,0	1,7	1,6	1,7	2,1	1,9		16
	5	2,2	1,9	1,8	2,2	1,9	1,7		21
	6	1,6	2,1	1,7	1,7	2,1	1,6		15
	7	1,8	1,7	2,3	2,1	1,9	2,0		20
	8	2,1	2,0	1,6	1,7	1,8	2,0		17
	9	1,4	1,7	2,2	2,1	1,6	2,2		15
	10	1,5	2,1	1,8	2,1	1,7	2,0		22
	11	1,8	1,4	2,3	1,8	2,1	1,9		18
	12	1,7	1,9	2,1	1,8	2,0	1,9		19
	13	1,5	1,9	2,2	1,5	2,3	2,0		17
	14	1,7	2,1	1,5	2,0	1,9	1,9		19
	15	2,0	1,9	1,7	1,9	2,0	1,6		21

Задачи - Оценка эффективности реструктуризации фирмы

Задача 1

При слиянии акционерного капитала двух фирм аналитики фирмы, получающей контрольный пакет акций, полагают, что сделка принесет успех с вероятностью, равной 0,65, если председатель совета директоров поглощаемой фирмы выйдет в отставку; если он откажется, то вероятность успеха равно 0,3. Предполагается, что вероятность ухода в отставку председателя составляет 0,7. Чему равна вероятность успеха сделки?

Формула полной вероятности:

$$P(A) = P(A/H_1)P(H_1) + P(A/H_2)P(H_2).$$

$P(A)$ – вероятность события А (успех сделки)

$P(H_1)$ - вероятность ухода = 0,7

$P(A/H_1)$ – вероятность успеха сделки при уходе = 0,65

$P(A/H_2)$ – вероятность успеха сделки, если остается = 0,3

$P(H_2)$ - вероятность того, что председатель останется $1 - 0,7 = 0,3$.

$$P(A) = 0,65 \cdot 0,7 + 0,3 \cdot 0,3 = 0,545$$

Как оценивать вероятности?

№	Словесная оценка событий	P количественный аналог
1	Практически невозможное	$\leq 0,001$
2	Очень маловероятное	$\leq 0,05$
3	Скорее не произойдет	$\leq 0,3$
4	Одинаково возможное	$\approx 0,5$
5	Скорее произойдет, чем не произойдет	$\geq 0,7$
6	Очень вероятное	$\geq 0,95$
7	Практически достоверное	$P > 0,99$

2. Оценка риска и эффективности реализации проекта в условиях финансового оздоровления фирмы

Задача

Мерой риска коммерческого (финансового) решения следует считать среднеквадратичное отклонение значения показателя эффективности этого решения.

Пример.

Акционерному обществу предлагаются два рискованных проекта.

Вероятность события.

	Проект 1	Проект 2
Вероятность события	0,2 0,6 0,2 P_i^1	0,4 0,2 0,4 P_i^2
Наличие поступления, млн. руб.	40 50 60 X_i^1	0 50 100 X_i^2

Определяем математическое ожидание M_1 и M_2 .

Проект 1. $M_1 = 40 \cdot 0,2 + 50 \cdot 0,6 + 60 \cdot 0,2 = 50$ млн. руб.

Проект 2. $M_2 = 0 \cdot 0,4 + 50 \cdot 0,2 + 100 \cdot 0,4 = 50$ млн. руб.

Вроде бы проекты одинаковы по эффективности.

Посмотрим далее среднеквадратичное отклонение – как меру риска:

$$\delta_1 = \sqrt{\sum_1^3 (x_i^1 - M_1)^2 \cdot P_i^1} = \sqrt{(-10)^2 \cdot 0,2 + (0)^2 \cdot 0,6 + (10)^2 \cdot 0,2} = \sqrt{40} = 6,324$$

$$\delta_2 = \sqrt{\sum_1^3 (x_i^2 - M_2)^2 \cdot P_i^2} = \sqrt{(-50)^2 \cdot 0,4 + (0)^2 \cdot 0,2 + (50)^2 \cdot 0,4} = \sqrt{2000} = 44,72$$

Коэффициенты вариации $V = \frac{\delta}{M}$

$$V_1 = \frac{6,324}{50} = 0,129$$

$$V_2 = \frac{44 \cdot 72}{50} = 0,894$$

Вроде бы надо выбрать проект № 1, т.к. он менее рискованный $V_1 < V_2$
 Однако, если считать, что доходность проектов подчинена нормальному закону, то предельная доходность по проектам будет определяться таким образом: $D = M \pm 3\delta$

Проект 1. $D_1 = 50 \pm 3\delta_1 = 50 \pm 3 \cdot 6,324 \quad 31,03 \leq D_1 \leq 68,97$

Проект 2. $D_2 = 50 \pm 3 \cdot 44,72 - 84,16 \leq D_2 \leq 184,16$

Если у акционерного общества есть долг 80 млн. и ему неоткуда ждать помощи, то ему лучше выбрать проект 2, т.к. он если повезет, может не только рассчитаться с долгом, но и получить прибыль. Ну а если не повезет, то уже хуже не будет – все равно банкрот.

4.3. Оценочные средства для промежуточной аттестации

4.3.1. Формируемые компетенции

Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы:

Таблица 4.2

Код компетенции	Наименование компетенции	Этап формирования	Предшествующие и последующие этапы (с указанием дисциплин)
ОПК ОС-4	Способность на основе данных хозяйственного, налогового и бюджетного учетов, учетной документации, бухгалтерской (финансовой), налоговой и статистической отчетности выявлять, предупреждать, локализовать и нейтрализовать внутренние и внешние угрозы и риски деятельности хозяйствующего субъекта	4	<u>Предшествующие и последующие этапы:</u> - Экономическая безопасность; - Статистика; - Бухгалтерский учет; - Финансы; - Деньги, кредит, банки; - Налоги и налогообложение; - Преступления в сфере экономики.
ОПК ОС-6	Способность разрабатывать и принимать экономически и финансово обоснованные организационно-управленческие решения	4	<u>Предшествующие и последующие этапы:</u> - Экономическая теория; - Государственное регулирование экономики; - Экономика организации (предприятия).
ПКо2 ОС-2	Способность использовать методы принятия инвестиционных решений для управления финансами компании	4	<u>Предшествующие и последующие этапы:</u> - Финансы; - Обеспечение экономической безопасности хозяйствующих субъектов; - Управление экономикой организации (предприятия); - Корпоративное управление;

			- Инвестиции и инвестиционный анализ; - Бизнес-планирование.
--	--	--	---

Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся

Показатели, критерии и шкалы оценивания компетенций

Показатели компетенций на различных этапах их формирования в процессе изучения дисциплины:

Табл. 4.3

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
ОПК ОС-4	Способность на основе данных хозяйственного, налогового и бюджетного учетов, учетной документации, бухгалтерской (финансовой), налоговой и статистической отчетности выявлять, предупреждать, локализовать и нейтрализовать внутренние и внешние угрозы и риски деятельности хозяйствующего субъекта	ОПК ОС-4.1	Реализует методы выявления и предупреждения внутренних и внешних угроз и рисков деятельности хозяйствующего субъекта на основе данных учетной документации;
		ОПК ОС-4.2	Применяет методики локализации и нейтрализации внутренних и внешних угроз деятельности хозяйствующего субъекта.
ОПК ОС-6	Способность разрабатывать и принимать экономически и финансово обоснованные организационно-управленческие решения	ОПК ОС-6.1	Применяет экономические и финансовые методы для обоснования организационно-управленческих решений;
		ОПК ОС-6.2	Применяет инструментарий оценки рисков для обоснования организационно-управленческих решений.
ПКo2 ОС-2	Способность использовать методы принятия инвестиционных решений для управления финансами компании	ПКo2 ОС-2.1	Применяет экономические и финансовые методы для обоснования и принятия инвестиционных решений;
		ПКo2 ОС-2.2	Применяет методы принятия инвестиционных решений для управления финансами компании.

Критерием оценивания компетенции является положительный результат по оценочным средствам. Описание шкал оценивания находится в п. 4.4 Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующие этапы формирования компетенций.

Таблица 4.4

Раздел дисциплины, промежуточная аттестация	Формируемые компетенции	Оценочные средства	Шкала оценивания
1, 2,3	ОПК ОС-4 ОПК ОС-6 ПКо2 ОС-2	Тест	10-балльная
		Опрос, задания по теме, задачи	выполнил / не выполнил
4, 5		Тест	10-балльная
		Опрос, задания по темам, задачи	выполнил / не выполнил
6,7		Тест	10-балльная
		Опрос, задания по темам, задачи	выполнил / не выполнил
Зачет	Билет к зачету	5-балльная	

4.3.2. Типовые оценочные средства

Оценочные средства (формы промежуточной аттестации)	Показатели* оценки	Критерии** оценки
Зачет	<p>В соответствии с балльно-рейтинговой системой на промежуточную аттестацию отводится 40 баллов.</p> <p>В билете содержится два теоретических вопроса.</p> <p>Вопросы - 25 баллов</p>	<p>19-25 баллов Обучающийся показывает высокий уровень компетентности, знания программного материала, учебной литературы, раскрывает и анализирует проблему с точки зрения различных авторов. Обучающийся показывает не только высокий уровень теоретических знаний, но и видит междисциплинарные связи. Профессионально, грамотно, последовательно, хорошим языком четко излагает материал, аргументированно формулирует выводы. Знает в рамках требований к направлению и профилю подготовки нормативную и практическую базу. На вопросы отвечает кратко, аргументировано, уверенно, по существу. Способен принимать быстрые и нестандартные решения.</p> <p>10-18 баллов Обучающийся показывает достаточный уровень компетентности, знания материалов занятий, учебной и методической литературы, нормативов и практики его применения. Уверенно и профессионально, грамотным языком, ясно, четко и понятно излагает состояние и суть вопроса. Знает теоретическую и практическую базу, но при ответе допускает несущественные погрешности. Обучающийся показывает достаточный уровень профессиональных знаний, свободно оперирует понятиями, методами оценки принятия решений, имеет представление: о междисциплинарных</p>

		<p>связях, увязывает знания, полученные при изучении различных дисциплин, умеет анализировать практические ситуации, но допускает некоторые погрешности. Ответ построен логично, материал излагается хорошим языком, привлекается информативный и иллюстрированный материал, но при ответе допускает незначительные ошибки, неточности по названным критериям, которые не искажают сути ответа;</p> <p>1-9 баллов Обучающийся показывает слабое знание материалов занятий, отсутствует должная связь между анализом, аргументацией и выводами. На поставленные вопросы отвечает неуверенно, допускает погрешности. Обучающийся владеет практическими навыками, привлекает иллюстративный материал, но чувствует себя неуверенно при анализе междисциплинарных связей. В ответе не всегда присутствует логика, аргументы привлекаются недостаточно веские. На поставленные вопросы затрудняется с ответами, показывает недостаточно глубокие знания.</p> <p>баллов Обучающийся показывает слабые знания материалов занятий, учебной литературы, теории и практики применения изучаемого вопроса, низкий уровень компетентности, неуверенное изложение вопроса. Обучающийся показывает слабый уровень профессиональных знаний, затрудняется при анализе практических ситуаций. Не может привести примеры из реальной практики. Неуверенно и логически непоследовательно излагает материал. Неправильно отвечает на вопросы или затрудняется с ответом.</p>
	<p>В билете содержится одна задача Задача -15 баллов</p>	<p>10-15 баллов многоплановое решение задачи 6-9 баллов стандартное решение задачи с арифметическими ошибками 1-5 баллов задача решена с некоторыми неточностями или не в полной мере 0 баллов неверное решение или задача не решена</p>

Типовые вопросы к зачету:

1. Оценка рисков как наука и учебная дисциплина. Современные подходы к классификации рисков.
2. Место и роль рисков в предпринимательской деятельности.

3. Экономические, правовые и финансовые аспекты предпринимательских рисков.
4. Риск как вероятность неблагоприятного исхода предпринимательской деятельности.
5. Оценка степени предпринимательского риска в условиях неопределенности.
6. Предпринимательские риски и экономическая свобода предпринимательства.
7. Области риска в предпринимательской деятельности. Возникновение рисков при постановке миссии и целей фирмы. Риски развития.
8. Виды банкротства: фиктивное, преднамеренное, реальное, техническое.
9. Причины банкротства: субъективные; объективные; внешние; внутренние.
10. Основные факторы банкротства.
11. Основные подходы к предсказанию банкротства: количественный, качественный, метод интегральной бальной оценки достоинства и недостатки каждого из них.
12. Модель диагностики вероятности банкротства Э.Альтмана: содержание, достоинства и недостатки.
13. Модель диагностики вероятности банкротства У.Бивера: содержание, достоинства и недостатки.
14. Модель оценки вероятности банкротства организации по Р.Лису: содержание, достоинства и недостатки.
15. Модель диагностики вероятности банкротства Р.Таффлера: содержание, достоинства и недостатки.
16. Модель диагностики вероятности банкротства Г.Спрингейта: содержание, достоинства и недостатки.
17. Модель оценки платежеспособности Ж.Конана и М.Голдера: содержание, достоинства и недостатки.
18. Модель оценки вероятности банкротства организации по Дж.Фулмеру: содержание, достоинства и недостатки.
19. Модель прогнозирования банкротства предприятия Р.С.Сайфуллина и Г.Г. Кадыкова: содержание, достоинства и недостатки.
20. Модель прогнозирования банкротства предприятия А.Б.Перфильева.
21. Модель прогнозирования банкротства предприятия Г.В.Савицкой.
22. Модель оценки вероятности банкротства организации по Г.В.Давыдовой и А.Д.Беликову: содержание, достоинства и недостатки.
23. Модель оценки вероятности банкротства организации по А.С.Кучеренко: содержание, достоинства и недостатки.
24. Методика оценки вероятности банкротства организации по Л.В.Донцовой и Н.А.Никифоровой: содержание, достоинства и недостатки.
25. Модель оценки вероятности банкротства организации по В.В.Ковалеву: содержание, достоинства и недостатки.
26. Модель оценки вероятности банкротства организации по А.Н.Жилкиной: содержание, достоинства и недостатки.
27. Показатели финансовой устойчивости.
28. Факторы, оказывающие влияние на деловую активность организации: мезоуровень; микроуровень.
29. Влияние изменений в среде поставщиков на финансовую деятельность предприятий.
30. Макросреда предпринимательства и факторы на нее влияющие.
31. Структура оценки деловой активности: качественные и количественные критерии.
32. Показатели деловой активности.
33. Оценка технического риска на предприятии.
34. Оценка транспортного риска на предприятии.
35. Оценка риска снижения эффективности хранения готовой продукции.
36. Оценка риска снабжения предприятия.
37. Оценка риска снижения эффективности управленческой деятельности предприятия.
38. Оценка риска снижения эффективности сбытовой деятельности предприятия.

39. Оценка риска снижения эффективности структуры управления организации.
40. Оценка риска снижения эффективности системы мотивации персонала организации.
41. Оценка риска снижения эффективности системы трудовой адаптации сотрудников организации.
42. Оценка риска снижения эффективности маркетинга персонала организации.
43. Оценка риска снижения производительности труда персонала организации.
44. Оценка риска снижения эффективности системы повышения квалификации персонала организации.
45. Оценка риска снижения эффективности структуры управления маркетинговой деятельности предприятия.
46. Оценка риска снижения эффективности структуры управления ассортиментом.
47. Оценка риска снижения эффективности ценовой политики организации.
48. Оценка риска снижения эффективности коммуникационной политики организации.
49. Оценка риска снижения эффективности рекламной деятельности.

Шкала оценивания

Оценка результатов производится на основе балльно-рейтинговой системы (БРС). Использование БРС осуществляется в соответствии с приказом от 06 сентября 2019 г. №306 «О применении балльно-рейтинговой системы оценки знаний обучающихся».

Схема расчетов сформирована в соответствии с учебным планом направления, согласована с руководителем научно-образовательного направления, утверждена деканом факультета. Схема расчетов доводится до сведения студентов на первом занятии по данной дисциплине, является составной частью рабочей программы дисциплины и содержит информацию по изучению дисциплины, указанную в Положении о балльно-рейтинговой системе оценки знаний обучающихся в РАНХиГС.

В соответствии с балльно-рейтинговой системой максимально-расчетное количество баллов за семестр составляет 100, из них в рамках дисциплины отводится:

- 40 баллов - на промежуточную аттестацию
- 40 баллов - на работу на семинарских занятиях
- 20 баллов - на посещаемость занятий

В случае если студент в течение семестра не набирает минимальное число баллов, необходимое для сдачи промежуточной аттестации, то он может заработать дополнительные баллы, отработав соответствующие разделы дисциплины, получив от преподавателя компенсирующие задания.

В случае получения на промежуточной аттестации неудовлетворительной оценки студенту предоставляется право повторной аттестации в срок, установленный для ликвидации академической задолженности по итогам соответствующей сессии.

Обучающийся, набравший в ходе текущего контроля в семестре от 51 до 60 баллов, по его желанию может быть освобожден от промежуточной аттестации.

Количество баллов	Оценка	
	прописью	буквой
96-100	отлично	А
86-95	отлично	В

71-85	хорошо	С
61-70	хорошо	D
51-60	удовлетворительно	E

Шкала перевода оценки из многобалльной в систему «зачтено»/«не зачтено»:

от 0 по 50 баллов	«не зачтено»
от 51 по 100 баллов	«зачтено»

4.4. Методические материалы

Зачет может проводиться в форме тестирования с применением ДОТ. Для выполнения тестового задания, прежде всего, следует внимательно прочитать поставленный вопрос. После ознакомления с вопросом следует приступить к прочтению предлагаемых вариантов ответа. Необходимо прочитать все варианты и в качестве ответа следует выбрать лишь один индекс (цифровое обозначение), соответствующий правильному ответу.

Тесты составлены таким образом, что в каждом из них правильным является как один, так и несколько вариантов. На выполнение теста отводится установленное ограниченное время. Как правило, время выполнения тестового задания определяется из расчета 30-45 секунд на один вопрос. После выполнения теста происходит автоматическая оценка выполнения. Результат отображается в личном кабинете обучающегося. Повторное прохождение теста допускается не ранее 10 дней.

Зачет проводится в период сессии в соответствии с текущим графиком учебного процесса, утвержденным в соответствии с установленным в СЗИУ порядком. Продолжительность зачета для каждого студента не может превышать четырех академических часов. Зачет не может начинаться ранее 9.00 часов и заканчиваться позднее 21.00 часа. Зачет проводится в аудитории, в которую запускаются одновременно не более 5 человек. Время на подготовку ответов по билету каждому обучающемуся отводится 45 минут. При явке на зачет обучающийся должен иметь при себе зачетную книжку. Во время зачета обучающиеся по решению преподавателя могут пользоваться учебной программой дисциплины и справочной литературой и калькулятором.

5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Целью данных методических рекомендаций по изучению учебной дисциплины «Оценка рисков» является обеспечение эффективности работы студентов с материалами дисциплины на основе рациональной организации ее изучения.

Изучение дисциплины предполагает применение ДОТ, поэтому как лекционные, так и практические занятия могут проводиться с применением ДОТ.

Несмотря на наличие учебников, которые для студентов являются основным источником информации, очень часто возникают ситуации, когда изменения в окружающей среде (например, в законодательстве и пр.) по конкретной теме не находят отражения в существующих учебниках или некоторые его разделы устарели, поэтому, лекции остаются основной формой обучения.

Отдельные темы дисциплины могут быть трудны для самостоятельного изучения студентами, поэтому необходима методическая переработка материала лектором. При существовании разнообразных концепций по отдельным темам лекции необходимы для их объективного освещения.

Поэтому посещение лекций (как очное, так и с применением ДОТ) по дисциплине обязательно для студентов.

Кроме того, для успешного овладения дисциплиной необходимо выполнять следующие требования:

1) посещать все лекционные и практические занятия (в том числе с применением ДОТ), поскольку весь тематический материал взаимосвязан между собой и теоретического овладения пропущенного недостаточно для качественного усвоения знаний по дисциплине;

2) все рассматриваемые на лекциях и практических занятиях темы и вопросы обязательно фиксировать (либо на бумажных, либо на машинных носителях информации), дополнительно сохранять материалы из ДОТ;

3) обязательно выполнять все домашние задания, получаемые на лекциях или практических занятиях;

4) проявлять активность на интерактивных лекциях и практических занятиях, а также при подготовке к ним. Необходимо помнить, что конечный результат овладения содержанием дисциплины необходим, в первую очередь, самому студенту;

5) в случаях пропуска занятий по каким-либо причинам, необходимо обязательно самостоятельно изучать соответствующий материал.

Существенным моментом для студента является возможность обсуждения и внесения предложений в тематический материал дисциплины. При этом необходим серьезный и глубокий критический анализ прочитанной научной литературы и содержания прослушанной по теме лекции.

Студенту также необходимо знать следующее:

Семинарские (практические) занятия по изучаемой дисциплине проводятся с целью изучения как теоретических вопросов, связанных с овладением знаниями, так и практической стороны, связанной с основными принципами и приемами, изучаемыми в рамках курса.

Уровень усвоения теоретического материала проверяется посредством опроса по основным вопросам темы. При выполнении практических заданий обучающимся следует обосновывать свои ответы ссылками на источники, законодательные и нормативные документы. В методических материалах используются реальные практические ситуации, которые встречаются на предприятиях и в организациях. Обучающимся следует высказывать свое суждение в неоднозначных ситуациях в области изучаемой темы дисциплины.

Приведенные в методических материалах практические задания решаются аудиторно или с применением ДОТ.

Практические задания по материалам условного предприятия помогут приобрести навыки работы с различными данными и прочей информацией.

Задания в виде кейсовых ситуаций направлены на развитие логического мышления, представляют возможность обучающимся сформулировать и высказать самостоятельные суждения и являются достаточно эффективным способом закрепления полученных теоретических знаний.

Уровень усвоения практического материала проверяется посредством выполнения письменных заданий, основанных на информации, взятой из существующей практики.

Контрольные вопросы предназначены для проверки качества усвоения лекционного материала и материала, изученного обучающимися самостоятельно по рекомендуемой основной и дополнительной литературе. Ответы на контрольные вопросы готовятся обучающимися самостоятельно и проверяются преподавателем на практических занятиях в ходе устного опроса, а также при проведении контрольных работ, текущего тестирования. Наиболее сложные вопросы обсуждаются с преподавателем на текущих практических занятиях.

Самостоятельная работа является неотъемлемой и важнейшей частью работы обучающихся, которая основана на более подробной проработке и анализе информации в изучаемой области. Поиск ответов на вопросы для самостоятельной работы в некоторых случаях предполагает не только изучение основной учебной литературы по дисциплине, но и привлечение дополнительной литературы по смежным дисциплинам, а также использование ресурсов сети Интернет. Ответы на вопросы для самостоятельной работы

готовятся обучающимися самостоятельно и проверяются преподавателем на практических занятиях в ходе устного опроса, а также при проведении контрольных работ, текущего тестирования.

Самостоятельная работа студентов – это процесс активного, целенаправленного приобретения студентом новых знаний, умений без непосредственного участия преподавателя, характеризующийся предметной направленностью, эффективным контролем и оценкой результатов деятельности обучающегося.

Цели самостоятельной работы:

- систематизация и закрепление полученных теоретических знаний и практических умений студентов;
- углубление и расширение теоретических знаний;
- формирование умений использовать нормативную и справочную документацию, специальную литературу;
- развитие познавательных способностей, активности студентов, ответственности и организованности;
- формирование самостоятельности мышления, творческой инициативы, способностей к саморазвитию, самосовершенствованию и самореализации;
- развитие исследовательских умений и академических навыков.

Самостоятельная работа может осуществляться индивидуально или группами студентов в зависимости от цели, объема, уровня сложности, конкретной тематики.

Технология организации самостоятельной работы студентов включает использование информационных и материально-технических ресурсов образовательного учреждения.

Перед выполнением обучающимися внеаудиторной самостоятельной работы преподаватель может проводить инструктаж по выполнению задания. В инструктаж включается:

- цель и содержание задания;
- сроки выполнения;
- ориентировочный объем работы;
- основные требования к результатам работы и критерии оценки;
- возможные типичные ошибки при выполнении.

Инструктаж проводится преподавателем за счет объема времени, отведенного на изучение дисциплины.

Контроль результатов внеаудиторной самостоятельной работы студентов может проходить в письменной, устной или смешанной форме с применением ДОТ.

Студенты должны подходить к самостоятельной работе как к наиважнейшему средству закрепления и развития теоретических знаний, выработке единства взглядов на отдельные вопросы курса, приобретения определенных навыков и использования профессиональной литературы.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся должны быть оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду организации.

При самостоятельной проработке курса обучающиеся должны:

- просматривать основные определения и факты;
- повторить законспектированный на лекционном занятии материал и дополнить его с учетом рекомендованной по данной теме литературы;
- изучить рекомендованную литературу, составлять тезисы, аннотации и конспекты наиболее важных моментов;
- самостоятельно выполнять задания, аналогичные предлагаемым на занятиях;
- использовать для самопроверки материалы фонда оценочных средств;
- выполнять домашние задания по указанию преподавателя.

Задания для практических занятий и самостоятельной работы позволяют преподавателю применять интерактивные формы обучения при проведении аудиторных занятий и занятий с применением ДОТ, при самостоятельной работе студентов в виде дискуссий, диспутов, ролевых игр, обсуждения конкретных ситуаций в профессиональной деятельности обучающихся.

Результат студенческих ответов оценивается по следующим критериям: полнота раскрытия вопросов по каждому заданию; степень самостоятельности выполнения задания; оформление работы и ее презентация; исполнение сроков предоставления выполненных заданий; способность отвечать на вопросы преподавателя и студентов в ходе дискуссий по заданной научной теме.

Цель выполнения практических заданий по дисциплине – приобретение практических навыков разработки и принятия управленческих решений.

Выполнение практических заданий требует от обучающегося предварительного изучения лекционного материала, учебной и научной литературы и прочих информационных источников, в том числе периодических изданий и Интернет–ресурсов. Каждое задание объясняется преподавателем либо содержит краткие методические указания к его выполнению. Само задание не распечатывается, сдается только решение задачи или ответ на задание (достаточно указание номера и наименования задания).

Расчетные задания, выполненные в Excel, сдаются в виде распечаток (недостаточно приведения только полученных результатов без промежуточных расчетов).

Текстовые задания – эссе, решения кейсов и пр. не должны превышать 1-2 страницы печатного текста. В случае совпадения текстов у двух и более студентов задание зачитывается только у одного студента (первого, сдавшего это задание).

Задания по подготовке докладов требуют от студентов большой самостоятельности и серьезной интеллектуальной работы. Она включает несколько этапов и предусматривает длительную, систематическую работу студентов и помощь педагогов по мере необходимости:

- составляется план доклада путем обобщения и логического построения материала доклада;
- подбираются основные источники информации;
- систематизируются полученные сведения путем изучения наиболее важных научных работ по данной теме, перечень которых, возможно, дает сам преподаватель;
- делаются выводы и обобщения в результате анализа изученного материала, выделения наиболее значимых для раскрытия темы доклада фактов, мнений разных ученых и требования нормативных документов.

К докладу по укрупненной теме могут привлекаться несколько студентов, между которыми распределяются вопросы выступления.

Доклад должен сопровождаться презентационным материалом.

Сроки сдачи заданий регулируются преподавателем (как правило, предельный срок – зачетная неделя).

Методические рекомендации по работе с литературой

Изучение литературы очень трудоемкая и ответственная часть подготовки к семинарскому занятию. Она, как правило, сопровождается записями в той или иной форме.

Конспектом называется краткая схематическая запись основного содержания научной работы. Обычно конспект составляется в два этапа. На первом студент читает произведение и делает пометки на полях, выделяя таким образом наиболее важные мысли. На втором этапе студент, опираясь на сделанные пометки, кратко, своими словами записывает содержание прочитанного. Желательно использование логических схем, делающих наглядным ход мысли конспектируемого автора. Например, если рассуждения автора представляют достаточно сложную и длинную цепочку, то в конспекте может появиться запись: «Из А следует В, а из В С, следовательно, С является прямым следствием

А». Наиболее важные положения изучаемой работы (определения, выводы и т.д.) желательно записать в форме точных цитат (в кавычках, с точным указанием страницы источника).

Следует иметь в виду, что целью конспектирования является не переписывание произведения, а выявление его логики, системы доказательств, основных выводов. Поэтому хороший конспект должен сочетать полноту изложения с краткостью. Особенно четко это проявляется при конспектировании работ в электронной форме. Чтобы полностью скопировать работу, достаточно нажать кнопку «печать», но считаться конспектом такое ее воспроизведение не будет.

Существует несколько форм ведения записей: план (простой или развернутый), выписки, тезисы, аннотации, резюме, конспект (текстуальный и тематический).

План. Это наиболее краткая форма записи прочитанного. Перечень вопросов, рассматриваемых в книге, статье. План раскрывает логику автора, способствует лучшей ориентации в содержании данного произведения. План может составляться либо по ходу чтения материала, либо после полного прочтения. План во втором случае получается последовательным и стройным, кратким. Форма плана не исключает цитирования отдельных мест, обобщения более поздних материалов.

Выписки. Это либо цитаты, то есть дословное изложение того или иного материала из источника, необходимые студенту для изложения в курсовой работе, либо краткое, близкое к дословному изложение мест из источника, данное в понимании студента. Выписки лучше делать на отдельных листах или на карточках. Достоинство выписок состоит в точности воспроизведения авторского текста, в накоплении фактического материала, удобстве их использования при компоновке курсовой работы. Выделяя из прочитанного текста самое главное и существенное, студент при составлении выписок глубже понимает читаемый текст. Составление выписок не только не отнимает у студента время, но, напротив, экономит его, сокращая его на неоднократное возвращение к данному источнику при написании текста курсовой работы. Совершенно обязательно каждую выписку снабжать ссылкой на источник с указанием соответствующей страницы.

Тезисы. Это сжатое изложение основных мыслей и положений прочитанного материала. Их особенность – утвердительный характер. Другими словами, для автора этих тезисов данное умозаключение носят недискуссионный позитивный характер.

Аннотация. Очень краткое изложение содержания прочитанной работы. Составляется после полного прочтения и глубокого осмысливания изучаемого произведения.

Резюме. Краткая оценка прочитанного произведения. Отражает наиболее общие выводы и положения работы, ее концептуальные итоги.

Конспект. Небольшое сжатое изложение изучаемой работы, в котором выделяется самое основное, существенное. Основные требования – краткость, четкость формулировок, обобщение важнейших теоретических положений. Составление конспекта требует вдумчивости, достаточно больших затрат времени и усилий. Конспект – это средство накопления материала для будущей курсовой работы. Конспектирование способствует глубокому пониманию и прочному усвоению изучаемого материала, помогает вырабатывать навыки правильного изложения в письменной форме важнейших теоретических и практических вопросов, умение четко их формулировать, ясно излагать своими словами.

Конспект может быть текстуальным и тематическим. *Текстуальный* конспект посвящен определенному произведению, *тематический* конспект посвящен конкретной теме, следовательно, нескольким произведениям. В текстуальном конспекте сохраняется логика и структура изучаемого текста, запись идет в соответствии с расположением материала в изучаемой работе. В тематическом конспекте за основу берется не план работы, а содержание темы, проблемы, изучаемые студентом.

Целесообразно составлять конспект после полного прочтения изучаемого материала. Конспект может включать тезисы, краткие записи не только тех или иных положений и выводов, но и доказательств, фактического материала, а также выписки, дословные цитаты, различные примеры, цифровой материал, таблицы, схемы, взятые из конспектируемого источника. При оформлении конспекта необходимо указать фамилию автора изучаемого материала, полное название работы, место и год ее издания. Полезно отмечать и страницы изучаемой работы.

В конспекте надо выделять отдельные места текста в зависимости от их значимости (подчеркивания цветными маркерами, замечания на полях). Для записей всех форм целесообразно, в соответствии с планом курсовой, завести папки или большие конверты, в которые раскладываются записи по обработанным источникам.

При этом важно не только привлечь более широкий круг литературы, но и суметь на ее основе разобраться в степени изученности темы. Стоит выявить дискуссионные вопросы, нерешенные проблемы, попытаться высказать свое отношение к ним. Привести и аргументировать свою точку зрения или отметить, какой из имеющихся в литературе точек зрения по данной проблематике придерживается автор и почему.

Работа с тестовой системой

Тестовая система представляет собой развитие системы контрольных вопросов. Она предназначена для самопроверки в ходе изучения материалов дисциплины, для рубежного контроля знаний. Материалы для тестовой системы представляют собой набор тестовых заданий, позволяющих определить освоение всех фрагментов учебной программы. Тестирование осуществляется с применением ДОТ.

6 Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», включая перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

6.1 Основная учебная литература:

1. Воронцовский, А. В. Оценка рисков : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 179 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02411-1. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait-ru.ezproxy.ranepa.ru:2443/bcode/471513> (дата обращения: 29.06.2021).

2. Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе : учебник и практикум для вузов / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 381 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00375-8. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait-ru.ezproxy.ranepa.ru:2443/bcode/468977> (дата обращения: 29.06.2021).

Вспомогательная учебная литература:

1. Савицкая, Г. В. Анализ эффективности и рисков предпринимательской деятельности: методологические аспекты. – М.:ИНФРА-М, 2010. – 271 с.
2. Разработка системы управления рисками и капиталом (вподк) : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / А. Д. Дугин [и др.] ; под научной редакцией А. Д. Дугина, Г. И. Пеникаса. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 367 с. — (Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-9916-4949-0. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://idp.nwipa.ru:2254/bcode/437045>
3. Рягин, Ю. И. Рискология в 2 ч. Часть 1 : учебник для вузов / Ю. И. Рягин. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 255 с. — (Университеты России). — ISBN 978-5-534-01680-2. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://idp.nwipa.ru:2254/bcode/438050>
4. Рягин, Ю. И. Рискология в 2 ч. Часть 2 : учебник для вузов / Ю. И. Рягин. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 275 с. — (Университеты России). — ISBN 978-5-534-01682-

6. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://idp.nwipa.ru:2254/bcode/438051>
5. Балдин, К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учеб. пособие / К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов. - 2-е изд. - М. Дашков и К, 2015. - 418 с. <http://idp.nwipa.ru:2228/reading.php?productid=342620>

6.2. Дополнительная учебная литература:

1. Николаева, И.П. Инвестиции : учебник, рек. уполномоч. учреждением М-ва образования и науки РФ / И. П. Николаева. - М. : Дашков и К, 2012. - 253 с.
2. Новиков, А.И. Теория принятия решений и управление рисками в финансовой и налоговой сферах : учеб. пособие / А. И. Новиков, Т. И. Солодка. - М. : Дашков и К, 2012. - 284 с. <http://ibooks.ru/reading.php?productid=342620>
3. Селищев, А.С. Рынок ценных бумаг : учебник для бакалавров ... обучающихся по эконом. направлениям и специальностям / А. С. Селищев, Г. А. Маховикова ; С.-Петерб. гос. ун-т экономики и финансов. - М. : Юрайт, 2012. - 431 с.
4. Финансовый менеджмент : проблемы и решения : учебник для магистров / [А.З. Бобылева и др.] ; под ред. А.З. Бобылевой. - М. : Юрайт, 2012. - 903 с.
5. Шарп, У.Ф. Инвестиции : [учебник] для студентов вузов, обучающихся по эконом. специальностям: соответствует Федер. гос. образоват. стандарту 3-го поколения / Уильям Ф. Шарп, Гордон Дж. Александер, Джеффри В. Бэйли ; пер. с англ. [А. Н. Буренина, А. А. Васина]. - М. : ИНФРА-М, 2012. - 1039 с.
6. Виленский П.Л., Лившиц В.Н., Смоляк С.А. Оценка эффективности инвестиционных проектов, М., Изд-во Дело, 2002; 888с.
7. Клоков В.И. Финансовые рынки, учебное пособие, изд-во. СЗАГС, СПб., 2005, 96.
8. Клоков В.И. Инвестиции, учебное пособие, изд-во. СЗАГС, СПб., 2009, 203.
9. Мельников А.В., Попова Н.В., Скорнякова В.С. Математические методы финансового анализа., М., Изд-во Анкил, 2006, 440с.
10. Печенежская Н.А. Финансовая математика: сборник задач., Ростов н/Д, Изд-во Феникс, 2008, 188с
11. Просветов Г.И. Управление рисками: задачи и решения. Учебно-практическое пособие, М., Изд-во Альфа-Пресс, 2008, 416с.
12. Самаров К.Л. Финансовая математика., Сборник задач с решениями, Учебное пособие, М., Изд-во Альфа-М, Инфра-М, 2009, 90с.
13. Шапкин А.С., Шапкин В.С. Теория риска и моделирование рискованных ситуаций, Учебник, М., Издательско-торговая корпорация «Дашков и К», 2006, 880с.
14. Кузнецов Б.Т. Инвестиции учеб. пособие. 2-е изд., М. ЮНИТИ-ДАНА, 2010. – 623с

6.3 Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы:

СЗИУ располагает доступом через сайт научной библиотеки <http://nwapa.spb.ru/> к следующим подписным электронным ресурсам:

Русскоязычные ресурсы

- Электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «Айбукс»
- Электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «Юрайт»
- Электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «Лань»
- Научно-практические статьи по финансам и менеджменту Издательского дома «Библиотека Гребенникова»
- Статьи из периодических изданий по общественным и гуманитарным наукам «ИстВью»

- Энциклопедии, словари, справочники «Рубрикон»
- Полные тексты диссертаций и авторефератов *Электронная Библиотека Диссертаций* РГБ
- Информационно-правовые базы *Консультант плюс, Гарант*.

Англоязычные ресурсы

EBSCO Publishing – доступ к мультидисциплинарным полнотекстовым базам данных различных мировых издательств по бизнесу, экономике, финансам, бухгалтерскому учету, гуманитарным и естественным областям знаний, рефератам и полным текстам публикаций из научных и научно-популярных журналов;

Emerald – крупнейшее мировое издательство, специализирующееся на электронных журналах и базах данных по экономике и менеджменту. Имеет статус основного источника профессиональной информации для преподавателей, исследователей и специалистов в области менеджмента.

6.4. Нормативные правовые документы:

1. <http://www.gks.ru/> - Федеральная служба государственной статистики
2. <http://www.consultant.ru/>-Консультант плюс
3. <http://www.garant.ru/> - Гарант

6.5. Интернет-ресурсы:

1. Электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «Айбукс»
http://www.nwapa.spb.ru/index.php?page_id=76
2. Научно-практические статьи по экономике и финансам Электронной библиотеки ИД «Гребенников» http://www.nwapa.spb.ru/index.php?page_id=76
3. Статьи из журналов и статистических изданий Ист Вью
http://www.nwapa.spb.ru/index.php?page_id=76
4. www.nnir.ru / - Российская национальная библиотека
5. www.nns.ru / - Национальная электронная библиотека
6. www.rsi.ru / - Российская государственная библиотека
7. <http://www.uecs.ru/> - Управление экономическими системами
8. www.biznes-karta.ru / - Агентство деловой информации «Бизнес-карта»
9. www.rbs.ru / - Информационное агентство «РосБизнесКонсалтинг»
10. www.aport.ru / - Поисковая система
11. www.busineslearning.ru / - Система дистанционного бизнес образования
12. <http://www.gks.ru/> - Федеральная служба государственной статистики
13. <http://www.consultant.ru/>-Консультант плюс
14. <http://www.garant.ru/> - Гарант

6.6 Иные источники

1. EBSCO Publishing - доступ к журналам таких издательств как Blackwell publishers, Springer, Elsevier, Harvard business school, Taylor and Francis, Academy of Management, Transaction publishers, American institute of physics, University of california press и многие другие.
2. Мировое издательство Emerald eJournals Premier - электронное собрание рецензируемых журналов по всем основным дисциплинам менеджмента
3. Архив научных журналов 2011 Cambridge Journals Digital Archive Complete Collection издательства Cambridge University Press:
<http://journals.cambridge.org/action/displaySpecialPage?pageId=3092&archive=3092>
4. Международное издательство SAGE Publications (штаб-квартиры в США, Великобритании (Лондон), Индии)
5. Американское издательство Annual Reviews

6. Oxford Journals Archive - архив политематических научных журналов издательства Oxford University Press.
7. T&F 2011 Journal Archives Collection - архив научных журналов издательства Taylor and Francis.
8. The American Association for the Advancement of Science (AAAS) - цифровой архив статей журнала Science.
9. Nature journal Digital archive - цифровой архив журнала Nature издательства Nature Publishing Group.

7. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы

№ п/п	Наименование
1.	Специализированные залы для проведения лекций.
2.	Специализированная мебель и оргсредства: аудитории и компьютерные классы, оборудованные посадочными местами (в том числе для проведения занятий лабораторного типа).
3.	Технические средства обучения: Многофункциональный мультимедийный комплекс в лекционной аудитории; звуковые динамики; программные средства, обеспечивающие просмотр видеофайлов.
4.	Персональные компьютеры с доступом к электронному каталогу, полнотекстовым базам, подписным ресурсам и базам данных научной библиотеки СЗИУ РАНХиГС.
5.	Технические средства обучения: Персональные компьютеры; компьютерные проекторы; звуковые динамики; программные средства, обеспечивающие просмотр видеофайлов в форматах AVI, MPEG-4, DivX, RMVB, WMV.