

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Андрей Драгомирович Хлутков
Должность: директор
Дата подписания: 16.06.2026 21:30:38
Уникальный программный ключ:
880f7c07c583b07b775f6604a630281b13ca9fd2

Приложение 4
к образовательной программе

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.ДЭ.02.02 «Управление рисками»

(индекс, наименование дисциплины в соответствии с учебным планом)

38.04.02 Менеджмент

(код, наименование направления подготовки)

Программа магистратуры

Антикризисный менеджмент

(наименование образовательной программы)

Очная / заочная форма обучения

(форма обучения)

Год набора – 2026 г.

Санкт-Петербург, 2026 г.

Автор-составитель РПД:

Куликов Алексей Дмитриевич к.э.н., доцент, доцент кафедры менеджмента факультета экономики и финансов СЗИУ РАНХиГС, г. Санкт-Петербург

Лабудин Александр Васильевич д.э.н., профессор Заведующий кафедрой менеджмента факультета экономики и финансов СЗИУ РАНХиГС, г. Санкт-Петербург

Рабочая программа дисциплины Б1.В.ДЭ.02.02 «Управление рисками» одобрена на заседании кафедры менеджмента факультета экономики и финансов СЗИУ РАНХиГС.

Протокол №8 от 02 апреля 2026 г.

СОДЕРЖАНИЕ

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы
2. Объем и место дисциплины в структуре образовательной программы
3. Содержание и структура дисциплины
4. Типы оценочных материалов, показатели и критерии их оценивания
5. Формы аттестации, типовые оценочные материалы для текущего контроля успеваемости обучающихся, критерии и шкалы оценивания по контрольным точкам
6. Формы промежуточной аттестации, критерии и шкала оценивания, типовые оценочные материалы по дисциплине
7. Методические материалы по освоению дисциплины
8. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»
9. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы

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

1.1. Дисциплина **Б1.В.ДЭ.02.02 «Управление рисками»** обеспечивает овладение следующими компетенциями с учетом этапа:

ОТФ/ ТФ и реквизи ты ПС (при наличии)* *	Код комп етенц ии **	Наименование Компетенции* *	Код индика тора достиж ения компет енций* *	Наименов ание индикатора достижения компетенци й**	Образовательный результат**
D/07.7 Руководст во самостоят ельным специальн ым подраздел ением внутренне го контроля / Руководст во разработко й предложен ий о внесении изменений в нормативн ую базу и в методики проведени я внутренне го контроля	ПКс-1	Способность провести комплексную диагностику финансового состояния организации на основе действующих нормативных документов	ПКс-1.2	Способен проводить комплексную диагностику финансового состояния организации	<u>ПКс-1.2 З-1</u> Знает: - основы бизнес-планирования, методики контроля и реализации бизнес-планов, знать базовые условия заключаемых соглашений, договоров и контрактов, - знать методический инструментарий реализации управленческих решений в области функционального менеджмента для достижения высокой согласованности при выполнении конкретных проектов и работ.
					<u>ПКс-1.2 У-1</u> Умеет: <ul style="list-style-type: none"> • поэтапно контролировать реализацию бизнес-планов и условий заключаемых соглашений, договоров и контрактов, • координировать деятельность исполнителей с помощью методического инструментария реализации управленческих решений в области функционального менеджмента для достижения высокой согласованности при выполнении конкретных проектов и работ
					<u>ПКс-1.2. Н-1</u> Имеет навыки: - поэтапного контроля реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений, договоров и контрактов, умением координировать деятельность исполнителей с помощью методического инструментария реализации управленческих решений в области функционального менеджмента для достижения высокой согласованности при выполнении конкретных проектов и работ

* Дисциплина может формировать компетенцию полностью или частично.

** Должно соответствовать Приложению 1 к образовательной программе

Объем и место дисциплины в структуре образовательной программы

Объём дисциплины.

Объем дисциплины и виды учебной работы.

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетные единицы; 108 академических (81 астрономических часов).

Дисциплина реализуется частично с применением дистанционных образовательных технологий (далее – ДОТ).

Доступ к системе дистанционных образовательных технологий осуществляется каждым обучающимся самостоятельно с любого устройства на портале: <https://lms.ranepa.ru/>. Пароль и логин к личному кабинету/профилю предоставляется студенту в деканате.

Теоретические занятия (лекции) проводятся по потокам. Общий объем лекционного курса составляет 6 (ЗО - 4) академических часов.

Практические занятия организуются по группам в виде семинаров в диалоговом режиме. Общий объем практических занятий 14 (ЗО - 6) академических часов.

Программой предусмотрена самостоятельная работа магистров в объеме 59 (ЗО – 87) академических часов. В рамках самостоятельной работы студенты изучают теоретический материал в целях подготовки к устному опросу, презентациям и тестированию, выполняют кейсы.

Место дисциплины в структуре ОП ВО

Учебная дисциплина Б1.В.ДЭ.02.02 «Управление рисками» относится к дисциплинам по выбору части, формируемой участниками образовательных отношений Блока 1 «Дисциплины». Учебная дисциплина базируется на знаниях, полученных на дисциплинах: Теория организации, Экономика и управление организацией. Знания, полученные в результате освоения дисциплины Б1.В.ДЭ.02.02 «Управление рисками», могут использоваться при прохождении обучающимися практики по профилю профессиональной деятельности (организационно-управленческой). Формы промежуточной аттестации определяется в соответствии с учебным планом - экзамен.

Доступ к системе дистанционных образовательных технологий осуществляется каждым обучающимся самостоятельно с любого устройства, и том числе на портале: <https://lms.ranepa.ru/>. Пароль и логин к личному кабинету / профилю предоставляется студенту в деканате.

3. Содержание и структура дисциплины

3.1. Структура дисциплины

Очная форма обучения

№ п/п	Наименование тем (разделов),	Объем дисциплины, час.										Форма текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации*	
		Всего	Контактная работа обучающихся с Преподавателем по видам учебных занятий							Самостоятельная работа			
			Период теоретического обучения				Период промежуточной аттестации (сессия)						
			Занятия лекционного типа		Занятия семинарского типа	ИК	КСР	КЭ	Катэк	Контр	СРэк		СР
Л	ВЛ	ПЗ											
Тема 1	Области проявления финансово-экономических рисков. Оценка риск-менеджмента	21	1	4					2		2	12	О,Д,Т,К
Тема 2	Экономическая сущность инвестиций. Определение удельного веса простого риска	23	1	4					2		4	12	О,Д,Т,К
Тема 3	Оценка и управление рисками инвестиционного проекта. Расчет бальной оценки.	21	1	2					2		4	12	О,Д,Т,К
Тема 4	Классификация рисков. Разделения рисков на конкретные группы по определенным признакам	21	1	2					2		4	12	О,Д,Т,К
Тема 5	Риск как объект диагностики и оценки. Управленческий механизм риск-	20	2	2					1		4	11	О,Д,Т,К

	менеджмента											
Промежуточная аттестация		2					2					экзамен
Всего акад. часов:		108	6	14			2	9	18		59	

Используемые сокращения:

Л – лекции - занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации обучающимся педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях,).

ВЛ – видео лекции.

ЛР – лабораторные работы.

ПЗ – практические занятия (за исключением лабораторных работ).

ИК – индивидуальные консультации.

КСР – контроль самостоятельной работы

КЭ – консультации перед экзаменом

Каттэк – контактная работа на аттестацию в период экзаменационных сессий

Контроль - контактная работа на аттестацию в период экзаменационных сессий для заочной формы обучения

СР – самостоятельная работа на подготовку курсовой работы/ курсового проекта.

СРэк – самостоятельная работа на подготовку к экзамену.

СР – самостоятельная работа в семестре на подготовку к учебным занятиям.

Примечание: Д-доклад; О-устный опрос; Т-тестирование; К- кейс

Заочная форма обучения

№ п/п	Наименование тем (разделов),	Объем дисциплины, час.									Форма текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации *	
		Всего	Контактная работа обучающихся с Преподавателем по видам учебных занятий						Самостоятельная работа			
			Период теоретического обучения			Период промежуточной аттестации (сессия)			СРэк	СР		
			Занятия лекционного типа	Занятия семинарского типа	И К	КСР	КЭ	Катэк			Кон роль	
			Л	ВЛ	ПЗ							
Тема 1	Области проявления финансово-экономических рисков. Оценка риск-менеджмента	23	1		2					2	18	О,Д,Т,К
Тема 2	Экономическая сущность инвестиций. Определение удельного веса простого риска	22	1		1					2	18	О,Д,Т,К
Тема 3	Оценка и управление рисками инвестиций	22	1		1					2	18	О,Д,Т,К

	ного проекта. Расчет бальной оценки.											
Тема 4	Классификация рисков. Разделения рисков на конкретные группы по определенным признакам	22	1		1				2		18	О,Д,Т,К
Тема 5	Риск как объект диагностики и оценки. Управленческий механизм риск-менеджмента	17	-		1				1		15	О,Д,Т,К
Промежуточная аттестация		2						2				экзамен
Всего акад. часов:		108	4		6			2		9	87	

Используемые сокращения:

Л – лекции - занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации обучающимся педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях,).

ВЛ – видео лекции.

ЛР – лабораторные работы.

ПЗ – практические занятия (за исключением лабораторных работ).

ИК – индивидуальные консультации.

КСР – контроль самостоятельной работы

КЭ – консультации перед экзаменом

Каттэк – контактная работа на аттестацию в период экзаменационных сессий

Контроль - контактная работа на аттестацию в период экзаменационных сессий для заочной формы обучения

СР – самостоятельная работа на подготовку курсовой работы/ курсового проекта.

СРэк – самостоятельная работа на подготовку к экзамену.

СР – самостоятельная работа в семестре на подготовку к учебным занятиям.

Примечание: Д-доклад; О-устный опрос; Т-тестирование; К- кейс

3.2. Содержание дисциплины

Тема 1. Области проявления финансово-экономических рисков. Оценка риск-менеджмента. ПКс-1.2.

Понятия интереса (процентной ставки), дисконта и дисконт – фактора. Кредитование, дисконтирование и оценка эффективной ставки финансовой сделки. Расчет кредитования по схеме простых процентов. Расчет кредитования по схеме сложных процентов. Сравнение кредитования по схеме простых и сложных процентов. Расчет кредитования по схеме смешанных (комбинированных) процентов. Расчет дисконтирования по схеме простых процентов. Расчет дисконтирования по схеме сложных процентов. Дисконт – фактор. Дискретные вычисления и методы расчета в непрерывном случае, когда процент кредитования или дисконтирования начисляется непрерывно. Эффективная ставка финансовой сделки.

Тема 2. Экономическая сущность инвестиций. Определение удельного веса простого риска. ПКс-1.2.

Экономическая сущность и виды инвестиций. Инвестиционный процесс. Финансовые институты. Финансовые рынки. Участники инвестиционного процесса. Типы инвесторов. Экономическая сущность, значение и цели инвестирования. Иностраннные инвестиции. Режим функционирования иностранного капитала в России. Бюджетное финансирование, самофинансирование, акционирование. Методы долгового финансирования. Внешние и внутренние финансовые рынки. Долгосрочное кредитование. Лизинг, виды и преимущества. Проектное финансирование. Венчурное финансирование. Ипотечное кредитование. Понятие инвестиционного проекта, содержание, классификация, фазы развития. Критерии оценки (показатели) эффективности инвестиционного проекта: чистое современное значение NPV4.

Тема 3. Оценка и управление рисками инвестиционного проекта. Расчет бальной оценки. ПКс-1.2.

Понятия финансового риска. Вероятностный подход к оценке потоков платежей. Оценка и управление рисками инвестиционного проекта: вероятностный подход к оценке риска инвестиционного проекта; мультисценарный подход к оценке риска; чувствительность показателей эффективности инвестиционного проекта к параметрам; оценка вероятности окупаемости инвестиционного проекта; оценка риска от внезапного падения доходов. Основные функции Excel и программы Project 6.0 для оценки эффективности и управления рисками инвестиционного проекта.

Тема 4. Классификация рисков. Разделения рисков на конкретные группы по определенным признакам. ПКс-1.2.

Разделения рисков на конкретные группы по определенным признакам. Понятия финансового риска на фондовом рынке. Портфель ценных бумаг. Основные понятия. Ожидаемая доходность ценных бумаг. Ковариационная и корреляционная матрица для эффективностей ценных бумаг. Оценка дохода и риска портфеля ценных бумаг. Оценка риска портфеля из независимых ценных бумаг. Диверсификация портфеля. Оценка риска портфеля из коррелированных ценных бумаг. Оценка риска портфеля из анти коррелированных ценных бумаг.

Тема 5. Риск как объект диагностики и оценки. Управленческий механизм риск-менеджмента. ПКс-1.2.

Основы управленческой диагностики рисков. Формула риска. Преобразование базовой продвинутой формулы риска. Таксономия рисков. Пирамида риска: факторы, симптомы, бифуркации, контроль. Риск как объект диагностики и оценки. Модель функции риск-менеджмента в управлении фирмой. Распределение обязанностей по управлению рисками: карты распределения ответственности. Защита от стратегических рисков. Подпрограмма защиты непрерывности бизнеса. Рутинный риск-менеджмент. Чрезвычайная ситуация. Управленческий механизм риск-менеджмента.

4. Типы оценочных материалов, показатели и критерии оценивания

1.1. Оценочные материалы по дисциплине Б1.В.ДЭ.02.02 «Управление

рисками» входят в состав оценочных материалов по образовательной программе. Совокупность оценочных материалов по всем дисциплинам образовательной программы составляет фонд оценочных средств (далее – ФОС). ФОС используется при проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся с целью оценивания достижения обучающимися планируемых результатов обучения.

4.2. ФОС разработан как комплекс проверочных заданий различного типа и уровня сложности, включает критерии и шкалы оценивания, а также «ключи» правильных ответов. ФОС формируется как отдельный документ и хранится в электронном виде, доступ к ФОС предоставлен ограниченному кругу лиц.

4.3. Для самостоятельной работы обучающихся при подготовке к текущему контролю успеваемости и промежуточной аттестации в рабочих программах дисциплин размещены типовые проверочные задания, которые можно условно разделить на задания закрытого, комбинированного и открытого типов.

Задания открытого типа — это задания, в которых на каждый вопрос должен быть предложен развернутый обоснованный ответ.

Задания закрытого типа — это тестовые задания, в которых каждый вопрос сопровождается готовыми вариантами ответов, из которых необходимо выбрать один или несколько правильных.

Задания комбинированного типа – это тестовые задания, в которых каждый вопрос сопровождается готовыми вариантами ответов, из которых необходимо выбрать один или несколько правильных и обосновать свой выбор (кейсы).

В зависимости от типа задания рекомендованы определенная последовательность выполнения и система оценивания выполнения заданий.

4.4. Типы заданий, сценарии выполнения, критерии оценивания

ТИП ЗАДАНИЯ	ИНСТРУКЦИЯ	СЦЕНАРИИ ВЫПОЛНЕНИЯ	КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ
Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных	Прочитайте текст, выберите правильный ответ	1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов. 2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа. 3. Выбрать один верный ответ. 4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).	Ответ считается верным, если правильно указана цифра или буква
Задание закрытого типа на установление соответствия	Прочитайте текст и установите соответствие	1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидаются пары элементов. 2. Внимательно прочитать оба списка: список 1 – вопросы, утверждения,	Ответ считается верным, если правильно указаны цифры или буквы

		<p>факты, понятия и т.д.; список 2 – утверждения, свойства объектов и т.д. 3. Сопоставить элементы списка 1 с элементами списка 2, сформировать пары элементов. 4. Записать попарно буквы и цифры (в зависимости от задания) вариантов ответа (например, А1 или Б4).</p>	
Задание закрытого типа с выбором нескольких правильных ответов из нескольких вариантов предложенных	Прочитайте текст, выберите правильные ответы	<p>1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается несколько правильных ответов из предложенных вариантов. 2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа. 3. Выбрать несколько правильных ответов. 4. Записать только номера (или буквы) выбранного варианта ответа (например, 1 4 или А Г).</p>	Ответ считается верным, если правильно установлены все соответствия (позиции из одного столбца верно сопоставлены с позициями другого)
Задание закрытого типа на установление последовательности	Прочитайте текст и установите последовательность	<p>1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается последовательность элементов. 2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа. 3. Построить верную последовательность из предложенных элементов. 4. Записать буквы/цифры (в зависимости от задания) вариантов ответа в нужной последовательности (например, БАА или 135).</p>	Ответ считается верным, если правильно указана вся последовательность цифр
Задание открытого типа с развернутым ответом	Прочитайте текст и запишите развернутый обоснованный ответ	<p>1. Внимательно прочитать текст задания и понять суть вопроса. 2. Продумать логику и полноту ответа. 3. Записать ответ, используя четкие компактные формулировки. 4. В случае расчетной задачи, записать решение и ответ</p>	<p>Ответ считается верным: 1. Отсутствие фактических ошибок. 2. Раскрытие объема используемых понятий (полнота ответа). 3. Обоснованность ответа (наличие аргументов). 4. Логическая последовательность излагаемого материала.</p>

4.5. Общая шкала оценивания результатов текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся с применением БРС

Итоговая	Традиционная	Бинарная	ECTS
-----------------	---------------------	-----------------	-------------

балльная оценка	система	система	Для традиционной системы	Для бинарной системы
95-100	Отлично	Зачтено	A	P/ Passed
85-94			B	P/ Passed
75-84	Хорошо		C	P/ Passed
65-74			D	P/ Passed
55-64	Удовлетворительно		E	P/ Passed
0-54	Неудовлетворительно	Не зачтено	F	F/Failed

Соотношение баллов за текущий контроль успеваемости и промежуточную аттестацию, а также повторную промежуточную аттестацию:

Максимальная сумма баллов за текущий контроль успеваемости	Максимальная сумма баллов за промежуточную аттестацию	Максимальная итоговая балльная оценка	Максимальная сумма баллов за повторную промежуточную аттестацию
60 баллов	40 баллов	100 баллов	100 баллов

5. Формы аттестации, типовые оценочные материалы для текущего контроля успеваемости обучающихся, критерии и шкалы оценивания по контрольным точкам

5.1. В ходе реализации дисциплины используются следующие формы текущего контроля успеваемости обучающихся (в том числе, задания к контрольным точкам):
Опрос (О); Доклад с презентацией (ДР); Тестирование (Т); Кейсы (К);

Типовые материалы текущего контроля успеваемости обучающихся: опрос и вопросы для докладов с презентацией

5.2. Типовые оценочные материалы текущего контроля успеваемости обучающихся.

Текущий контроль по дисциплине Б1.В.ДЭ.02.02 Управление рисками проводится путем подготовки докладов с презентациями, устного опроса, тестированием, решением кейсов по вопросам, отражающим содержание соответствующих тем учебной дисциплины.

5.3. Типовые материалы текущего контроля успеваемости обучающихся.

Тема 1. Области проявления финансово-экономических рисков.

Оценка риск-менеджмента.

Вопросы для докладов и опроса

1. Понятия интереса (процентной ставки), дисконта и дисконт – фактора.

2. Кредитование, дисконтирование и оценка эффективной ставки финансовой сделки.
3. Расчет кредитования по схеме простых процентов.
4. Расчет кредитования по схеме сложных процентов. Сравнение кредитования по схеме простых и сложных процентов.
5. Расчет кредитования по схеме смешанных (комбинированных) процентов.
6. Расчет дисконтирования по схеме простых процентов.
7. Расчет дисконтирования по схеме сложных процентов. Дисконт – фактор.
8. Дискретные вычисления и методы расчета в непрерывном случае, когда процент кредитования или дисконтирования начисляется непрерывно.
9. Эффективная ставка финансовой сделки.

Тестовые задания

1. У любого риска есть:

- А) причины и последствия
- Б) только причины и вероятность
- В) только последствия и ущерб
- Г) факторы и следствия

2. Абсолютные показатели оценки риска основаны на:

- А) распределении прогнозируемых значений показателей
- Б) субъективных оценках величины риска
- В) фактических показателях финансовой документации

3. Реальное влияние при управлении по целям имеют руководители уровня:

- А) среднего
- Б) низшего
- В) высшего

4. Принятие рискового решения в управленческой практике должно осуществляться:

- А) только коллегиально
- Б) финансовым менеджером (риск-менеджером) единолично
- В) совместно

Кейс:

В компании «XYZ» (посредник в оптовом бизнесе) были выявлены следующие проблемы:

- большая сумма штрафов в расходах;
- отрицательная динамика оборотного капитала;
- значительные дебиторская и кредиторская задолженности;
- срывы сроков поставки со стороны поставщиков, что приводило к штрафам от крупных клиентов.

Для оценки рисков был использован метод Монте-Карло, а также разработана программа «Оценка поставщиков, рейтинг и надёжность». После внедрения мер (например, введение рейтинга поставщиков с 5 критериями для отбора) компания впервые за долгое время не получила штрафов от крупных клиентов

Тема 2. Экономическая сущность инвестиций.

Вопросы для докладов и опроса

1. Определение удельного веса простого риска. Экономическая сущность и виды инвестиций.
2. Инвестиционный процесс. Финансовые институты. Финансовые рынки.
3. Участники инвестиционного процесса. Типы инвесторов.
4. Экономическая сущность, значение и цели инвестирования.
5. Иностранные инвестиции. Режим функционирования иностранного капитала в России.
6. Бюджетное финансирование, самофинансирование, акционирование.
7. Методы долгового финансирования. Внешние финансовые рынки.
8. Долгосрочное кредитование. Лизинг, виды и преимущества.
9. Проектное финансирование. Венчурное финансирование.
10. Ипотечное кредитование.
11. Понятие инвестиционного проекта, содержание, классификация, фазы развития.
12. Критерии оценки (показатели) эффективности инвестиционного проекта: чистое современное значение NPV.

Тестовые задания

1. Виды анализа рисков:

- А) количественный и качественный
- Б) имитационное моделирование, количественный и качественный
- В) имитационное моделирование и качественный

2. Последствия риска могут быть:

- А) скорее положительными
- Б) как положительными, так и отрицательными
- В) только отрицательными

3. Риск – это:

А) разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели

Б) наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна

В) следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера

4. Функциями субъекта управления в риск-менеджменте не является:

- А) прогнозирование
- Б) нормирование
- В) регулирование

Кейс

По результатам проведенного отделом внутреннего контроля анализа и оценки рисков с использованием имитационного моделирования было установлено, что

ПАО «Маяк» рекомендуется использовать методы минимизации негативного влияния неблагоприятных событий. Какой метод необходимо использовать в данной ситуации?

Необходимо рассмотреть метод уклонения от рисков (метод сокращения рисков, метод передачи рисков)

Тема 3. Оценка и управление рисками инвестиционного проекта.

Вопросы для докладов и опроса

1. Расчет бальной оценки. Понятия финансового риска.
2. Вероятностный подход к оценке потоков платежей.
3. Оценка и управление рисками инвестиционного проекта: вероятностный подход к оценке риска инвестиционного проекта;
4. Мультиценарный подход к оценке риска;
5. Чувствительность показателей эффективности инвестиционного проекта к параметрам;
6. Оценка вероятности окупаемости инвестиционного проекта; оценка риска от внезапного падения доходов.
7. Основные функции Excel и программы Project 6.0 для оценки эффективности и управления рисками инвестиционного проекта.

Тестовые задания

1. *Конечной целью управления риском является:*

- А) получение большей информации
- Б) перенос риска на другое лицо
- В) составление базы данных о рисках

2. *Культура управления рисками это:*

- А) создание в организации среды, способствующей выявлению, оценке и снижению рисков
- Б) разработка и внедрение мероприятий, которые могут исключить либо снизить уровень риска
- В) периодический пересмотр рисков компании с целью корректировки их оценок, выявления новых рисков

Кейс

Для оценки вероятности рисков были проведены расчеты с использованием статистических методов. В результате был выявлен рост вероятности наступления риска невыполнения договорных обязательств ключевым покупателем в связи с ухудшением его финансового состояния. Наступление данного риска может нанести компании значительный ущерб. С этой целью принято решение провести декомпозицию данного риска на причины реализации и возможные последствия от его наступления. Кроме того, предложено уделить особое внимание при построении схемы установлению «барьеров» - методов и средств снижения вероятности реализации риска и тяжести его последствий.

Определите, какой метод анализа рисков необходимо использовать в данной ситуации?

Правильный ответ: В данной ситуации необходимо использовать метод галстук-бабочка

Тема 4. Классификация рисков. Разделения рисков на конкретные группы по определенным признакам.

Вопросы для докладов и опроса

1. Разделения рисков на конкретные группы по определенным признакам.
2. Понятия финансового риска на фондовом рынке.
3. Портфель ценных бумаг. Основные понятия.
4. Ожидаемая доходность ценных бумаг. Ковариационная и корреляционная матрица для эффективностей ценных бумаг.
5. Оценка дохода и риска портфеля ценных бумаг. Оценка риска портфеля из независимых ценных бумаг.
6. Диверсификация портфеля.
7. Оценка риска портфеля из коррелированных ценных бумаг.
8. Оценка риска портфеля из антикоррелированных ценных бумаг.

Тестовые задания

Риски, которые могут принести дополнительную прибыль фирме, называются:

- а) чистые
- б) спекулятивные
- в) ретроспективные

К внешним рискам относятся:

- а) низкий уровень квалификации персонала
- б) неблагоприятные изменения в законодательстве
- в) поломка оборудования

Подразделение рисков на спекулятивные и чистые основано на:

- а) характере оценки риска
- б) характере последствий
- в) субъектах риска

Какой метод управления рисками предполагает отказ от рискованной сделки?

- а) локализация
- б) уклонение
- в) диссипация

Кейс.

В компании «XYZ» (посредник в оптовом бизнесе) были выявлены следующие проблемы:

- большая сумма штрафов в расходах;
- отрицательная динамика оборотного капитала;
- значительные дебиторская и кредиторская задолженности;
- срывы сроков поставки со стороны поставщиков, что приводило к штрафам от крупных клиентов.

Для оценки рисков необходимо использовать метод Монте-Карло, а также разработать программу «Оценки поставщиков, рейтинг и надёжность».

После внедрения мер (например, введение рейтинга поставщиков с 5 критериями для отбора) компания впервые за долгое время не получит штрафов от крупных клиентов

Тема 5. Риск как объект диагностики и оценки. Управленческий механизм риск-менеджмента.

Вопросы для докладов и опроса

1. Основы управленческой диагностики рисков. Формула риска.
2. Преобразование базовой продвинутой формулы риска.
3. Таксономия рисков. Пирамида риска: факторы, симптомы, бифуркации, контроль.
4. Риск как объект диагностики и оценки.
5. Модель функции риск-менеджмента в управлении фирмой. Распределение обязанностей по управлению рисками: карты распределения ответственности.
6. Защита от стратегических рисков. Подпрограмма защиты непрерывности бизнеса.
7. Рутинный риск-менеджмент. Чрезвычайная ситуация.
8. Управленческий механизм риск-менеджмента.

Тестовые задания

Анализ риска включает:

- а) только оценку ущерба
- б) идентификацию опасностей и оценку рисков
- в) только профилактические мероприятия

К методам анализа рисков относятся:

- а) качественный и количественный
- б) только количественный
- в) только эвристический

К качественным методам анализа относятся:

- а) моделирование
 - б) эвристические методы
- в) методы сбора новой информации

Кейс

Компания рассматривает вопрос о строительстве завода. Возможны три варианта действий.

А. Построить большой завод стоимостью $M1 = 700$ тысяч долларов. При этом варианте возможны большой спрос (годовой доход в размере $R1 = 280$ тысяч долларов в течение следующих 5 лет) с вероятностью $p1 = 0,8$ и низкий спрос (ежегодные убытки $R2 = 80$ тысяч долларов) с вероятностью $p2 = 0,2$.

Б. Построить маленький завод стоимостью $M2 = 300$ тысяч долларов. При этом варианте возможны большой спрос (годовой доход в размере $T1 = 180$ тысяч долларов в течение следующих 5 лет) с вероятностью $p1 = 0,8$ и низкий спрос (ежегодные убытки $T2 = 55$ тысяч долларов) с вероятностью $p2 = 0,2$.

В. Отложить строительство завода на один год для сбора дополнительной информации, которая может быть позитивной или негативной с вероятностью $p3 = 0,7$ и $p4 = 0,3$ соответственно. В случае позитивной информации можно построить заводы по указанным выше расценкам, а вероятности большого и низкого спроса

меняются на $p_5 = 0,9$ и $p_6 = 0,1$ соответственно. Доходы на последующие четыре года остаются прежними. В случае негативной информации компания заводы строить не будет.

Все расчеты выражены в текущих ценах и не должны дисконтироваться.

Нарисуйте дерево решений, определите наиболее эффективную последовательность действий, основываясь на ожидаемых доходах.

Полный перечень тестовых заданий по темам занятий размещен в Фондах оценочных средств по дисциплине Б1. В.ДЭ.02.02 «Управление рисками».

Типовые оценочные материалы для текущего контроля успеваемости обучающихся (вне контрольных точек): приведены в пункте 6.2.

5.4. Один или несколько тематических блоков дисциплины завершаются контрольной точкой (далее – КТ). Текущий контроль успеваемости по дисциплине предусматривает не менее 2 (двух) и не более 10 (десяти) КТ в течение периода освоения дисциплины.

Максимальное количество баллов за любой тип работ в рамках КТ составляет 100 (сто) баллов.

Распределение весовых коэффициентов по КТ в рамках текущего контроля успеваемости по дисциплине и формулы расчета:

Наименование контрольной точки	Максимальное количество баллов за работу в рамках КТ, которое может набрать студент	Коэффициент веса контрольной точки	Результат контрольной точки, участвующий в формировании итоговой балльной оценки по дисциплине (отражается в журнале БРС в СДО)
КТ - 1	100	0,12	12
КТ - 2	100	0,12	12
КТ- 3	100	0,12	12
КТ - 4	100	0,12	12
КТ - 5	100	0,12	12
Итого:	х	0,6	60

Формула расчета результата контрольной точки:

Результат контрольной точки (КТ) = Количество баллов за работу в рамках КТ X Коэффициент веса контрольной точки.

5.4. Формы текущего контроля успеваемости обучающихся в рамках КТ и типовые оценочные материалы:

КТ-1

Тема 1. Тестирование.

Доклад с презентацией.

Кейс

КТ-2.

Тема 2. Тестирование.

Доклад с презентацией.

Кейс

КТ-3.

Тема 3. Тестирование.
Доклад с презентацией.

Кейс

КТ-4

Тема 4. Тестирование.
Доклад с презентацией.

Кейс

КТ-5

Тема 5. Тестирование.
Доклад с презентацией.

Кейс

Для каждой формы текущего контроля успеваемости обучающихся в рамках КТ определены критерии оценивания результатов выполнения задания.

1. Критерии оценивания тестирования:

Критерии оценки	Диапазон баллов	Описание критерия
<i>Количество правильных ответов</i>	<i>0</i>	<i>Количество правильных ответов менее 55%</i>
	<i>25</i>	<i>Количество правильных ответов от 55% до 64%</i>
	<i>50</i>	<i>Количество правильных ответов от 65% до 74%</i>
	<i>75</i>	<i>Количество правильных ответов от 75% до 84%</i>
	<i>100</i>	<i>Количество правильных ответов от 85% до 100%</i>
Итого максимально:	100	

2. Критерии оценивания доклада с презентацией:

Критерии оценки	Диапазон баллов	Описание критерия
<i>Содержание и раскрытие выбранных понятий</i>	<i>41-70</i>	<i>Детальное, последовательное описание всех понятий на примере выбранной системы</i>
	<i>21-40</i>	<i>Поверхностное описание без привязки к выбранной системе</i>
	<i>0-20</i>	<i>Понятия раскрыты минимально или не раскрыты вовсе</i>
<i>Количество выполненных заданий</i>	<i>30</i>	<i>Количество выполненных заданий от 85% до 100%</i>
	<i>15</i>	<i>Количество выполненных заданий</i>

		<i>от 55% до 84%</i>
	0	<i>Количество выполненных заданий менее 55%</i>
Итого максимально:	100	

3. Критерии оценивания кейса:

Критерии оценки	Диапазон баллов	Описание критерия
<i>Содержание и раскрытие выбранных понятий</i>	31-50	<i>Детальное, последовательное описание всех понятий на примере выбранной системы</i>
	16-30	<i>Поверхностное описание без привязки к выбранной системе</i>
	0-15	<i>Понятия раскрыты минимально или не раскрыты вовсе</i>
<i>Достоверность и актуальность информации</i>	16-20	<i>Представленная информация подтверждена ссылками на источники</i>
	0-15	<i>Представленная информация частично подтверждена ссылками на источники или не подтверждена</i>
<i>Количество выполненных заданий</i>	30	<i>Количество выполненных заданий от 85% до 100%</i>
	15	<i>Количество выполненных заданий от 55% до 84%</i>
	0	<i>Количество выполненных заданий менее 55%</i>
Итого максимально:	100	

5.4. Описание дополнительных материалов и оборудования, необходимых для выполнения проверочных заданий (*при необходимости*).

Для решения задач открытого типа, тестовых заданий студенту разрешается использование калькулятора; программ для работы с электронными таблицами для обработки, анализа и визуализации данных.

6. Формы промежуточной аттестации, критерии и шкала оценивания, типовые оценочные материалы по дисциплине

6.1. Промежуточная аттестация проводится в форме экзамена.

Экзамен проводится в письменной форме. Обучающийся получает

экзаменационный билет с вариантами 3-х заданий различного типа. На выполнение заданий дается 40-60 минут. По завершении подготовки необходимо представить ответы в письменном виде, подробно изложив ход выполнения задания, сделать выводы (при необходимости).

При реализации промежуточной аттестации в ЭО/ДОТ могут быть использованы следующие формы: устно в ДОТ - в форме обоснованных ответов на задания различного типа; письменно в СДО - в форме письменного решения заданий различного типа; тестирование в СДО.

6.2. Типовые оценочные материалы промежуточной аттестации

Перечень вопросов для подготовки к экзамену

1. Понятие и сущность риска.
2. Виды рисков.
3. Сущность и содержание Риск-менеджмента.
4. Цель и задачи Риск-менеджмента
5. История возникновения Риск-менеджмента.
6. Основные аксиомы Риск-менеджмента.
7. Законы управления рисками.
8. Принципы Риск-менеджмента.
9. Понятие и сущность процессного подхода в управлении рисками.
10. Внешний и внутренний мониторинг рисков.
11. Планирование в системе Риск-менеджмента
12. Организация как функция Риск-менеджмента
13. Мотивация как функция Риск-менеджмента
14. Регулирование в системе Риск-менеджмента
15. Учет и контроль в системе Риск-менеджмента
16. Оценка эффективности управления рисками.
17. Методы управления рисками.
18. Юридические методы управления рисками.
19. Административные методы управления рисками.
20. Экономические методы управления рисками.
21. Социально-психологические методы управления рисками.
22. Производственные методы управления рисками.
23. Научно-прикладные методы управления рисками.
24. Стратегия управления рисками.
25. Политика Риск-менеджмента
26. Тактическое управление рисками.
27. Принятие управленческих решений в условиях риска
28. Характеристика внешней среды организации.
29. Политические риски.

30. Экономические риски.
31. Природные риски.
32. Национальные риски.
33. Экологические риски.
34. Коммерческие риски.
35. Демографические риски.
36. Финансовые риски.
37. Криминогенные риски.
38. Инновационные риски.
39. Логистические риски.
40. Отраслевые и структурные риски.
41. Характеристика внутренней среды организации.
42. Организационные риски.
43. Технические и производственные риски.
44. Коммуникативные и информационные риски.
45. Социально-психологические риски.
46. Принятие управленческих решений в условиях неопределенности
47. Принятие управленческих решений в условиях определенности
48. Виды финансовых рисков в деятельности организации и их характеристика
49. Методы страхования рисков
50. Основные элементы системы Риск-менеджмента
51. Характеристика инструментов Риск-менеджмента
52. Мотивация и кадровое обеспечение Риск-менеджмента
53. Информационное обеспечение системы Риск-менеджмента
54. Моделирование в Риск-менеджменте
55. Количественные и качественные методы прогнозирования рисков.
56. Методы оценки внешней среды в системе Риск-менеджмента
57. Методы оценки внутренней среды в системе Риск-менеджмента
58. Методы прогнозирования в управлении рисками.
59. Неформальные методы прогнозирования.
60. Применение экспертных методов в Риск-менеджменте

Типовые проверочные задания для самоподготовки обучающегося к промежуточной аттестации:

ТИП ЗАДАНИЯ	СЦЕНАРИИ ВЫПОЛНЕНИЯ	ТИПОВЫЕ ЗАДАНИЯ	ПРАВИЛЬНЫЙ ОТВЕТ
Задание закрытого типа с выбором	1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только	1. <i>Риск-менеджмент представляет собой:</i> 1. систему управления риском и финансовыми отношениями; 2. систему управления финансовыми	1

одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных	<p>один из предложенных вариантов.</p> <p>2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.</p> <p>3. Выбрать один верный ответ.</p> <p>4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).</p>	<p>организациями;</p> <p>3. процесс управления денежными потоками предприятий и организаций</p>	
		<p>2. Какова ключевая особенность современного подхода к управлению рисками?</p> <p>1. Наличие наработок, позволяющих определить возможные риски для каждой из отраслей</p> <p>2. Использование самых современных и точных математических методов</p> <p>3. Рассмотрение как позитивных, так и негативных рисков</p> <p>4. Все ответы верны</p>	2
		<p>Какое утверждение является верным?</p> <p>Каждое предприятие имеет действительное влияние на конъюнктуру рынка в целом</p> <p>1. Влияние отдельного предприятия на факторы макросреды является значительным</p> <p>2. Влияние отдельного предприятия на факторы макросреды является незначительным, его можно приравнять к нулю</p> <p>3. Влияние факторов макросреды на предпринимательскую деятельность отдельного предприятия носит незначительное влияние, которое можно приравнять к нулю</p>	1
Задание закрытого типа на установление соответствия	<p>1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидаются пары элементов.</p> <p>2. Внимательно прочитать оба списка: список 1 – вопросы, утверждения, факты, понятия и т.д.; список 2 – утверждения, свойства объектов и т.д.</p> <p>3. Сопоставить элементы списка 1 с элементами списка 2, сформировать пары элементов.</p> <p>4. Записать попарно буквы и цифры (в зависимости от задания) вариантов ответа</p>	<p>Установите соответствие между методами управления рисками и их характеристикой.</p> <p><u>Методы:</u></p> <p>1. Страхование</p> <p>2. Аутсорсинг</p> <p>3. Диверсификация</p> <p>4. Диссипация</p> <p><u>Характеристики:</u></p> <p>А. Распределение выявленных факторов риска между участниками производственного процесса</p> <p>Б. Процесс распределения капитала между различными объектами вложения, которые непосредственно не связаны между собой</p> <p>В. Передача управления риском или функций по оценке риска сторонней специализированной организации</p> <p>Г. Защита имущественных интересов</p>	1-Г;2-В;3-Б;4-А

	(например, А1 или Б4).	предприятия при наступлении страхового события (страхового случая) специальными страховыми компаниями (страховщиками)	
Задание закрытого типа с выбором нескольких правильных ответов из нескольких вариантов предложенных	1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается несколько правильных ответов из предложенных вариантов. 2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа. 3. Выбрать несколько правильных ответов. 4. Записать только номера (или буквы) выбранного варианта ответа (например, 1 4 или А Г).	1. <i>Что из перечисленного является правилами риск-менеджмента?</i> а) нельзя рисковать многим ради малого; б) риск – дело благородное; в) нельзя думать, что существует только одно решение, возможно, есть и другие; г) при существовании нескольких вариантов, следует идти по пути минимально риска; д) положительное решение принимается лишь при отсутствии сомнения.	Г)
		2. <i>Что из перечисленного относится к основным признакам системности в экономической деятельности предприятия?</i> 1. подчинённость определенной цели; 2. структурированность; 3. взаимосвязанность частей; 4. многофункциональность.	3
		<i>Какая информация характеризует условие определенности при принятии рискованных решений:</i> а) Статистические и финансовые показатели деятельности организации б) Информация об экспертной оценке ситуации в) Информация о факторах и условиях принятия рискованного решения	В
Задание закрытого типа на установление последовательности	1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается последовательность элементов. 2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа. 3. Построить верную последовательность из предложенных элементов.	1. <i>Установите правильную последовательность этапов управления рисками в финансовой модели бизнес-плана:</i> 1. Реализация программы снижения рисков 2. Выявление рисков; 3. Разработка мероприятий по управлению рисками; 4. Идентификация рисков; 5. Определение ответственных;	2-4-3-1-5
		2. <i>Установите последовательность</i>	1-Б;2-А);3-

	4. Записать буквы/цифры (в зависимости от задания) вариантов ответа в нужной	оценки рисков: 1 А) Характеристика риска 2 Б) Выявление новых рисков 3 В) Идентификация опасности 4 Г) Оценка воздействия	В);4-Г)
Задание комбинированного типа с выбором одного правильного ответа из предложенных и обоснованием выбора	1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.	1. Какое из перечисленных свойств относится к основным свойствам социально-экономических систем? 1. комплексность; 2. многофункциональность; 3. эмерджентность; 4. стабильность.	3
	2. Внимательно прочитайте предложенные варианты ответа. 3. Выбрать один верный ответ. 4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа. 5. Записать аргументы, обосновывающие выбор ответа (например, 4 текст обоснования).	1. Какую функцию не выполняет предпринимательский риск? 2. защитная 3. распределительная 4. регулирующая 5. аналитическая	6.
		Инвестиционная стратегия — это: 1. последовательность этапов деятельности предприятия; 2. набор общих правил для принятия решений, которыми предприятие руководствуется в своей деятельности; 4. конечный этап стратегического управления	4
Задание открытого типа с развернутым ответом	1. Внимательно прочитайте текст задания и понять суть вопроса. 2. Продумать логику и полноту ответа. 3. Записать ответ, используя четкие компактные формулировки. 4. В случае расчетной задачи, записать решение и ответ	1. Обоснуйте повышение рыночной стоимости фирмы на основе оптимизации использования внеоборотных активов. Фактор времени при оценке целесообразности и эффективности инновационных инвестиций?	2.
		3. В каких отраслях национальной экономики и регионах наиболее высока востребованность риск-менеджмента, исходя из реалий процесса глобализации?	4.
		5. Охарактеризуйте риск-менеджмент как фактор экономической безопасности Российской Федерации особенно в период жесточайших международных санкций?	6.

6.3. Критерии и шкала оценивания на основе БРС.

Критерии и балльная шкала определяются преподавателем

КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ	РЕЗУЛЬТАТ В БАЛЛАХ
<i>Дан полный, в логической последовательности развернутый ответ на поставленный вопрос, где он продемонстрировал знания предмета в полном объеме учебной программы, достаточно глубоко осмысливает дисциплину, самостоятельно, и исчерпывающе отвечает на дополнительные вопросы, приводит собственные примеры по проблематике поставленного вопроса, решил предложенные практические задания без ошибок</i>	40
<i>Дан развернутый ответ на поставленный вопрос, где студент демонстрирует знания, приобретенные на лекционных и семинарских занятиях, а также полученные посредством изучения обязательных учебных материалов по курсу, дает аргументированные ответы, приводит примеры, в ответе присутствует свободное владение монологической речью, логичность и последовательность ответа. Однако допускается неточность в ответе. Решил предложенные практические задания с небольшими неточностями.</i>	30-39
<i>Дан ответ, свидетельствующий в основном о знании процессов изучаемой дисциплины, отличающийся недостаточной глубиной и полнотой раскрытия темы, знанием основных вопросов теории, слабо сформированными навыками анализа явлений, процессов, недостаточным умением давать аргументированные ответы и приводить примеры, недостаточно свободным владением монологической речью, логичностью и последовательностью ответа. Допускается несколько ошибок в содержании ответа и решении практических заданий.</i>	20-29
<i>Дан ответ, который содержит ряд серьезных неточностей, обнаруживающий незнание процессов изучаемой предметной области, отличающийся неглубоким раскрытием темы, незнанием основных вопросов теории, несформированными навыками анализа явлений, процессов,</i>	0-19

<p><i>неумением давать аргументированные ответы, слабым владением монологической речью, отсутствием логичности и последовательности. Выводы поверхностны. Решение практических заданий не выполнено, т.е. студент не способен ответить на вопросы даже при дополнительных наводящих вопросах преподавателя.</i></p>	
---	--

6.4. Описание дополнительных материалов и оборудования, необходимых для выполнения проверочных заданий (*при необходимости*).

Для решения задач открытого типа (кейсов, ПКЗ, ПИЗ), тестовых заданий студенту разрешается использование калькулятора; программ для работы с электронными таблицами для обработки, анализа и визуализации данных.

7. Методические материалы по освоению дисциплины

Для изучения основных вопросов дисциплины Б1.В.ДЭ.02.02 Управление рисками необходимо конспектировать материалы лекций, работать с рекомендованной преподавателем литературой, а также ресурсами информационно-телекоммуникационной сети «Интернет». Для приобретения навыков активного использования знаний полезно обсуждать плановые и возникающие вопросы, а также решаемые задачи на практических занятиях. Чтобы легче и прочнее усвоить материал следует постоянно использовать конкретные примеры, сравнения из уже полученных областей наук.

Для закрепления изученного материала даны вопросы по каждой теме дисциплины, на которые следует самостоятельно найти ответы.

Важной составной частью учебного процесса в вузе являются практические занятия. Практические занятия проводятся главным образом по дисциплинам, требующим закрепления навыков решения задач, и помогают студентам глубже усвоить учебный материал, приобрести умения применять принципы системного подхода к решению разнообразных задач, определять и оценивать ресурсы и существующие ограничения разного рода проектов.

При подготовке к практическим занятиям необходимо проанализировать конспект лекции, ознакомиться с рекомендованной литературой по соответствующей теме, осуществить подготовку по рекомендованным в рабочей программе вопросам для обсуждения темы, выполнить домашнее задание (при необходимости).

Необходимо помнить, что на лекции обычно рассматривается не весь материал, а только его часть. Остальная его часть восполняется в процессе самостоятельной работы. В связи с этим работа с рекомендованной литературой обязательна. Особое внимание при этом необходимо обратить на содержание основных положений и выводов, объяснение явлений и фактов, уяснение практического приложения рассматриваемых теоретических вопросов. В процессе этой работы студент должен

стремиться понять и запомнить основные положения рассматриваемого материала, примеры, поясняющие его, а также разобраться в иллюстративном материале. В процессе подготовки к занятиям рекомендуется взаимное обсуждение материала, во время которого закрепляются знания, а также приобретает практика в изложении и разъяснении полученных знаний, развивается речь. При необходимости следует обращаться за консультацией к преподавателю (в том числе по электронной почте). Планируя консультацию, необходимо хорошо продумать вопросы, которые требуют разъяснения. Заканчивать подготовку следует составлением плана (конспекта) по изучаемому материалу (вопросу). Это позволяет составить концентрированное, сжатое представление по изучаемым вопросам. Записи имеют первостепенное значение для самостоятельной работы студентов. Они помогают понять построение изучаемого материала, выделить основные положения, проследить их логику. Кроме того, ведение записей способствует превращению чтения в активный процесс, мобилизует, наряду со зрительной, и моторную память. Следует помнить: у магистранта, систематически ведущего записи, создается свой индивидуальный фонд методических материалов для быстрого повторения изученных вопросов, для мобилизации накопленных знаний. Особенно важны и полезны записи тогда, когда в них находят отражение мысли, возникшие при самостоятельной работе.

После изучения базовых тем курса проводится текущий контроль знаний студентов в виде опроса - дискуссии, письменного тестирования. Типовые тесты и задания по темам дисциплины приведены в специальном разделе данной рабочей программы.

Подготовка к текущему и промежуточному контролю предполагает изучение представленных вопросов к зачету, работу над тестами, представленными в данной рабочей программе.

Работа в малых группах – это одна из самых популярных форм проведения занятий, так как она дает всем обучающимся (в том числе и стеснительным) возможность участвовать в работе, практиковать навыки сотрудничества, межличностного общения (в частности, умение активно слушать, вырабатывать общее мнение, разрешать возникающие разногласия). Цель данной формы проведения занятий: продемонстрировать сходство или различия определенных явлений, выработать стратегию или разработать план, выяснить отношение различных групп участников к одному и тому же вопросу. В ходе этой работы дополнительно решаются следующие задачи: развитие навыков общения и взаимодействия в группе, формирование ценностно-ориентационного единства группы, поощрение к гибкой смене социальных ролей в зависимости от ситуации.

При написании доклада по заданной теме составляется план, подбираются основные источники. В процессе работы с источниками, систематизируют полученные сведения, делают выводы и обобщения.

Подготовка устному опросу-дискуссии требует от обучающегося большой самостоятельности и серьезной интеллектуальной работы, которая принесет наибольшую пользу, если будет включать с себя следующие этапы: изучение наиболее важных научных работ по данной теме, перечень которых дает сам преподаватель; анализ изученного материала, выделение наиболее значимых для

раскрытия темы фактов, мнений разных ученых и научных положений; обобщение и логическое построение материала ответа, например, в форме развернутого плана; написание текста ответа с соблюдением требований научного стиля.

Построение ответа включает три части: вступление, основную часть и заключение. Во вступлении указывается тема доклада, устанавливается логическая связь ее с другими темами или место рассматриваемой проблемы среди других проблем, дается краткий обзор источников, на материале которых раскрывается тема и т. п. Основная часть должна иметь четкое логическое построение, в ней должна быть раскрыта тема доклада. В заключении обычно подводятся итоги, формулируются выводы, подчеркивается значение рассмотренной проблемы и т. п.

Подготовка вопросов для самостоятельного изучения включает: изучение необходимой литературы (обязательной, дополнительной литературы, специальных периодических изданий, интернет-ресурсов), подготовку конспекта ответа и презентации, решение типовых заданий, ответы на контрольные вопросы.

При подготовке вопросов важно:

- использовать достаточно широкий диапазон массива информации, провести обзор периодической литературы и специальных изданий, составить каталог Интернет-ресурсов
- представить различные подходы, четко и полно определить рассматриваемые понятия, выявить взаимосвязи понятий и явлений, взаимозависимости и связи с другими вопросами;
- грамотно структурировать материал, ясно, четко и логично его излагать, приводить соответствующие примеры из практики, для иллюстрации положений, тезисов и выводов использовать таблицы, схемы, графики, диаграммы;

8. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

8.1. Основная литература.

Все источники взаимозаменяемые

1. Вяткин, Валерий Нурович. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 365 с. — (Высшее образование). — Текст : электронный — URL: <https://www.ura.it.ru/viewer/risk-menedzhment-511018>. — Режим доступа: для авторизованных пользователей
2. Казакова, Н. А. Современный стратегический анализ : учебник и практикум для вузов / Н. А. Казакова. — 3-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 469 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-11138-5. — Текст : электронный — URL: <https://ura.it.ru/bcode/511185>. Режим доступа: для авторизованных пользователей
3. Круи, Майкл. Основы риск-менеджмента / М. Круи, Д. Гэлаи, В. Б. Минасян, Р. Марк. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 390 с. — (Высшее

- образование). — Текст : электронный — URL: <https://urait.ru/viewer/osnovy-risk-menedzhmenta-510526>. Режим доступа: для авторизованных пользователей
4. Пименов, Николай Анатольевич. Управление финансовыми рисками в системе экономической безопасности : учебник и практикум для вузов / Н.А. Пименов. – 2-е изд., перераб. и доп. – Москва : Издательство Юрайт, 2023. – 326 с. – (Высшее образование). – Текст: электронный – URL: <https://urait.ru/viewer/upravlenie-finansovymi-riskami-v-sisteme-ekonomicheskoy-bezopasnosti-510935>. - Режим доступа: для авторизованных пользователей
 5. Шкурко, Валентина Евгеньевна. Управление рисками проекта: учебное пособие для вузов / В.Е. Шкурко; под научной редакцией А.В. Гребенкина. – 2-е изд. – Москва: Издательство Юрайт, 2022. – 182 с. – (Высшее образование). – Текст: электронный – URL: <https://urait.ru/viewer/upravlenie-riskami-proekta-493673>. – Режим доступа: для авторизованных пользователей

8.2. Дополнительная литература.

1. Балдин, Константин Васильевич. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия [Электронный ресурс] : учеб. пособие / К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов. - 4-е изд. - Электрон. дан. - М. : Дашков и К, 2019. - 418 с. – URL: <https://www.iprbookshop.ru/epd-reader?publicationId=85180>. - Режим доступа: для авторизованных пользователей
2. Воронцовский, Алексей Владимирович. Управление рисками: учебник и практикум для вузов /А. В. Воронцовский. – 2-е изд. – Москва : Издательство Юрайт, 2023. – 485 с. (Высшее образование). – Текст: электронный - URL: <https://urait.ru/viewer/upravlenie-riskami-489580>. – Режим доступа: для авторизованных пользователей
3. Кузнецов, Юрий Викторович. Теория организации : учебник и практикум для вузов / Ю.В. Кузнецов, Е.В. Мелякова. - 3-е изд., перераб. и доп. – Москва : Издательство Юрайт, 2023. – 351 с. – (Высшее образование). – Текст: электронный – URL: <https://urait.ru/viewer/teoriya-organizacii-510680>. - Режим доступа: для авторизованных пользователей
4. Рягин, Юрий Игнатьевич. Рискология в 2 частях. Ч. 1 : учебник для вузов / Ю. И. Рягин. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 255 с. — (Высшее образование). — Текст : электронный — URL: <https://urait.ru/viewer/riskologiya-v-2-ch-chast-1-492118>. Режим доступа: для авторизованных пользователей
5. Рягин, Юрий Игнатьевич. Рискология в 2 частях. Ч. 2 : учебник для вузов / Ю. И. Рягин. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 275 с. — (Высшее образование). — Текст : электронный — URL: <https://urait.ru/viewer/riskologiya-v-2-ch-chast-2-492120>. Режим доступа: для авторизованных пользователей
6. Хоминич, Ирина Петровна. Управление финансовыми рисками : учебник и практикум для вузов / И.П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И.П. Хоминич - 2-е

изд., испр. и доп. - Москва : Издательство Юрайт, 2023. - 569 с. - (Высшее образование). – Текст: электронный – URL: <https://urait.ru/viewer/upravlenie-finansovymi-riskami-511958>. - Режим доступа: для авторизованных пользователей

8.3. Нормативные правовые документы.

1. Конституция Российской Федерации" (принята всенародным голосованием 12.12.1993) (с учетом поправок, внесенных Законами РФ о поправках к Конституции РФ от 30.12.2008 N 6-ФКЗ, от 30.12.2008 N 7-ФКЗ, от 05.02.2014 N 2-ФКЗ) // Собр. законодательства Рос. Федерации.- 2014.- № 9, ст. 851.

8.4. Интернет-ресурсы.

1. e-Library.ru [Электронный ресурс]: Научная электронная библиотека. – URL: <http://elibrary.ru/> (дата обращения: 30.03.2023).
2. Научная электронная библиотека «КиберЛенинка» [Электронный ресурс]. – URL: <http://cyberleninka.ru/> (дата обращения: 30.03.2023).
3. Правовая система «Гарант-Интернет» [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.garweb.ru>.
4. Правовая система «КонсультантПлюс» [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.consultantru>.
5. Электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «Айбукс» <https://ibooks.ru/?ysclid=lg0jrply11272419827>
6. Статьи из журналов и статистических изданий EAST VIEW <https://www.eastview.com>

8.5. Иные источники

Не используются

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

Характеристики аудиторий (помещений, мест) для проведения занятий

Для проведения занятий необходимы стандартно оборудованные учебные кабинеты и компьютерные классы, соответствующие санитарным и строительным нормам и правилам.

№ п/п	Наименование
1.	Специализированные залы для проведения лекций:
2.	Специализированная мебель и оргсредства: аудитории
3.	Технические средства обучения: Персональные компьютеры;

компьютерные проекторы; звуковые динамики; программные средства, обеспечивающие просмотр видеофайлов в форматах AVI, MPEG-4, DivX, RMVB, WMV.

На практических занятиях используется следующее программное обеспечение:

- программы, обеспечивающие доступ в сеть Интернет (например, «Google chrome»);
- программы, демонстрации видео материалов (например, проигрыватель «Windows Media Player»);
- программы для демонстрации и создания презентаций (например, «Microsoft Power Point»);
- пакеты прикладных программ SPSS/PC+, СТАТИСТИКА,
- программные комплексы Word, ТЕСТУНИВЕРСАЛ,
- правовые базы данных «Консультант+», «Гарант», «Кодекс», «Эталон»