

Частное образовательное учреждение высшего образования  
«САНКТ-ПЕТЕРБУРГСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ ТЕХНОЛОГИЙ  
УПРАВЛЕНИЯ И ЭКОНОМИКИ»

РАССМОТРЕНО И ОДОБРЕНО

УТВЕРЖДАЮ

На заседании кафедры  
информационных технологий и  
математики  
Протокол № 9 от 25.05.2023 г.

Первый проректор  
С.В. Авдашкевич  
28.06.2023

## РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина:	Б1.В.ДВ.01.02 Риск-менеджмент в ИТ проектах
Направление подготовки:	09.04.03 Прикладная информатика
Направленность (профиль):	Корпоративные информационные системы
Уровень высшего образования:	Магистратура
Форма обучения:	очная, заочная
Разработчики:	Кандидат экономических наук, доцент Щипанов Е.Ф.

Санкт-Петербург  
2023

### 1. Цели и задачи дисциплины:

#### *Цель освоения дисциплины:*

Сформировать у студентов комплекс знаний и умений по основным методологическим и организационно-правовым аспектам управления рисками, ознакомить их с технологией и экономическим механизмом управления рисками, а также сформировать навыки разработки управленческих решений и обоснования их выбора по критерию социально-экономической эффективности.

#### *Задачи дисциплины:*

Ознакомить студентов с базовыми понятиями риск-менеджмента, его методологическими и организационными основами, различными подходами к классификации рисков;

Уточнить понимание роли и места управления риском в общем менеджменте фирмы.

### 2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы высшего образования

Планируемые результаты освоения ОП ВО (код и содержание компетенций)	Планируемые результаты обучения по ОП ВО (индикаторы достижения компетенций)	Примечание
ПК-3 Способность учитывать риски при управлении процессами оценки сложности, трудоемкости, сроков выполнения	ПК-3.1 Применять основные принципы и методы управления персонaлом; Методы оценки сложности, трудоемкости и сроков выполнения работ; Методы и средства управления рисками; Нормативно-технические документы (стандарты и регламенты), описывающие процессы управления рисками; Нормативно-технические документы (стандарты и регламенты), описывающие процессы оценки сложности, трудоемкости, сроков выполнения работ; Программные средства для оценки сложности, трудоемкости и сроков выполнения работ.сроков выполнения работ;	06.017 Профессиональный стандарт «Руководитель разработки программного обеспечения»
	ПК-3.2 Применять методы и средства оценки сложности, трудоемкости и сроков выполнения работ; Применять методы и средства управления рисками; Применять нормативно-технические документы (стандарты и регламенты), описывающие процессы управления рисками; Применять нормативно-технические документы (стандарты и регламенты), описывающие процессы оценки сложности, трудоемкости, сроков выполнения работ.	
	ПК-3.3 Определение областей применения процесса управления рисками; Анализ и оценка выявленных рисков, выбор способов реагирования на них и выделение необходимых ресурсов; Выявление и отслеживание рисков в процессе разработки программного обеспечения; Мониторинг и оценка по выбранным критериям (показателям) сложности, трудоемкости и сроков выполнения работ; Определение критериев (показателей) оценки сложности, трудоемкости, сроков выполнения работ описывающие процессы оценки сложности, трудоемкости, сроков; Определение стратегий и приоритетов управления рисками; Принятие управленческих решений; Структурная декомпозиция работ.	

<b>Планируемые результаты освоения ОП ВО (код и содержание компетенций)</b>	<b>Планируемые результаты обучения по ОП ВО (индикаторы достижения компетенций)</b>	<b>Примечание</b>
ПК-8 Управление эффективно-стью команды в проектах малого и среднего уровня сложности в области ИТ	ПК-8.1 Технологии межличностной и групповой коммуникации в деловом взаимодействии, основы конфликтологии	06.016 Профессиональный стандарт «Руководитель проектов в области информационных технологий»
	ПК-8.2 Планировать работы в проекте; Управление персоналом в проекте	
	ПК-8.3 Оценка эффективности работы команды проекта; Корректи-ровка планов управления персоналом в проекте; Оценка эф-фективности мероприятий по развитию и управлению коман-дой проекта; Анализировать входные данные.	

<b>Планируемые результаты обучения по ОП ВО (индикаторы достижения компетенций)</b>	<b>Планируемые результаты обучения по дисциплине</b>
ПК-3.1. Применять основные принципы и методы управления персо-налом; Методы оценки сложности, трудоемкости и сроков вы-полнения работ; Методы и средства управления рисками; Нормативно-технические документы (стандарты и регламен-ты), описывающие процессы управления рисками; Норматив-но-технические документы (стандарты и регламенты), описы-вающие процессы оценки сложности, трудоемкости, сроков выполнения работ; Программные средства для оценки слож-ности, трудоемкости и сроков выполнения работ.сроков выполнения работ;	Знает методы и средства управления рисками; нормативно-технические документы (стандарты и регламенты), описывающие процессы управления рисками при реализации ИТ проектов.
ПК-3.2. Применять методы и средства оценки сложности, трудоемко-сти и сроков выполнения работ; Применять методы и средства управления рисками; Применять нормативно-технические до-кументы (стандарты и регламенты),описывающие процессы управления рисками; Применять нормативно-технические документы (стандарты и регламенты), описывающие процес-сы оценки сложности, трудоемкости, сроков выполнения ра-бот.	Умеет применять методы и средства управления рисками; нормативно-технические документы (стандарты и регламенты), описывающие процессы управления рисками при реализации ИТ проектов.
ПК-3.3. Определение областей применения процесса управления рис-ками; Анализ и оценка выявленных рисков, выбор способов реагирования на них и выделение необходимых ресурсов; Выявление и отслеживание рисков в процессе разработки про-граммного обеспечения; Мониторинг и оценка по выбранным критериям (показателям) сложности, трудоемкости и сроков выполнения работ; Определение критериев (показателей) оценки сложности, трудоемкости, сроков выполнения работ описывающие процессы оценки сложности, трудоемкости, сроков; Определение стратегий и приоритетов управления рисками; Принятие управленческих решений; Структурная декомпозиция работ.	Владеет навыками определения областей применения процесса управления рисками; анализа и оценки выявленных рисков, выбора способов реагирования на них и выделения необходимых ресурсов; определения стратегий и приоритетов управления рисками при реализации ИТ проектов.
ПК-8.1. Технологии межличностной и групповой коммуникации в деловом взаимодействии, основы конфликтологии	Знает технологии межличностной и групповой коммуникации в деловом взаимодействии, основы разрешения конфликтов в условиях риска и неопределенности.
ПК-8.2. Планировать работы в проекте; Управление персоналом в проекте	Умеет планировать работы в проекте, управлять командой проекта с учетом различных видов риска.

09.04.03 Прикладная информатика, направленность (профиль) "Корпоративные информационные системы"  
 Рабочая программа дисциплины  
 Дисциплина: Б1.В.ДВ.01.02 Риск-менеджмент в ИТ проектах  
 Форма обучения: очная, заочная  
 Разработана для приема 2020/2021, 2021/2022, 2022/2023 учебного года  
 Обновлено на 2023/2024 учебный год

Планируемые результаты обучения по ОП ВО (индикаторы достижения компетенций)	Планируемые результаты обучения по дисциплине
ПК-8.3. Оценка эффективности работы команды проекта; Корректировка планов управления персоналом в проекте; Оценка эффективности мероприятий по развитию и управлению командой проекта; Анализировать входные данные.	Владеет навыками оценки эффективности работы команды проекта; корректировки планов управления персоналом в проекте; оценка эффективности мероприятий по развитию и управлению команды проекта с учетом различных видов риска.

### 3. Содержание, объем дисциплины и формы проведения занятий

№ п/п	Наименование темы дисциплины	Компетенции	Оценочные средства текущего контроля		
			ЗНАТЬ	УМЕТЬ	ВЛАДЕТЬ
			ПК-3.1 ПК-8.1	ПК-3.2 ПК-8.2	ПК-3.3 ПК-8.3
1	Риск как экономическая категория. Виды и классификация рисков	ПК-3 ПК-8	Тестирование №1 (10)	Собеседование, опрос/ Контрольная работа №1 (10)	Круглый стол, дискуссия, полемика, дебаты/Эссе №1 (20)
2	Сущность и содержание риск-менеджмента. Управление рисками в системе риск-менеджмента	ПК-3 ПК-8	Тестирование №1 (10)	Собеседование, опрос/ Контрольная работа №1 (10)	Круглый стол, дискуссия, полемика, дебаты/Эссе №1 (20)
3	Оценка и анализ рисков в системе риск-менеджмента	ПК-3 ПК-8	Тестирование №2 (10)	Собеседование, опрос/ Контрольная работа №2 (10)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №1 (20)
4	Методы управления рисками. Особенности управления финансовыми рисками предприятия	ПК-3 ПК-8	Тестирование №2 (10)	Собеседование, опрос/ Контрольная работа №2 (10)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №2 (20)
<b>Количество баллов (100 баллов):</b>			100		

Содержание учебного материала, лабораторные работы и практические занятия, курсовая работа
<p><b>Тема 1:</b> Риск как экономическая категория. Виды и классификация рисков                      Эволюция представлений о риске. Сущность риска, его структурные характеристики. Общая классификация рисков.  <b>Практические занятия/самостоятельная работа:</b>                      Специфические классификации рисков  <b>Лабораторная работа:</b> -</p>
<p><b>Тема 2:</b> Сущность и содержание риск-менеджмента. Управление рисками в системе риск-менеджмента                      Понятие, цель и задачи риск-менеджмента. Функциональная структура риск-менеджмента. Организационная структура риск-менеджмента. Общая характеристика системы управления рисками. Концепция приемлемого риска. Активное и пассивное управление рисками. Основные этапы управления рисками.  <b>Практические занятия/самостоятельная работа:</b>                      Управление рисками с помощью ИТ.  <b>Лабораторная работа:</b> -</p>
<p><b>Тема 3:</b> Оценка и анализ рисков в системе риск-менеджмента                      Качественный анализ (оценка) рисков. Картографирование рисков. Контент-анализ. Статистические методы оценки рисков. Концепция рисковой стоимости Value at Risk (VaR). Экспертные методы оценки рисков.  <b>Практические занятия/самостоятельная работа:</b>                      Анализ инвестиционных рисков.  <b>Лабораторная работа:</b> -</p>
<p><b>Тема 4:</b> Методы управления рисками. Особенности управления финансовыми рисками предприятия</p>

09.04.03 Прикладная информатика, направленность (профиль) "Корпоративные информационные системы"  
 Рабочая программа дисциплины  
 Дисциплина: Б1.В.ДВ.01.02 Риск-менеджмент в ИТ проектах  
 Форма обучения: очная, заочная  
 Разработана для приема 2020/2021, 2021/2022, 2022/2023 учебного года  
 Обновлено на 2023/2024 учебный год

<b>Содержание учебного материала, лабораторные работы и практические занятия, курсовая работа</b>
Классификация методов управления рисками. Методы трансформации рисков. Методы финансирования рисков. Экономическая сущность и классификация финансовых рисков предприятия. Сущность и задачи управления финансовыми рисками. Методический инструментальный учета фактора риска в финансовых операциях. Методы обоснования управленческих решений в условиях риска и неопределенности. Механизмы нейтрализации финансовых рисков.
<b>Практические занятия/самостоятельная работа:</b> Разработка проекта.
<b>Лабораторная работа:</b> -
<b>Курсовая работа:</b> не предусмотрено учебным планом

### Очная форма обучения

Вид учебной работы	Всего часов	Семестр 2
Аудиторные занятия (АЗ):	48	48
Лекционные занятия (Лек)	16	16
Лабораторные занятия (Лаб)	0	0
Практические занятия (Пр)	32	32
Самостоятельная работа студента (СР)	87	87
Курсовая работа	0	0
Другие виды самостоятельной работы*	87	87
Контроль самостоятельной работы (КСР)	9	9
Контактная работа (КоР)	57	57
Форма промежуточной аттестации	0	Зачет
Подготовка к экзамену и сдача экзамена (СР, КоР)	0	0
Общая трудоемкость дисциплины, часы/ЗЕТ	144/4	144/4

\* Подготовка к аудиторным занятиям, подготовка к зачету (при наличии)

№	Наименование темы дисциплины	Семестр/ Курс	Количество учебных часов				Практическая подготовка
			В том числе по видам аудиторных занятий			СР	
			Лек	Пр	Лаб		
1	Риск как экономическая категория. Виды и классификация рисков	2	4	8	0	22	8
2	Сущность и содержание риск-менеджмента. Управление рисками в системе риск-менеджмента	2	4	8	0	22	8
3	Оценка и анализ рисков в системе риск-менеджмента	2	4	8	0	22	8
4	Методы управления рисками. Особенности управления финансовыми рисками предприятия	2	4	8	0	21	8
Итого:			16	32	0	87	32

\* Практическая подготовка при реализации дисциплин организована путем проведения практических занятий и (или) выполнения лабораторных и (или) курсовых работ и предусматривает выполнение работ, связанных с будущей профессиональной деятельностью.

### Заочная форма обучения

Вид учебной работы	Всего часов	Семестр 2
Аудиторные занятия (АЗ):	10	10
Лекционные занятия (Лек)	4	4
Лабораторные занятия (Лаб)	0	0
Практические занятия (Пр)	6	6
Самостоятельная работа студента (СР)	124	124
Курсовая работа	0	0
Другие виды самостоятельной работы*	124	124
Контроль самостоятельной работы (КСР)	6	6
Контактная работа (КоР)	16	16
Форма промежуточной аттестации	0	Зачет
Подготовка к экзамену/зачету и сдача экзамена/зачета (СР, КоР)	4	4

Вид учебной работы	Всего часов	Семестр 2
Общая трудоемкость дисциплины, часы/ЗЕТ	144/4	144/4

\* Подготовка к аудиторным занятиям

№	Наименование темы дисциплины	Семестр/ Курс	Количество учебных часов				Практическая подготовка
			В том числе по видам аудиторных занятий			СР	
			Лек	Пр	Лаб		
1	Риск как экономическая категория. Виды и классификация рисков	2	2	0	0	31	8
2	Сущность и содержание риск-менеджмента. Управление рисками в системе риск-менеджмента	2	2	2	0	31	8
3	Оценка и анализ рисков в системе риск-менеджмента	2	0	2	0	31	8
4	Методы управления рисками. Особенности управления финансовыми рисками предприятия	2	0	2	0	31	8
Итого:			4	6	0	124	32

\* Практическая подготовка при реализации дисциплин организована путем проведения практических занятий и (или) выполнения лабораторных и (или) курсовых работ и (или) путем выделения часов из часов, отведенных на самостоятельную работу, и предусматривает выполнение работ, связанных с будущей профессиональной деятельностью.

#### 4. Способ реализации дисциплины

Без использования онлайн-курса.

#### 5. Учебно-методическое обеспечение дисциплины:

*Основная литература:*

1. РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ 2-е изд., пер. и доп. Учебник / Вяткин В. Н., Гамза В. А., Маевский Ф. В. - Финансовый университет при Правительстве РФ (г. Москва), 2022 г. - 365 с. - ISBN 978-5-9916-3502-8 – Режим доступа: <https://urait.ru/book/risk-menedzhment-489098>

2. УПРАВЛЕНИЕ ИТ-ПРОЕКТАМИ И ПРОЦЕССАМИ. Учебник для вузов / Чекмарев А. В. - Национальный исследовательский университет «Высшая школа экономики» (г. Москва), 2022 г. - 228 с. - ISBN 978-5-534-11191-0 – Режим доступа: <https://urait.ru/book/upravlenie-it-proektami-i-processami-493916>

3. УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРОЕКТА 2-е изд. Учебное пособие для вузов / Шкурко В. Е. ; под науч. ред. Гребенкина А.В. - Уральский федеральный университет имени первого Президента России Б.Н. Ельцина (г. Екатеринбург), 2022 г. - 182 с. - ISBN 978-5-534-05843-7 – Режим доступа: <https://urait.ru/book/upravlenie-riskami-proekta-493673>

*Дополнительная литература:*

1. Кутергин В. А. — Бизнес-инжиниринг. Модельная интерпретация управления изменениями - Издательство Лань, 2022 г. - 396 с. - ISBN 978-5-8114-8531-4 – Режим доступа: <https://e.lanbook.com/book/193355>

2. СИСТЕМНЫЙ АНАЛИЗ И ПРОГРАММНО-ЦЕЛЕВОЙ МЕНЕДЖМЕНТ РИСКОВ. Учебник и практикум для вузов / Белов П. Г. - Московский авиационный институт (национальный исследовательский университет) (г. Москва), 2022 г. - 289 с. - ISBN 978-5-534-04690-8 – Режим доступа: <https://urait.ru/book/sistemnyy-analiz-i-programmno-celevoy-menedzhment-riskov-493057>

3. УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ 2-е изд. Учебник и практикум для вузов / Воронцовский А. В. - Санкт-Петербургский государственный университет (г. Санкт-Петербург), 2022 г. - 485 с. - ISBN 978-5-534-12206-0 – Режим доступа: <https://urait.ru/book/upravlenie-riskami-489580>

#### 6. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении

### **образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения**

1. Операционная система
2. Пакет прикладных офисных программ
3. Антивирусное программное обеспечение
4. LMS Moodle
5. Вебинарная платформа
6. MS Project

### **7. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», информационных справочных систем и профессиональных баз данных, необходимых для освоения дисциплины**

1. [ibooks.ru](https://ibooks.ru) : электронно-библиотечная система [Электронный ресурс] : профессиональная база данных. - Режим доступа: <https://ibooks.ru>. - Текст: электронный
2. Электронно-библиотечная система СПбУТУиЭ : электронно-библиотечная система [Электронный ресурс] : профессиональная база данных. - Режим доступа: <http://libume.ru>. - Текст: электронный
3. Юрайт : электронно-библиотечная система [Электронный ресурс] : профессиональная база данных. - Режим доступа: <https://urait.ru>. - Текст: электронный
4. [eLibrary.ru](http://elibrary.ru) : научная электронная библиотека [Электронный ресурс] : профессиональная база данных. - Режим доступа: <http://elibrary.ru>. - Текст: электронный
5. Архив научных журналов НЭИКОН [Электронный ресурс] : профессиональная база данных. - Режим доступа: [arhiv.naicon.ru](http://arhiv.naicon.ru). - Текст: электронный
6. КиберЛенинка : научная электронная библиотека [Электронный ресурс] : информационная справочная система. - Режим доступа: <http://cyberleninka.ru>. - Текст: электронный
7. Лань : электронно-библиотечная система [Электронный ресурс] : профессиональная база данных. - Режим доступа: <https://e.lanbook.com>. - Текст: электронный
8. Корпоративный менеджмент [Электронный ресурс] : информационная справочная система . - Режим доступа: <https://www.cfin.ru>. - Текст: электронный
9. [it-world.ru](https://www.it-world.ru) [Электронный ресурс] : информационная справочная система . - Режим доступа: <https://www.it-world.ru>. - Текст: электронный
10. Connect: IT-технологии : информационная справочная система. - Режим доступа: <https://www.connect-wit.ru/>. - Текст: электронный
11. Компьютерра : информационная справочная система . - Режим доступа: <https://www.computerra.ru/>. - Текст: электронный
12. Экономический портал [Электронный ресурс] : информационная справочная система . - Режим доступа: <http://institutiones.com>. - Текст: электронный
13. Министерство цифрового развития, связи и массовых коммуникаций Российской Федерации: профессиональная база данных. - Режим доступа: <https://digital.gov.ru>. - Текст: электронный
14. Министерство экономического развития Российской Федерации: профессиональная база данных. - Режим доступа: <http://economy.gov.ru>. - Текст: электронный
15. Федеральная служба по надзору в сфере связи, информационных технологий и массовых коммуникаций: профессиональная база данных . - Режим доступа: <https://rkn.gov.ru>. - Текст: электронный
16. Экономика. Социология. Менеджмент: федеральный образовательный портал: профессиональная база данных. - Режим доступа: <http://ecsocman.hse.ru/>. - Текст: электронный
17. [Math-Net.Ru](https://www.mathnet.ru/): профессиональная база данных . - Режим доступа: <https://www.mathnet.ru/>. - Текст: электронный

### **8. Материально-техническое обеспечение дисциплины**

1. Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, семинарского типа - практических занятий, для групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, оборудованная: рабочими местами для обучающихся, оснащенными специальной мебелью; рабочим местом преподавателя, оснащенным специальной мебелью, персональным компьютером с возможностью подключения к сети «Интернет» и доступом к электронной информационно-образовательной среде Университета; техническими средствами обучения - мультимедийным оборудованием (проектор, экран, колонки) и маркерной доской; лицензионным программным обеспечением

2. Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа - практических занятий – компьютерный класс, оборудованный рабочими местами для обучающихся, оснащенными специальной мебелью, персональными компьютерами с возможностью подключения к сети «Интернет» и доступом к электронной информационно-образовательной среде Университета; рабочим местом преподавателя, оснащенным специальной мебелью, персональным компьютером с возможностью подключения к сети «Интернет» и доступом к электронной информационно-образовательной среде Университета; техническими средствами обучения - мультимедийным оборудованием (проектор, экран, колонки) и маркерной доской; лицензионным программным обеспечением

3. При применении электронного обучения, дистанционных образовательных технологий используются: виртуальные аналоги учебных аудиторий - вебинарные комнаты на вебинарных платформах, рабочее место преподавателя, оснащенное персональным компьютером (планшет, мобильное устройство) с возможностью подключения к сети «Интернет», доступом к электронной информационно-образовательной среде Университета и к информационно-образовательному portalу Университета [imeos.ru](http://imeos.ru), веб-камерой, микрофоном и гарнитурой (в т.ч. интегрированными в устройства), программным обеспечением; рабочее место обучающегося оснащено персональным компьютером (планшет, мобильное устройство) с возможностью подключения к сети «Интернет», доступом к электронной информационно-образовательной среде Университета и к информационно-образовательному portalу Университета [imeos.ru](http://imeos.ru), веб-камерой, микрофоном и гарнитурой (в т.ч. интегрированными в устройства). Авторизация на информационно-образовательном portalе Университета [imeos.ru](http://imeos.ru) и начало работы осуществляются с использованием персональной учетной записи (логина и пароля). Лицензионное программное обеспечение

4. Помещение для самостоятельной работы, оборудованное специальной мебелью, персональными компьютерами с возможностью подключения к сети «Интернет» и доступом к электронной информационно-образовательной среде Университета, лицензионным программным обеспечением

## **9. Оценочные материалы по дисциплине**

Описание оценочных средств (показатели и критерии оценивания, шкалы оценивания) представлено в приложении к основной профессиональной образовательной программе «Каталог оценочных средств текущего контроля и промежуточной аттестации».

Процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности приводятся в соответствующих методических материалах и локальных нормативных актах Университета.

Для оценивания учебных достижений студентов в Университете действует балльно-рейтинговая система.

Если оценка, соответствующая набранной в семестре сумме рейтинговых баллов, удовлетворяет студента, то она является итоговой оценкой по дисциплине при проведении промежуточной аттестации в форме экзамена/зачета с оценкой/зачета.

Условием сдачи экзамена/зачета с оценкой/зачета с целью повышения итоговой оценки по дисциплине является сдача студентом экзамена, за который он получает экзаменационные баллы без учета баллов, полученных за текущий контроль:

**Шкала оценивания учебных достижений по дисциплине, завершающейся зачетом без оценки**

Баллы по дисциплине	60 и менее		61-73		74-90		91-100	
Итоговая оценка по дисциплине	Незачет		Зачет					
Баллы в международной шкале ECTS с буквенным обозначением уровня	50 и менее	51-60	61-67	68-73	74-83	84-90	91-100	
	F	Fx	E	D	C	B	A	
Уровень сформированности компетенций	Не сформированы		Пороговый		Высокий		Повышенный	

**Шкала оценивания учебных достижений по дисциплине, завершающейся экзаменом/зачетом с оценкой**

Баллы по дисциплине	60 и менее		61-73		74-90		91-100	
Итоговая оценка по дисциплине	Неудовлетворительно		Удовлетворительно		Хорошо		Отлично	
Баллы в международной шкале ECTS с буквенным обозначением уровня	<50	51-60	61-67	68-73	74-83	84-90	91-100	
	F	Fx	E	D	C	B	A	
Уровень сформированности компетенций	Не сформированы		Пороговый		Высокий		Повышенный	

**9.1. Типовые контрольные задания для текущего контроля  
Тестирование №1**

- Рисковую ситуацию характеризует:
  - случайный вероятностный характер события
  - наличие альтернативных решений
  - 100%-я вероятность возникновения убытков
  - 50%-я вероятность получения дополнительной прибыли
- Риск поломки оборудования можно классифицировать как риск:
  - внутренний
  - катастрофический
  - страхуемый
- Процесс страхования имущества и имущественных интересов предприятия характеризует функцию риска:
  - стимулирующую
  - защитную
  - регулирующую
  - нормативную.
- Основной целью риск-менеджмента является:
  - оценка воздействия рисков
  - разработка и реализация стратегии управления риском
  - снижение опасности принятия ошибочного решения и уменьшение возможных негативных последствий нежелательного развития событий
- Кто из экономистов первым дал четкое разграничение понятий риск и неопределенность:
  - А. Р. Кантильон
  - Б. К. Маркс
  - В. А. Маршалл
  - Г. Ф. Найт.

### Тестирование №2

1. Участие всех подразделений компании в процессе выявления и оценки рисков по направлениям деятельности подразумевает принцип:
  - a) системности
  - b) комплексности
  - c) интегрированности
  - d) непрерывности
2. Способность к приспособлению к стремительно изменяющимся условиям, высокую скорость реагирования на неблагоприятные ситуации предполагает такое свойство системы управления риском, как:
  - a) гибкость и адаптивность
  - b) адекватность
  - c) многофункциональность
3. Информационная основа для всей процедуры риск-менеджмента формируется на этапе:
  - a) мониторинга результатов и совершенствования системы управления рисками
  - b) идентификации и анализа рисков
  - c) анализа альтернативных методов управления риском
4. Сущность метода VaR заключается в определении:
  - a) верхней оценки капитала, который может быть потерян в результате неблагоприятного стечения обстоятельств;
  - b) вариантов, сценариев развития событий при различных условиях;
  - c) возможности отклонения от запланированных результатов.
5. Финансовыми рисками являются:
  - a) политический риск
  - b) риск снижения финансовой устойчивости
  - c) инфляционный риск
  - d) b и c
  - e) все вышеперечисленное

### Собеседование, опрос/Контрольная работа №1

Рассчитайте среднее ожидаемое значение. Данные для расчета. При вложении капитала в мероприятие А из 200 случаев прибыль 25 тыс. руб. была получена в 20 случаях, 30 тыс. руб. была получена в 80 случаях, прибыль 40 тыс. руб. была получена в 100 случаях. При вложении капитала в мероприятие Б из 240 случаев прибыль 30 тыс. руб. была получена в 144 случаях, прибыль 35 тыс. руб. была получена в 72 случаях, прибыль 45 тыс. руб. была получена в 24 случаях.

### Собеседование, опрос/Контрольная работа №2

Определите, какой из видов деятельности является наименее рискованным, если известны данные о рентабельности каждого вида деятельности за ряд лет

Год	2005	2006	2007	2008	2009
Рен. А	0,26	0,28	0,17	0,37	0,24
Рен. Б	0,11	0,65	0,26	0,1	0,56

### Круглый стол, дискуссия, полемика, дебаты/Эссе №1

1. Основные положения классической и неоклассической теорий риска
2. Статистические методы оценки риска
3. Виды рисков, специфика и управление рисками в банковской деятельности

### **Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №1**

Предприниматель занят изданием глянцевого журнала. Он решает вопрос об увеличении тиража конкретного журнала. Известно следующее:

Суммарные затраты, связанные с выпуском 1 журнала, составляют 2,3 долл.

Предполагаемая новая (сниженная) цена журнала составляет 4 долл.

Число клиентов, которым направляется предложение о подписке по сниженной цене, равно 100 000 чел.

Затраты на рассылку предложения составляют 0,1 долл. на одного человека.

Предприниматель на основе личного опыта подобных предложений может предположить, что процент положительных ответов будет около 10%.

Будут ли оправданы дополнительные расходы на увеличение тиража?

Стоит ли рисковать?

### **Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №2**

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

А. Построить большой завод стоимостью  $M_1 = 700$  тысяч долларов. При этом варианте возможны большой спрос (годовой доход в размере  $R_1 = 280$  тысяч долларов в течение следующих 5 лет) с вероятностью  $p_1 = 0,8$  и низкий спрос (ежегодные убытки  $R_2 = 80$  тысяч долларов) с вероятностью  $p_2 = 0,2$ .

Б. Построить маленький завод стоимостью  $M_2 = 300$  тысяч долларов. При этом варианте возможны большой спрос (годовой доход в размере  $T_1 = 180$  тысяч долларов в течение следующих 5 лет) с вероятностью  $p_1 = 0,8$  и низкий спрос (ежегодные убытки  $T_2 = 55$  тысяч долларов) с вероятностью  $p_2 = 0,2$ .

В. Отложить строительство завода на один год для сбора дополнительной информации, которая может быть позитивной или негативной с вероятностью  $p_3 = 0,7$  и  $p_4 = 0,3$  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.

## **9.2. Примерный перечень тем курсовой работы**

Не предусмотрено учебным планом

## **9.3. Типовые контрольные задания для промежуточной аттестации: зачет**

### **Примерный перечень теоретических вопросов к зачету**

1. Основные положения классической и неоклассической теорий риска
2. Статистические методы оценки риска
3. Виды рисков, специфика и управление рисками в банковской деятельности
4. Анализ чувствительности
5. Управление рисками в страховом бизнесе
6. Метод Дельфи
7. Управление инвестиционными рисками

8. Скорринговая оценка
9. Производственные риски
10. Экспертные методы оценки риска
11. История возникновения риск-менеджмента
12. Метод контент-анализа
13. Управление риском как часть общего менеджмента фирмы
14. Метод оценки рисков «Дерево решений»
15. Зарубежный опыт риск-менеджмента
16. Аутсорсинг риска
17. Анализ риска банкротства организации
18. Методы финансирования рисков
19. Основные пути развития системы управления рисками
20. Методы трансформации рисков

### Примерный перечень практических заданий к зачету

#### Вариант 1

Задание 1. Опишите риск снижения спроса на продукцию предприятия структурно по следующим характеристикам: опасность, подверженность риску, уязвимость (чувствительность к риску) и степень взаимодействия рисков.

Задание 2. Решите задачу:

В соответствии с разработанным бизнес-планом инвестиционного проекта размер плановой прибыли по проекту составляет 5400 тыс. долл. Постройте карту рисков проекта на основании следующих параметров:

- 1) вероятность воздействия рисков;
- 2) доля величины потерь, возникающих в результате воздействия риска по отношению к плановой прибыли организации по проекту.

Исходные данные для построения карты рисков представлены в табл.

Таблица 1 - Исходные данные для построения карты рисков

№п/п	Вид риска	Вероятность воздействия риска, доли единицы	Потери в результате воздействия рисков, тыс. долл.
P1	Риск превышения сметной стоимости проекта	0,20	350
P2	Риск задержки сдачи объекта	0,25	350
P3	Технологический риск	0,4	2500
P4	Риск обеспечения сырьем и энергией	0,6	1500
P5	Транспортный риск	0,40	200
P6	Риск реализации проектного продукта	0,5	4000
P7	Валютный риск	0,45	150
P8	Риск изменения процентной ставки	0,25	150
P9	Риски возникновения гражданской ответственности (экологические и др.)	0,3	1000

Сделайте выводы относительно каждого вида риска.

Примечание. Границы толерантности к риску:

1. Зона «допустимого риска» (зеленая зона): вероятность воздействия риска от 0 до 0,35 (включительно); величина потерь в результате воздействия риска составляет от 0 до 25 % (включительно) общей величины плановой прибыли по проекту.
2. Зона «среднего риска» (желтая зона): вероятность воздействия риска составляет от 0,36 до 0,70 (включительно); потери от воздействия риска — от 26 до 50 % (включительно) величины плановой прибыли по проекту.
3. Зона «недопустимого риска» (красная зона): вероятность воздействия риска свыше 0,71; величина потерь в результате воздействия риска составляет более 51 % общей величины

плановой прибыли по проекту.

### Вариант 2

Задание 1. Классифицируйте риск потери платежеспособности согласно общей классификации рисков.

Задание 2. Решите задачу:

Определите размер ожидаемого рискового ущерба по причине вероятного отклонения прибыли предприятия в 2010 г. Известны данные по фактической прибыли предприятия с 2002 г. по 2009 г. (см. табл.). Уровень приемлемого риска составляет 0,25% от ожидаемой прибыли. Теоретическая вероятность риска примерно равна частоте прогнозируемого размера прибыли.

Таблица 2 – Балансовая прибыль предприятия

Год	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009
Прибыль, млн.руб.	5,1	5	5,3	5,1	5,1	5,2	5,4	5,4

### Вариант 3

Задание 1. Перечислите возможные факторы и причины риска банкротства предприятия.

Задание 2. Решите задачу:

На основе данных, представленных в таблице, дайте оценку вероятности наступления риска неоплаты или несвоевременной оплаты услуг фирмы с помощью контент-анализа:

Таблица 3

### Вариант 4

Задание 1. Опишите риск просрочки выплаты долга дебитором структурно по следующим характеристикам: опасность, подверженность риску, уязвимость (чувствительность к риску) и степень взаимодействия рисков.

Задание 2. Решите задачу:

Определите, какой из видов деятельности является более рискованным, если известны данные о рентабельности каждого вида деятельности за ряд лет (см. табл.4).

Таблица 4 – Рентабельность видов деятельности А и Б

Год	2006	2007	2008	2009	2010
Рен. А	0,25	0,27	0,3	0,25	0,3
Рен. Б	0,4	0,42	0,1	0,1	0,51

### Вариант 5

Задание 1. Классифицируйте риск разрушения складского помещения фирмы в результате стихийного бедствия согласно общей классификации рисков.

Задание 2. Решите задачу:

Используя экономико-статистический метод, определите планируемый размер прибыли предприятия в 2010 г. Исходные данные представлены в таблице.

Таблица 5

Показатель	Год										
	2000	2001	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010
Прибыль предприятия, т.р.	45	46	45	47	47	46	47	47	48	43	

### Вариант 6

Задание 1. Перечислите возможные факторы и причины риска потери платежеспособности предприятия.

**Задание 2. Решите задачу:**

Определить однодневный VaR с доверительной вероятностью 99% для портфеля стоимостью 15 млн. руб., в который входят акции только одной компании. Стандартное отклонение доходности акции в расчете на год равно 32%.

**Вариант 7**

Задание 1. Опишите риск возникновения сбоев в поставках сырья структурно по следующим характеристикам: опасность, подверженность риску, уязвимость (чувствительность к риску) и степень взаимодействия рисков.

Задание 2. Решите задачу:

На основе данных, представленных в таблице (см. табл. Вариант 3), дайте оценку вероятности наступления риска неоплаты или несвоевременной оплаты услуг фирмы с помощью экономико-статистического метода.

**Вариант 8**

Задание 1. Классифицируйте риск резкого снижения курса рубля согласно общей классификации рисков.

Задание 2. Решите задачу:

Для финансирования проекта бизнесмену нужно занять сроком на один год 25000 ф. ст. Банк может одолжить ему эти деньги под 22% годовых или вложить в дело со 100%-ным возвратом суммы, но под 12% годовых. Из прошлого опыта банкиру известно, что 5% таких клиентов ссуду не возвращают. Что делать? Давать ему заем или нет? (Постройте «дерево решений»)

**Вариант 9**

Задание 1. Перечислите возможные факторы и причины риска ухудшения финансового состояния предприятия.

Задание 2. Решите задачу:

По оценкам отдела маркетинга, вероятность роста объема продаж предприятия в ближайшее время равна 0,6. Из прошлого опыта известно, что положительные прогнозы отдела маркетинга сбываются в 84% случаях, а отрицательные – в 95% случаях. Определите вероятность роста объема продаж предприятия в ближайшее время (постройте дерево решений).

**Вариант 10**

Задание 1. Опишите риск выхода из строя оборудования структурно по следующим характеристикам: опасность, подверженность риску, уязвимость (чувствительность к риску) и степень взаимодействия рисков.

Задание 2. Решите задачу:

В таблице указаны вероятности получения прибыли для двух вариантов инвестирования. Сравните эти варианты, рассчитав математическое ожидание и стандартное отклонение.

Таблица 6

Прибыль, млн. руб.	-3	-1	0	2	4	5
Вариант 1	0,2	0,2	0,2	0,1	0,3	0
Вариант 2	0	0,1	0,1	0,2	0,3	0,3